

---

# 上海海通证券资产管理有限公司

## 海通策略优选混合型集合资产管理计划 招募说明书

管理人：上海海通证券资产管理有限公司

托管人：中国民生银行股份有限公司

二〇二二年九月

## 【重要提示】

海通策略优选混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由海通半年升集合资产管理计划变更而来，海通半年升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管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》及其他有关规定募集，并于2013年6月5日获得中国证券业协会（中证协函【2013】581号）《关于上海海通证券资产管理有限公司发起设立海通半年升集合资产管理计划的备案确认函》。

管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

海通半年升集合资产管理计划的变更经中国证监会批准，但中国证监会对海通半年升集合资产管理计划的变更为本集合计划的批准，并不表明其对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。

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

投资有风险，投资人申购集合计划时应当认真阅读本招募说明书。集合计划的过往业绩并不预示其未来表现，管理人管理的其他产品的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。

本集合计划投资于证券、期货市场，集合计划资产净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本集合计划前，需充分了解本集合计划的产品特性，并承担计划投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于集合计划申购、赎回等因素造成的流动性风险，管理人在集合管理实施过程中产生的管理风险，本集合计划的特定风险等。

本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。本集合计划可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

本集合计划的投资范围包括股指期货，投资于股指期货需承受市场风险、市场流动性风险、结算流动性风险、基差风险、信用风险、作业风险等。

本集合计划的投资范围包括股票期权，投资于股票期权需承受市场风险、流动性风险、保证金风险、基差风险、信用风险、操作风险等。

本集合计划的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。

本集合计划在法律法规允许的前提下可参与融资业务。存在信用风险、投资风险和合规风险等风险。集合计划份额持有人需承担由此带来的风险与成本。

本集合计划投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”），会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（如港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对集合计划的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市而香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股市场股票不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险请参见本招募说明书的“风险揭示”章节。本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。

本集合计划的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的集合计划所面临的共同风险外，本集合计划还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

投资者依据原《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通半年升集合资产管理计划份额，自资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合计划 A 类份额。

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

集合计划。

## 目 录

第一部分 前言.....	6
第二部分 释义.....	7
第三部分 管理人.....	13
第四部分 托管人.....	23
第五部分 相关服务机构.....	30
第六部分 集合计划的历史沿革.....	32
第七部分 集合计划的存续.....	33
第八部分 集合计划份额的申购与赎回.....	34
第九部分 集合计划的投资.....	47
第十部分 集合计划的财产.....	56
第十一部分 集合计划资产的估值.....	57
第十二部分 集合计划的收益分配.....	64
第十三部分 集合计划的费用与税收.....	66
第十四部分 集合计划份额的折算.....	69
第十五部分 集合计划的会计与审计.....	70
第十六部分 集合计划的信息披露.....	71
第十七部分 侧袋机制.....	78
第十八部分 风险揭示.....	81
第十九部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算.....	89
第二十部分 资产管理合同内容摘要.....	91
第二十一部分 集合计划托管协议的内容摘要.....	109
第二十二部分 对集合计划份额持有人的服务.....	129
第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	130
第二十四部分 备查文件.....	131

## 第一部分 前言

《海通策略优选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《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称《信息披露办法》）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规的规定以及《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”或《资产管理合同》）编写。

本招募说明书阐述了海通策略优选混合型集合资产管理计划的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

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

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书根据本集合计划的资产管理合同编写，并经中国证监会核准。资产管理合同是约定集合计划当事人之间权利、义务的法律文件。招募说明书主要向投资者披露与本集合计划相关事项的信息，是投资者据以选择及决定是否投资于本集合计划的要约邀请文件。集合计划投资者依据资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和本集合计划资产管理合同的当事人，其持有集合计划份额的行为本身即表明其对资产管理合同的承认和接受，并按照《基金法》、资产管理合同及其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，应详细查阅资产管理合同。

## 第二部分 释义

本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、集合资产管理计划、集合计划或本集合计划：指海通策略优选混合型集合资产管理计划
- 2、管理人：指上海海通证券资产管理有限公司
- 3、托管人：指中国民生银行股份有限公司
- 4、集合资产管理合同、资产管理合同或《资产管理合同》：指《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》及对资产管理合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指管理人与托管人就本集合计划签订之《海通策略优选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《海通策略优选混合型集合资产管理计划招募说明书》及其更新
- 7、产品资料概要：指《海通策略优选混合型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对集合资产管理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 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1

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

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

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

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

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、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

20、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外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

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

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

23、销售机构：指上海海通证券资产管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与管理人签订了集合计



划销售服务协议，办理集合计划销售业务的机构

24、**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基金账户的建立和管理、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

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

26、**集合计划基金账户**：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、集合计划所管理的集合计划份额余额及其变动情况的账户

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

28、**资产管理合同生效日**：《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日，《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》同日失效

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

30、**存续期**：指《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》生效至资产管理合同终止之间的期限

31、**工作日**：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

32、**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

33、**T+n日**：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

34、**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

35、**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（若本集合计划参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则管理人可根据实际情况决定本集合计划是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准）

36、**《业务规则》**：指中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则及其不时做出的修订

37、**申购**：指资产管理合同生效后，投资人根据资产管理合同和招募说明书

的规定申请购买集合计划份额的行为

38、赎回：指资产管理合同生效后，集合计划份额持有人按资产管理合同规定的条件要求将集合计划份额兑换为现金的行为

39、集合资产管理计划转换：指集合计划份额持有人按照资产管理合同和管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有管理人管理的、某一集合资产管理计划的集合计划份额转换为管理人管理的其他集合资产管理计划的份额的行为

40、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

41、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

42、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%

43、元：指人民币元

44、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

45、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

46、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

47、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

48、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

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

50、集合计划份额类别：指根据申购/赎回规则、申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本集合计划份额分为不同的类别，各集合计划份额类别分别设置代码，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

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

对于投资者依据原《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通半年升集合资产管理计划份额，自资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合计划A类份额

52、C类集合计划份额、C类份额：指从本类别集合计划资产中计提销售服务费而不收取申购费用，投资人赎回时根据持有期限收取赎回费用的集合计划份额类别

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

54、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

55、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

56、港股通标的股票：指内地投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所或者经中国证监会认可的机构在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

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

账户，专门账户称为侧袋账户

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

**59、不可抗力：**指资产管理合同当事人不能预见、不能避免、不能克服，使资产管理合同当事人无法全部履行或无法部分履行资产管理合同的任何事件和因素，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、系统故障、突发停电或其他突发事件、证券、期货交易所或证券登记结算机构非正常暂停或停止交易或发送数据存在延误、错漏

## 第三部分 管理人

### 一、管理人概况

本集合计划的管理人为上海海通证券资产管理有限公司，基本信息如下：

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

法定代表人：裴长江

总经理：李井伟

成立日期：2012 年 6 月 26 日

实缴注册资本：22 亿元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：海通证券股份有限公司持股 100%

联系人：苗童

电话：021-23219000

上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“海通资产管理”）是在海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）原客户资产管理部基础上组建起来的、由海通证券全额出资的子公司。

2012 年 3 月 26 日，中国证券监督管理委员会作出了《关于核准海通证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2012]418 号），批准设立海通资产管理。2012 年 6 月 26 日，经上海市工商局核准，海通资产管理取得营业执照。公司注册资本为 10 亿元人民币，实收资本 10 亿元人民币，经营范围为证券资产管理业务。

2012 年 7 月 24 日，中国证券监督管理委员会向海通资产管理颁发了《中华人民共和国经营证券业务许可证》，审核批准公司从事证券资产管理业务。

2014 年 2 月 21 日，经公司董事会决议，海通证券对海通资产管理增资 2 亿元人民币。2014 年 8 月 8 日，海通资产管理取得增资后的营业执照，公司注册资本为 12 亿元人民币。

2016 年 8 月 31 日，经公司董事会决议，海通证券对海通资产管理增资 10 亿元人民币。2016 年 12 月 8 日，海通资产管理取得增资完成后的营业执照，公司注册资本变更为 22 亿元人民币。

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员

裴长江先生，经济学硕士，从事证券工作 29 年。先后担任上海万国证券公司闸北营业部总经理助理、总经理；申银万国证券公司浙江管理总部副总经理、经纪总部副总经理；华宝信托投资有限责任公司投资总监、华宝兴业基金管理有限公司投资总监、总经理、华宝兴业资产管理（香港）有限公司董事长。2013 年 7 月加入海通证券，现任海通证券股份有限公司副总经理、海通期货股份有限公司董事长、上海海通证券资产管理有限公司董事长、富国基金管理有限公司董事长。

李井伟先生，经济学博士，从事证券工作 24 年。1998 年 6 月加入海通证券，先后担任海通证券投资管理部（深圳）投资部经理、投资总监兼任红岭中路营业部总经理、投资管理部（深圳）副总经理兼任红岭中路营运部总经理、嘉宾路营业部总经理、深圳分公司副总经理兼深圳销售中心总经理、广东分公司总经理。现任上海海通证券资产管理有限公司总经理、董事。

吴淑琨先生，管理学博士，从事证券工作 21 年。2001 年 11 月加入海通证券，先后担任研究所所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户部副总经理（主持工作），企业金融部总经理。现任海通证券战略发展部总经理，海通恒信国际租赁股份有限公司董事，海富通基金管理有限公司董事，上海海通证券资产管理有限公司董事。

张少华先生，本科学历，从事证券工作 26 年。1996 年 6 月加入海通证券，先后担任计划财务部总经理助理、计划财务部副总经理、资金管理总部副总经理、资金管理总部副总经理（主持工作）。现任海通证券资金管理总部总经理、海通期货股份有限公司董事、海通恒信国际租赁股份有限公司董事、上海海通证券资产管理有限公司董事。

吴国华先生，经济学硕士，从事证券工作 15 年。2011 年 7 月加入海通证券，先后担任无锡解放东路证券营业部总经理、深圳分公司总经理、零售与网络金融部总经理。现任海通证券财富管理总部总经理，上海海通证券资产管理有限公司董事。

### 2、监事

宋世浩先生，工商管理硕士，从事证券工作 22 年。2000 年 3 月加入海通证

券，先后担任天津营业部总经理助理、天津营业部副总经理、兰州业务总部副总经理、兰州业务总部副总经理（主持工作）、甘肃分公司总经理、经纪业务运营中心副总经理、合规与风险管理总部副总经理（主持工作）、合规与风险管理总部总经理。现任海通证券股份有限公司证券金融部总经理，上海海通证券资产管理有限公司监事。

### 3、公司高管人员

裴长江先生，上海海通证券资产管理有限公司董事长。同前述。

李井伟先生，上海海通证券资产管理有限公司总经理。同前述。

邓航先生，法学博士，从事证券工作 19 年。2020 年 1 月加入上海海通证券资产管理有限公司。先后担任易方达基金分公司总经理、国投瑞银基金总经理助理、华泰保兴基金副总经理、凯盛信息科技股份有限公司高级副总裁。现任上海海通证券资产管理有限公司副总经理兼市场策划部总监兼北方区域部总监兼华东区域部总监兼华南区域部总监。

胡倩女士，经济学博士，从事证券工作 21 年。2015 年 3 月加入上海海通证券资产管理有限公司，先后担任海通证券研究所首席分析师、长信基金管理有限公司金融工程部总监、基金经理。现任上海海通证券资产管理有限公司总经理助理兼专户权益部总监兼公募权益部总监。

陈颖女士，工学学士，从事证券工作 16 年。2011 年 11 月加入海通证券。先后担任华安基金管理有限公司信息技术部总助、海通证券客户资产管理部高级经理、上海海通证券资产管理有限公司产品运营部总监。现任上海海通证券资产管理有限公司首席信息官、首席风险官兼信息部总监。

曾丽琼女士，金融学硕士，从事证券工作 20 年。2017 年 12 月加入上海海通证券资产管理有限公司。先后担任华宝兴业基金管理有限公司基金经理、信诚基金管理有限公司基金经理、部门总监、中山证券有限责任公司资管事业八部总经理、上海海通证券资产管理有限公司投资经理、固定收益二部副总监（主持工作）、固定收益二部总监。现任上海海通证券资产管理有限公司总经理助理兼专户固收一部总监兼专户固收二部总监。

张承启先生，经济学硕士，从事证券工作 12 年。2019 年 12 月加入上海海通证券资产管理有限公司。先后担任上海申银万国证券研究所有限公司研究员、上海海通证券资产管理有限公司固定收益研究员、长江养老保险股份有限公司

投资经理、上海光大证券资产管理有限公司投资经理、上海海通证券资产管理有限公司固收研究部总监、固收研究部总监兼权益研究部总监。现任上海海通证券资产管理有限公司总经理助理兼固收研究部总监兼权益研究部总监。

吴文然女士，法律硕士，从事证券工作9年。2013年3月加入上海海通证券资产管理有限公司。先后担任上海工银安盛人寿保险有限公司合规经理、上海海通证券资产管理有限公司合规经理、合规与法务部总监、总经理助理兼合规与法务部总监。现任上海海通证券资产管理有限公司合规总监兼合规与法务部总监。

#### 4、合规负责人

吴文然女士，上海海通证券资产管理有限公司合规总监兼合规与法务部总监。同前述。

#### 5、本集合计划投资经理

胡倩女士，上海财经大学经济学博士，21年证券从业经验，曾任海通证券研究所首席分析师、长信基金管理有限公司金融工程部总监、基金经理，现任上海海通证券资产管理有限公司总经理助理兼专户权益部总监兼公募权益部总监。

董传盛先生，复旦大学微电子系硕士，加拿大麦吉尔大学电子计算机工程系博士，6年证券从业经验，曾任上海海通证券资产管理有限公司研究员，现任上海海通证券资产管理有限公司量化部投资经理。

#### 6、投资决策委员会成员

胡倩女士，总经理助理兼专户权益部总监兼公募权益部总监。

张承启先生，总经理助理兼固收研究部总监兼权益研究部总监。

李坤先生，公募固收部副总监（主持工作）。

钱玲玲女士，公募权益部总监助理。

邱博文先生，公募固收部基金经理。

#### 7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、管理人的职责

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

2、办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金手续；

3、对所管理的不同集合计划财产分别管理、分别记账，进行证券投资；



4、按照资产管理合同的约定确定集合计划收益分配方案，及时向集合计划份额持有人分配收益；

5、进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

6、编制季度报告、中期报告和年度报告；

7、计算并公告集合计划净值信息，确定集合计划份额申购、赎回价格；

8、办理与集合计划财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集集合计划份额持有人大会；

10、保存集合计划财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

12、中国证监会规定的其他职责。

#### 四、管理人承诺

1、管理人将根据资产管理合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本集合计划的投资。

2、管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》(以下简称“《证券法》”)、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》及其他有关法律、法规的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》及其他有关法律、法规行为的发生。

3、管理人不得从事下列违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止法律、法规规定的禁止行为的发生：

(1) 违反集合计划份额持有人的利益，将集合计划资产用于向第三人抵押、担保、资金拆借或者贷款，按照国家有关规定进行融资担保的除外；

(2) 从事有可能使集合计划承担无限责任的投资；

(3) 从事证券承销行为；

(4) 违反证券交易业务规则，操纵和扰乱市场价格；

(5) 违反法律、法规而损害集合计划份额持有人利益的；

(6) 法律、法规及监管机关规定禁止从事的其它行为。

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

(1) 越权或违规经营；

- (2) 违反资产管理合同或托管协议；
- (3) 故意损害集合计划份额持有人或其它集合计划相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 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；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，扰乱市场秩序；
- (9) 在公开信息披露中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (10) 其它法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 5、投资经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和资产管理合同的规定，本着谨慎的原则为集合计划份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己及其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取利益；
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密、尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息；
- (4) 不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

#### 五、管理人的风险管理体系

健全、完善的内部风险控制制度是公司持续、稳健发展的重要保证，也是衡量公司经营管理水平的重要标志。公司应建立高效运行、控制严密、科学合理、切实有效的风险控制制度体系。

##### 1、风险管理原则

管理人风险管理体系的构建将严格遵循以下原则：

- (1) 健全性原则：内部风险控制应覆盖到相关的所有部门和岗位，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各项业务过程和业务环节。
- (2) 全员性原则：员工是风险控制的基础及第一人，风险控制必须涵盖全体员工，不断提高员工对风险的识别和防范能力，树立全员风险意识。
- (3) 审慎性原则：内部风险控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点。

(4) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公募产品资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。公司的风控与稽核部、合规与法务部具有并保持高度的独立性和权威性。

(5) 相互制约原则：公司涉及公募业务的各部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

(6) 适时有效原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。在保证所有风险控制措施切实有效的基础上，公司公募业务内部控制制度的制定应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境和国家法律法规、市场变化等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。

(7) 持续性原则：公司涉及公募业务的相关部门应对风险实施持续控制，对业务中的风险进行持续的识别、评估，及时采取相应的控制措施。

(8) 防火墙原则：公司公募业务、公司私募资产管理业务和公司自有资金投资业务，公募产品投资和公募产品研究，公募产品投资决策和交易清算应在空间上和制度上严格隔离。对因业务需要知悉内幕信息和穿越防火墙的人员，应制定严格的批准程序和监督处罚措施。

(9) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的成本控制达到最佳的风险控制效果。

(10) 风险控制与业务发展同等重要原则：风险是公司公募业务中客观存在的，如果没有正确的风险管理措施，可能会给公司或公募产品份额持有人带来无法估量的损失。因此，公司公募业务的发展必须建立在内部控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司公募业务发展放在同等地位上。

(11) 定性与定量相结合原则：建立完备的制度体系和量化指标体系，采用定性分析和定量分析相结合的方法，同时重视数量分析模型和定性分析的应用，使风险控制更具科学性和可操作性。

## 2、风险管理组织架构

公司建立健全严密有效的多级风险防范体系，并根据公募业务流程和风险特征，将该业务的风险管理工作纳入公司的风险管理体系之中。公司公募业务的风险控制体系共分四个层次：

(1) 第一层次为公司董事会。

- (2) 第二层次为公司经营层下设的合规与风险控制委员会。
- (3) 第三层次为公司内设的合规与法务部和风控与稽核部。
- (4) 第四层次为各相关业务部门和职能部门，负责一线风险管理。

①公司董事会为公募业务风险管理的最高决策机构。

②合规与风险控制委员会。公司公募业务风险管理的决策机构，负责制订公司公募业务风险管理总体目标和政策，审定公司公募业务风险管理的制度、流程与指标，并对公司公募业务重大经营决策进行风险审核，授权相关人员执行。

③合规与法务部和风控与稽核部。公司合规与法务部和风控与稽核部独立于业务执行部门，对公募业务进行风险监控。负责通过投资交易管理系统等对公募业务的投资范围、结构、规模、品种、期限、损益、投资权限、投资操作等事项进行重点实时监控；对公募业务相关合同的签订、变更、终止、以及相关资金账户、证券账户等与客户相关的事项进行事前控制，在出现重大问题时及时向公司领导报送相关专项报告；负责审核公募产品信息披露文件，监测员工证券投资行为，建立和完善风险识别，风险评估及风险预警指标体系；在公司风险管理体系中独立地履行内部监督和管理建议职能，负责对公司内部各项经营活动及其内控的合法性、适当性和有效性进行独立客观的监督和评价；对公司所属的各部门及各分支机构的经济活动的法律法规遵循性、内部控制和风险管理的真实性和财务信息的真实性进行审查监督；负责相关人员的离任审查工作；调查公司内部的违规事件；按规定独立出具稽核报告，报送公司董事会和中国证监会等。

④其他相关职能部门。公司运营部、综合部等部门形成的风险管理支持体系，为公募业务风险监管提供集中清算、财务核算、信息技术、预警信息和人力资源管理支持。

⑤公募投资业务部门承担一线的风险控制职能，执行具体的风险管理制度，公募投资业务部门负责人为风险管理的第一责任人。公募投资业务部门下设相关岗位之间相互配合、相互监督制衡。关键部门和相关岗位之间建立重要业务凭据顺畅传递的渠道，各岗位分别在授权范围内承担各自的职责，将风险控制在最小范围内。

### 3、风险管理内容

风险控制程序由风险评估、风险报告、风险控制措施、风险控制实施、风险控制监控和风险控制完善六个环节组成。

风险评估是制定公募业务风险管理战略及防范措施的重要基础，合规与法务部和风控与稽核部应定期或者不定期地对公募业务风险进行评估。主要包括公募业务风险识别，即对经营活动中存在的内部及外部风险进行辨别；公募业务风险分析，即分析风险来源及其表现形式；公募业务风险测定，即对风险的严重性和发生的可能性以及其影响进行测定。

合规与风险控制委员会、合规与法务部、风控与稽核部以及公募投资业务部门根据风险评估的结果制定风险控制的策略，根据风险的不同类型采取不同的控制措施。

公募业务相关的部门、岗位根据制定的风险控制策略、流程、职责权限实施风险控制措施。

合规与法务部和风控与稽核部对公募业务风险控制各环节的执行情况进行监督和检查。

对于风险控制监控中发现的问题，应及时提出改进措施，完善内部控制机制，不断提高风险控制能力。

## 六、管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的目标

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

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，实现公司资产管理业务的持续、稳定、健康发展。

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

(4) 确保公司业务记录、财务信息和其它信息真实、准确、完整、及时。

(5) 保证公司内部规章制度的贯彻执行，提高公司经营效益。

(6) 提高业务开展运作效率，降低操作风险和因内控失当造成对公司的经济和声誉损失。

### 2、内部控制的原则

管理人内部控制遵循以下原则：

(1) 健全性原则。内部控制机制应当做到事前、事中、事后控制相统一；覆盖公司各个部门和各级岗位，渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

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

(3) 独立性原则。公司各部门和岗位职责应当保持相对独立，公司设立合规与法务部以及风控与稽核部承担内部控制监督检查职能，对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。

(4) 相互制约原则。公司各部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡；前台业务运作与后台管理支持严格分离。

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

### 3、内部控制体系

管理人内部控制体系的主体包括董事会及合规与风险控制委员会、经营管理层、风控与稽核部、各业务部门。

公司应建立贯穿于整个公司相互制衡、权责统一、监管明确的内部控制防线：

(1) 建立以一线岗位自律与互控为基础的第一道监控防线。明确各一线岗位的职责，各岗位人员在其职责范围内承担责任；

(2) 建立以风控与稽核部对各部门、各岗位、各项业务实施全面监督为内容的第二道监控防线。风控与稽核部独立于其他部门，负责对各业务部门实施执行内部监察稽核，对各部门内部控制情况进行检查，并将公司整个风险控制情况以定期或不定期的形式向首席风险官、合规与风险控制委员会报告；

(3) 建立以合规与风险控制委员会为主体的第三道防线。合规与风险控制委员会负责协助公司管理层实施对公司风险的总体控制，解决公司内部控制中出现的问题，对各部门的内控工作流程予以监督、指导。

### 4、管理人关于内部合规控制声明书

(1) 管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

(2) 管理人承诺根据市场的变化和管理人的发展不断完善内部合规控制。

## 第四部分 托管人

### 一、托管人基本情况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：高迎欣

成立时间：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字 [2004] 101 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：43,782,418,502 元人民币

存续期间：1996 年 02 月 07 日至长期

电话：010-58560666

联系人：罗菲菲

中国民生银行成立于 1996 年，是中国第一家主要由民营企业发起设立的全国性股份制商业银行，也是严格按照中国《公司法》和《商业银行法》设立的一家现代金融企业。

2000 年 12 月 19 日，中国民生银行 A 股股票（代码：600016）在上海证券交易所挂牌上市。2005 年 10 月 26 日，中国民生银行完成股权分置改革，成为国内首家实施股权分置改革的商业银行。2009 年 11 月 26 日，中国民生银行 H 股股票（代码：01988）在香港证券交易所挂牌上市。上市以来，中国民生银行不断完善公司治理，大力推进改革转型，持续创新商业模式和产品服务，致力于成为一家“让人信赖、受人尊敬”的上市公司。

### 二、主要人员情况

崔岩女士，中国民生银行资产托管部负责人，博士研究生，具有基金托管人高级管理人员任职资格，从事过全球托管业务、托管业务运作、银行信息管理等工作，具有多年金融从业经历，具备扎实的总部管理经验。曾任中国工商银行总行资产托管部营销专家。

### 三、基金托管业务经营情况

中国民生银行股份有限公司于 2004 年 7 月 9 日获得基金托管资格，成为《中华人民共和国证券投资基金法》颁布后首家获批从事基金托管业务的银行。为了更好地发挥后发优势，大力发展托管业务，中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立伊始就本着充分保护基金持有人的利益、为客户提供高品质托管服务的原则，高起点地建立系统、完善制度、组织人员。资产托管部目前共有员工 82 人，平均年龄 38 岁，100% 员工拥有大学本科以上学历，65% 以上员工具有硕士以上学位。

中国民生银行坚持以客户需求为导向，秉承“诚信、严谨、高效、务实”的经营理念，依托丰富的资产托管经验、专业的托管业务服务和先进的托管业务平台，为境内外客户提供安全、准确、及时、高效的专业托管服务。中国民生银行资产托管部于 2018 年 2 月 6 日发布了“爱托管”品牌，近百余家资管机构及合作客户的代表受邀参加了启动仪式。资产托管部始终坚持以客户为中心，致力于为客户提供全面的综合金融服务。对内大力整合行内资源，对外广泛搭建客户服务平台，向各类托管客户提供专业化、增值化的托管综合金融服务，得到各界的充分认可，也在市场上树立了良好品牌形象，成为市场上一家有特色的托管银行。自 2010 年至今，中国民生银行荣获《金融理财》杂志颁发的“最具潜力托管银行”、“最佳创新托管银行”、“金牌创新力托管银行”奖和“年度金牌托管银行”奖，荣获《21 世纪经济报道》颁发的“最佳金融服务托管银行”奖，尤其继 2019 年被《金融时报》评为年度唯一“最佳资产托管银行”之后，在 2020 年度再次被评为唯一“最具资产托管创新力银行”。

截至 2022 年 6 月 30 日，中国民生银行托管建信稳定得利债券型证券投资基金、中银新趋势灵活配置混合型证券投资基金、长信利盈灵活配置混合型证券投资基金等共 345 只证券投资基金，基金托管规模 12015.54 亿元。

#### 四、托管人的职责

- 1、以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；
- 2、设立专门的托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉托管业务的专职人员，负责集合计划财产托管事宜；
- 3、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保集合计划财产的安全，保证其托管的集合计划财产与托管人自有财产以及不同的集合计划财产相互独立；对所托管的不同的集合计划分别设置账户，独立



核算，分账管理，保证不同集合计划之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

5、保管由管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；

6、按规定开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《资产管理合同》的约定，根据管理人的投资指令或登记结算机构业务规则，及时办理清算、交割事宜；

7、保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

9、办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

11、保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；

12、建立并保存集合计划份额持有人名册；

13、按规定制作相关账册并与管理人核对；

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

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

16、按照法律法规和《资产管理合同》、托管协议的规定监督管理人的投资

运作；

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

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

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

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

21、执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

22、法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## 五、托管人的内部控制制度

### 1、内部风险控制目标

(1) 建立完整、严密、高效的风险控制体系，形成科学的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，保障资产托管业务的稳健运行和托管财产的安全完整。

(2) 大力培育合规文化，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念，严格控制合规风险，保证资产托管业务符合国家有关法律法规和行业监管规则。

(3) 以相互制衡健全有效的风控组织结构为保障，以完善健全的制度为基础，以落实到位的过程控制为着眼点，以先进的信息技术手段为依托，建立全面、系统、动态、主动、有利于差错防弊、堵塞漏洞、消除隐患、保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时。

### 2、内部风险控制组织结构

总行高级管理层负责部署全行的风险管理工作。总行风险管理委员会是总行高级管理层下设的风险管理专业委员会，对高级管理层负责，支持高级管理层履行职责。资产托管业务风险控制工作在总行风险管理委员会的统一部署和指导下开展。

总行各部门紧密配合，共同把控资产托管业务运行中的风险，具体职责与分工如下：总行风险管理部作为总行风险管理委员会秘书机构，是全行风险管理的统筹部门，对资产托管部的风险控制工作进行指导；总行法律合规部负责资产托管业务项下的相关合同、协议等法律性文件的审定，对业务开展进行合规检查并督导问题整改落实；总行审计部对全行托管业务进行内部审计，包括定期内部审计、现场和非现场检查等；总行办公室与资产托管部共同制定声誉风险应急预案。

### 3、内部风险控制原则

(1) 合法合规原则。风险控制应符合和体现国家法律、法规、规章和各项政策。

(2) 全面性原则。风险控制覆盖托管部的各个业务中心、各个岗位和各级人员，并涵盖资产托管业务各环节。

(3) 有效性原则。资产托管业务从业人员应全力维护内部控制制度的有效执行，任何人都没有超越制度约束的权力。

(4) 预防性原则。必须树立“预防为主”的管理理念，控制资产托管业务中风险发生的源头，防患于未然，尽量避免业务操作中各种问题的产生。

(5) 及时性原则。资产托管业务风险控制制度的制定应当具有前瞻性，并且随着托管部经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变进行及时的修改或完善。发现问题，要及时处理，堵塞漏洞。

(6) 独立性原则。各业务中心、各岗位职能上保持相对独立性。风险合规管理中心是资产托管部下设的执行机构，不受其他业务中心和个人干涉。业务操作人员和检查人员严格分开，以保证风险控制机构的工作不受干扰。

(7) 相互制约原则。各业务中心、各岗位权责明确，相互牵制，通过切实可行的相互制衡措施来消除风险控制的盲点。

(8) 防火墙原则。托管银行自身财务与托管资产财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门隔离。

### 4、内部风险控制制度和措施

(1) 制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手

册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2) 建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3) 风险识别与评估：定期组织进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4) 相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

(5) 人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6) 应急预案：制定完备的应急预案，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

#### 5、资产托管部内部控制

中国民生银行股份有限公司从控制环境、风险评估、控制活动、信息沟通、监控等五个方面构建了托管业务风险控制体系。

(1) 坚持风险管理与业务发展同等重要的理念。中国民生银行股份有限公司资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题新情况不断出现，我们始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

(2) 实施全员风险管理。将风险控制责任落实到具体业务中心和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(3) 建立分工明确、相互牵制的风险控制组织结构。我们通过建立纵向双人制，横向多中心制的内部组织结构，形成不同中心、不同岗位相互制衡的组织结构。

(4) 以制度建设作为风险管理的核心。我们十分重视内部控制制度的建设，已经建立了一整套内部风险控制制度，包括业务管理办法、内部控制制度、员工行为规范、岗位职责及涵括所有后台运作环节的操作手册。以上制度随着外部环境和业务的发展还会不断增加和完善。

(5) 制度的执行和监督是风险控制的关键。制度落实检查是风险控制管理的有力保证。资产托管部内部设置风险合规管理中心，依照有关法律规章，定

期对业务的运行进行检查。总行审计部不定期对托管业务进行审计。

(6) 将先进的技术手段运用于风险控制中。托管业务系统需求不仅从业务方面而且从风险控制方面都要经过多方论证，托管业务技术系统具有较强的自动风险控制功能。

#### 六、托管人对管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

根据《基金法》、资产管理合同、托管协议和有关法律法规的规定，托管人对集合计划的投资范围和投资对象、集合计划投资比例、集合计划资产的核算、集合计划资产净值的计算、管理人报酬的计提和支付、托管人报酬的计提和支付、集合计划申购及赎回的价格、集合计划申购资金的到账和赎回资金的划付、集合计划收益分配等进行监督和核查。

托管人发现管理人违反《基金法》、资产管理合同、托管协议或有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对确认，并以书面形式对托管人发出回函。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。

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

## 第五部分 相关服务机构

### 一、集合计划销售机构

#### 1、直销机构

本集合计划直销机构为管理人直销柜台以及网上交易平台。

##### (1) 直销柜台

名称：上海海通证券资产管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

法定代表人：裴长江

总经理：李井伟

成立日期：2012 年 6 月 26 日

实缴注册资本：22 亿元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：海通证券股份有限公司持股 100%

电话：021-23219000

##### (2) 网上交易平台

投资者可以通过管理人网上交易平台办理集合计划的申购、赎回、定期投资等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录管理人网站查询。管理人网址：<http://www.htsamc.com>。

#### 2、其他销售机构

##### (1) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客服电话：95553

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

管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本集合计划，管理人增减或变更本集合计划的销售机构时，将按照《信息披露办法》进行公示。

## 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

法定代表人：周明

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：丁媛

经办律师：黎明、丁媛

## 四、审计集合计划资产的会计师事务所

立信会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市南京东路 61 号四楼

办公地址：上海市南京东路 61 号四楼

电话：021-23280000

执行事务合伙人：朱建弟、杨志国

经办注册会计师：黄晔、尹雄

联系人：迟媛

## 第六部分 集合计划的历史沿革

海通策略优选混合型集合资产管理计划变更自原大集合“海通半年升集合资产管理计划”（以下简称“原集合计划”）。

原集合计划为限定性集合资产管理计划，自 2013 年 5 月 20 日起向社会公众发行，2013 年 5 月 23 日结束募集并于 2013 年 5 月 29 日成立。2013 年 6 月 5 日获得中国证券业协会（中证协函【2013】581 号）《关于上海海通证券资产管理有限公司发起设立海通半年升集合资产管理计划的备案确认函》。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告[2018]39 号）的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》自管理人公告的生效之日起生效，原《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。



## 第七部分 集合计划的存续

《资产管理合同》生效后，本集合计划登记机构将进行本集合计划份额的更名以及必要信息的变更。

《资产管理合同》生效后，连续 20 个工作日出现集合计划份额持有人数量不满 200 人或者集合计划资产净值低于 5000 万元情形的，管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止资产管理合同等，并在 6 个月内召集集合计划份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第八部分 集合计划份额的申购与赎回

### 一、申购与赎回办理的场所

本集合计划的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由管理人在招募说明书第五部分或其网站中列明。管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在管理人网站公示。集合计划投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的申购与赎回。

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

### 二、申购与赎回办理的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理集合计划份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，若本集合计划参与港股通且该工作日为非港股通交易日时，则管理人可根据实际情况决定本集合计划是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准。但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或资产管理合同的约定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在届时相关公告中载明。

资产管理合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

管理人自资产管理合同生效之日起不超过3个月开始办理A类份额、C类份额的申购业务，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

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类份额、C类份额的赎回业务，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

投资者依据原《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通半

年升集合资产管理计划份额，自资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合计划 A 类份额。

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

管理人不得在资产管理合同约定之外的日期或者时间办理集合计划份额的申购、赎回或者转换。投资人在资产管理合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其集合计划份额申购、赎回价格为下一开放日该类集合计划份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照持有集合计划份额登记日期的先后次序进行顺序赎回，集合计划份额持有人持有原海通半年升集合资产管理计划份额的期限连续计算；

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

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

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

集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎

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

### 3、申购和赎回申请的确认

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

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

### 五、申购与赎回的数额限制

1、其他销售机构(网点)每个集合计划基金账户单笔申购最低金额为 10 元人民币(含申购费)，其他销售机构另有规定的，从其规定；管理人直销柜台每个集合计划基金账户首次最低申购金额、单笔申购最低金额均为 10 元人民币(含申购费)；通过管理人网上交易平台申购本集合计划时，最低申购金额、定投最低金额均为 10 元人民币(含申购费)。

2、集合计划份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 1 份集合计划份额。集合计划份额持有人赎回时或赎回后在销售机构(网点)保留的集合计划份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见更新的招募说明书。

4、管理人可以规定投资人每个集合计划交易账户的最低集合计划份额余额，具体规定请参见更新的招募说明书。

5、管理人可以规定单个投资人累计持有的集合计划份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书，但本集合计划单一投资者持有集合计划份额数不得达到或超过集合计划份额总数的 50%（运作过程中，因集合计划份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外）。

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

7、管理人可以规定本集合计划的总规模上限、当日申购金额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

8、管理人可以规定单个投资人当日申购金额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

9、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。管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购费率与赎回费率

### 1、申购费率

本集合计划 A 类份额在申购时收取申购费用，C 类份额不收取申购费用。本集合计划 A 类份额的申购费率按申购金额进行分档。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

(1) 本集合计划 A 类份额的申购费率如下表所示：

单笔申购金额（M，含申购费）	申购费率
M < 100 万元	1.5%
100 万元 ≤ M < 300 万元	0.6%
M ≥ 300 万元	0

申购费用由 A 类集合计划份额的投资人承担，不列入集合计划资产，申购

费用用于本集合计划的市场推广、注册登记和销售。

(2) 本集合计划 C 类份额不收取申购费。

## 2、赎回费率

本集合计划的赎回费率按持有期限递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回，适用费率按单笔分别计算。

本集合计划 A 类份额赎回费率如下表所示：

持有期限 (T)	赎回费率
T < 7 日	1.5%
7 日 ≤ T < 30 日	0.75%
30 日 ≤ T < 180 日	0.5%
T ≥ 180 日	0

本集合计划 C 类份额赎回费率如下表所示：

持有期限 (T)	赎回费率
T < 7 日	1.5%
7 日 ≤ T < 30 日	0.5%
T ≥ 30 日	0

本集合计划的赎回费用由赎回集合计划份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。

本集合计划对持续持有期少于 30 日的投资者收取的赎回费，将全额计入集合计划财产；对持续持有期长于或等于 30 日但少于 3 个月（即 90 日）的投资者收取的赎回费，将赎回费总额的 75% 计入集合计划财产；对持续持有期长于或等于 3 个月（即 90 日）但少于 6 个月（即 180 日）的投资者收取的赎回费，将赎回费总额的 50% 计入集合计划财产；对持续持有期长于或等于 6 个月（即 180 日）的投资者，将赎回费总额的 25% 归入集合计划财产。未归入集合计划财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

**注：**原海通半年升集合资产管理计划份额在资产管理合同生效后变更为 A 类份额的，其持有期限从登记机构确认投资人持有原海通半年升集合资产管理计划份额之日起连续计算。

3、管理人可以在资产管理合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟

应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

4、管理人可以在不违背法律法规规定及资产管理合同约定且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下根据市场情况制定集合计划促销计划，针对集合计划投资者定期和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，管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对集合计划投资者适当调低集合计划申购费率、赎回费率和转换费率。

#### 七、申购份数与赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额的计算

申购的有效份额为净申购金额除以当日的对应类别集合计划份额净值，有效份额单位为份。

(1) 申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方式如下：

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

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

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{申购当日对应类别集合计划份额净值}$$

(2) 申购费用适用固定金额时，申购份额的计算方法如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / T \text{ 日对应类别集合计划份额净值}$$

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

例：某投资人投资 10,000.00 元申购本集合计划 A 类份额，对应费率为 1.5%，假设申购当日该类集合计划份额净值为 1.1280 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000.00 / (1 + 1.5\%) = 9,852.22 \text{ 元}$$

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

$$\text{申购份额} = 9,852.22 / 1.1280 = 8,734.24 \text{ 份}$$

投资人投资 10,000.00 元申购本集合计划 A 类份额，假设申购当日该类集合计划份额净值为 1.1280 元，则可得到 8,734.24 份 A 类份额。

##### 2、赎回净额的计算

集合计划份额持有人在赎回本集合计划时缴纳赎回费，集合计划份额持有人的赎回净额为赎回金额扣减赎回费用。其中：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日对应类别集合计划份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额－赎回费用

赎回费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位；赎回净额结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

例：某投资人赎回 10,000 份 A 类份额，持有期限为 30 日，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类集合计划份额净值为 1.2500 元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回总金额=10,000×1.2500=12,500.00 元

赎回费用=12,500.00×0.5%=62.50 元

净赎回金额=12,500.00-62.50=12,437.50 元

即投资人赎回 10,000 份 A 类份额，持有期限为 30 日，对应的赎回费率为 0.5%，假设赎回当日 A 类份额净值为 1.2500 元，则可得到赎回金额 12,437.50 元。

例：某投资人赎回 10,000 份 C 类份额，持有期限为 365 日，对应的赎回费率为 0，假设赎回当日 C 类集合计划份额净值为 1.2500 元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回费用=0 元

赎回金额=10,000×1.2500-0=12,500.00 元

即投资人赎回 10,000 份 C 类份额，持有期限为 365 日，假设赎回当日 C 类份额净值为 1.2500 元，则可得到赎回金额 12,500.00 元。

### 3、集合计划份额净值计算

本集合计划 A 类份额和 C 类份额分别设置代码，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。

T 日某类集合计划份额净值=T 日该类集合计划资产净值/T 日发行在外的该类集合计划份额总数。集合计划份额净值单位为人民币元，计算结果均保留到



小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

T 日的各类集合计划份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

4、当本集合计划发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定，具体见管理人届时的相关公告。

#### 八、申购与赎回的注册登记

1、投资人申购本集合计划成功后，集合计划注册登记人在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分集合计划份额。

2、投资人赎回集合计划成功后，集合计划注册登记人在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

3、管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 九、巨额赎回的认定及处理方式

##### 1、巨额赎回的认定

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

##### 2、巨额赎回的处理方式

当集合计划出现巨额赎回时，管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

（1）全额赎回：当管理人认为有能力支付集合计划份额持有人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当管理人认为支付集合计划份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付集合计划份额持有人的赎回申请而进行的财产变现可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日集合计划总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日

的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，集合计划份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，集合计划份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 若本集合计划发生巨额赎回，在出现单个集合计划份额持有人超过上一开放日集合计划总份额 20% 的赎回申请（以下简称“大额赎回申请人”）情形下，管理人可以延期办理。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 10% 的前提下，优先确认其他赎回申请人（以下简称“小额赎回申请人”）的赎回申请：若小额赎回申请人的赎回申请在当日予以全部确认，则管理人在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；若小额赎回申请人的赎回申请在当日无法被全部确认，则管理人在可接受赎回申请的范围内对小额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的赎回申请适用本条规定的延期赎回或取消赎回的规则，选择延期赎回的，当日未获处理的赎回申请将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止。延期的赎回申请与下一个开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推。同时，管理人应当对延期办理的事宜在规定媒介上进行公告。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，管理人应当通过邮寄、传真或者管理人网站等方式在 3 个工作日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，

并在 2 日内在规定媒介上刊登公告。

#### 十、拒绝或暂停申购、暂停赎回的情形及处理

##### 1、发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

(1) 因不可抗力导致集合计划无法正常运转。

(2) 发生资产管理合同约定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的申购申请。

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

(4) 接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有集合计划份额持有人利益时。

(5) 集合计划资产规模过大，使管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对集合计划业绩产生负面影响，或发生其他损害现有集合计划份额持有人利益的情形。

(6) 当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停接受集合计划申购申请。

(7) 管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有集合计划份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。

(8) 港股通交易每日额度不足。

(9) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

##### 2、发生下列情形时，管理人可暂停接受集合计划份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

(1) 因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

(2) 发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受集合计划份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

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

(4) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

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

(7) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

### 3、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

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

(4) 如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，集合计划重新开放申购或赎回时，管理人应提前 2 日在

规定媒介上连续刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的各类集合计划份额净值。

#### 十一、集合计划转换

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

#### 十二、集合计划的非交易过户

集合计划的非交易过户是指登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本集合计划份额的投资人。

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

#### 十三、集合计划的转托管

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

#### 十四、定期定额投资计划

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

#### 十五、集合计划的冻结和解冻

登记机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。集合计划基金账

户或集合计划份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付，法律法规另有规定的除外。

#### 十六、集合计划份额的转让

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

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

#### 十七、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回

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

## 第九部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

本集合计划通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现集合计划资产的增值。

### 二、投资范围

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本集合计划根据法律法规的规定参与融资业务。在法律法规允许的情况下并履行适当程序后，本集合计划可以参与融券业务。

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。

本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于股票资产（含存托凭证）的比例占集合计划资产的60%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或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、应收申购款等。

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

### 三、投资策略

本集合计划在投资中将以集合计划的权益类资产和固定收益类资产配置作为基础，采用量化选股模型，并将对集合计划整体的波动和风险进行控制，力求集合计划资产长期、稳定的增值。投资策略主要包括但不限于以下方面：

## 1、大类资产配置策略

通过定量分析和定性分析相结合的方法，综合分析宏观经济周期、货币供应量、市场估值水平、政策面导向、市场氛围等多种因素以及证券市场的演化趋势，评估股票、债券等各类资产整体的预期收益和风险，在投资比例限制范围内，确定或调整投资组合中股票、债券等各类资产的比例。

在实际执行上，本集合计划将依据上述宏观经济因子在集合计划投资模型中所产生的投资信号，实施即时性的动态资产配置调整，通过持仓比例的实时调整，有效增强集合计划收益，并降低组合系统性风险。

## 2、股票投资策略

运用量化选股模型，力求寻找基本面良好，并能带来长期稳定超额收益的股票投资组合。另一方面，本集合计划也将对集合计划整体的波动和风险进行控制，力求在风险可控的情况下追求集合计划资产长期、稳定的增值。主要包括但不限于以下投资策略：

### （1）多因子选股策略

本集合计划基于长期量化研究构建投资模型，坚持数据驱动，挖掘市场中的潜在逻辑，通过优化量化投资模型来规避情绪带来的负面影响，力图获得超越业绩基准的投资回报。

本集合计划基于实证检验，选取出符合 A 股投资逻辑的因子，并根据对经济周期和资本市场发展的不同阶段的分析和判断动态调整因子权重，从而构建多因子选股体系。

策略组合构建方法：

#### 1) 筛选有效因子

基于对国内外证券市场运行特征的长期跟踪研究以及大量历史数据的实证检验，选取出符合 A 股投资逻辑的因子。因子库主要包括成长类因子、估值类因子、财务质量类因子、流动性因子、市场预期类因子等。

其中成长因子包括但不限于主营收入增长率、净利润增长率、净资产增长率、一致预期净利润增长率、PEG 等；估值因子包括但不限于市盈率、市净率、市现率、市销率等；质量因子包括但不限于总资产收益率、净资产收益率、销售毛利率、营业总收入、每股收益、资产负债率、总资产周转率等；市场因子



包括但不限于成交量、换手率、流通市值等。

投研团队将定期或不定期地对多因子选股体系进行复核与检验，适时剔除失效因子、酌情纳入重新发挥作用的有效因子或者由市场上新出现的投资逻辑归纳而来的有效因子，通过不断改善多因子选股体系的有效性与稳定性，使得产品能够持续的完成投资目标。

## 2) 动态优化因子权重

作为在投资决策时的可观测指标，不同因子从不同的侧面反映了投资标的真实运行状态。同一时点多个因子（及其近期值）所形成的向量，是影响这只股票市场表现的重要因素，这些因素的综合影响方式可能非常复杂，但是随着时间的推移也许有迹可循。数量模式的一个工作重点就在于动态追查这些痕迹，并从过往的轨迹中总结出有可能带来收益的量化投资模式并固定下来，从而有效避免主观情绪可能带来的负面影响，严格执行投资逻辑。整个过程具体来讲就是，通过历史数据建立因子矩阵和权重矩阵，并根据最新数据不断进行修正。

## 3) 生成股票组合并优化股票权重

在因子权重确定后，多因子选股体系对全市场股票进行综合评分，根据最新数据筛选出备选股票组合，同时综合风险收益目标、风险敞口约束和换仓成本优化备选组合内的个股权重。

在实际运行过程中，管理人将紧密追踪组合和市场的互动表现，及时对多因子选股体系定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。为控制组合风险，在个股偏离度和行业偏离度上也会设置阈值。

## (2) 事件驱动策略

事件驱动策略是指在提前挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的事件基础上，分析出重大事件与股价波动间的历史规律，通过充分把握事件机会获取超额投资回报的交易策略。事件驱动因素被认为是影响股价变化的主要因素之一，决定了价格向价值回归的速度和力度，如指数成份股调整事件、定向增发事件、业绩预增、股东增持以及股票回购事件等。

本集合计划将尽力发掘和深入分析可能为个股带来超额收益的事件，对本集合计划事件驱动模型中所采用的事件进行优选，充分把握事件驱动策略为股

票投资带来的投资机会。

### （3）股票投资组合的风险控制

在风险控制方面，本集合计划将通过组合优化模型实现对相对风险和相对回撤的有效控制。相关性较低的多策略相结合也可有效降低组合风险，动态优化组合收益，有利于集合计划资产的长期稳定增值。

### （4）港股通标的股票投资策略

在港股投资方面，本集合计划将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场。在密切关注港股市场整体政策与形势的前提下，运用多因子选股模型等技术手段，并特别关注与A股相关性较弱效果较好的因子模型，挑选适合作为投资标的个股进行投资。

### （5）存托凭证投资策略

本集合计划将根据本集合计划的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

## 3、债券投资策略

债券投资采取稳健的投资管理模式，以期获得与风险相匹配的投资收益，以在一定程度上规避股票市场的系统性风险，并保证集合计划资产的流动性。通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向，综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素，构造债券投资组合，运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种常用债券投资策略，在获取较高利息收入的同时兼顾资本利得。

## 4、股指期货投资策略

本集合计划将以股指期货为主要的金融衍生工具，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，辅助资产配置策略。当量化模型出现买卖讯号时，进行一篮子股票的买卖可能会存在时效性较差的情况。此时可利用股指期货灵活快速进出的优势，有效降低交易成本，并达到量化模型的有效性，为实际的投资操作提供更多选择。

## 5、股票期权投资策略

本集合计划投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好的期权合约进行投资。本集合计划将结合投资目标、比例限制、

风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与期权交易的投资时机和投资比例。

#### 6、资产支持证券投资策略

本集合计划投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### 7、融资业务投资策略

本集合计划将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。

#### 四、业绩比较基准

中证 800 指数收益率  $\times$  70% + 中证港股通综合指数（人民币）收益率  $\times$  10% + 商业银行活期存款利率（税后） $\times$  20%。

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，其成份股由中证 500 和沪深 300 指数成份股组成，综合反映沪深证券市场大中小市值公司的整体状况，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准；中证港股通综合指数由中证指数有限公司编制，选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，以反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本集合计划的业绩基准的指数，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布时，管理人可以根据本集合计划的投资范围和投资策略与托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，调整或变更本集合计划的业绩比较基准并及时公告。

#### 五、风险收益特征

本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。

本集合计划可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投

资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 六、投资禁止行为与限制

1、为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他集合资产管理计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其管理人、托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交管理人董事会审议。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

## 2、集合计划投资组合比例限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本集合计划投资于股票资产（含存托凭证）的比例占集合计划资产的60%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的0%-50%）；
- (2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (3) 本集合计划持有一家上市公司的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算），其市值不超过集合计划资产净值的10%；
- (4) 管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家公

行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

（5）本集合计划投资于股指期货的投资限制：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%；在任何交易日日终，持有的买入股指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；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%；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%；本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于股票投资比例的有关约定；

（6）本集合计划投资于股票期权的投资限制：因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过集合计划资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过集合计划资产净值的 20%，其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（7）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%；

（8）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%；

（9）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%；

（10）管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

（11）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；

(12) 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；

(13) 本集合计划债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过本集合计划上一日净资产的 40%；本集合计划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；

(14) 管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合资产管理计划持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

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

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

(17) 本集合计划仅在参与融资时遵守下列要求：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，不得超过集合资产管理计划资产净值的 95%；

(18) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(19) 本集合计划投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；

(20) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述第 (2)、(11)、(15)、(16) 项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使本集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门取消上述限制，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。

#### 七、管理人代表集合计划行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于集合计划财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

## 第十部分 集合计划的财产

### 一、集合计划资产总值

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

### 二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

### 三、集合计划财产的账户

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

### 四、集合计划财产的保管和处分

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

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



## 第十一部分 集合计划资产的估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

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

### 三、估值原则

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

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

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

(二)对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（资产管理合同另有规定的除外），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（资产管理合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

(4) 交易所上市交易的可转换债券，以每日收盘价作为估值全价；

(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

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

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

5、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，采用估值技术确定公允价值。

6、股指期货合约，一般以股指期货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。

7、股票期权合约，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、估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：估值当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率的中间价，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

9、本集合计划投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。

10、当本集合计划发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

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

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

如管理人或托管人发现集合计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护集合计划份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布。

## 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。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

管理人每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。

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

## 六、估值错误的处理

管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当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。

资产管理合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数

据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

## 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) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

七、暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4、中国证监会和资产管理合同认定的其它情形。

八、集合计划净值的确认

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

九、特殊情形的处理

1、管理人、托管人按估值方法的第 11 项进行估值时，所造成的误差不作为计划份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

管理人与托管人按监管机构或行业协会有关规定实施侧袋机制。

## 第十二部分 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收益分配条件的前提下，具体分红方案见管理人根据集合计划运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《资产管理合同》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该类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；因红利再投资转换的份额类别，与集合计划份额持有人在收益分配基准日持有的份额同属一个类别；如集合计划份额持有人持有多个类别份额的，则根据不同类别收益分配方案分别计算该类别红利再投资份额；

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

4、由于本集合计划A类份额不收取销售服务费，C类份额收取销售服务费，各类别集合计划份额对应的可分配收益将有所不同，本集合计划同一份额类别的每一份集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

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



#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

#### 六、集合计划收益分配中发生的费用

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

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

## 第十三部分 集合计划的费用与税收

### 一、集合计划费用的种类

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

本集合计划终止清算时所发生费用，按实际支出额从集合计划财产总值中扣除。

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的1%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

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，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初第3个工作日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。集合计划终止后，依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。

## 2、托管人的托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初第 3 个工作日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。集合计划终止后，依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。

## 3、销售服务费

本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.4%。

C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.4% 年费率计提，计算方法如下：

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

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初第 3 个工作日按照指定的账户路径从计划资产划出，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。销售服务费由管理人代收，管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及管理人的集合计划行销广告费、促销活动费、集合计划份额持有人服务等。

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

中支付。

### 三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

1、管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划财产的损失；

2、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；

3、《资产管理合同》生效前的相关费用，按当时有效的《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》的约定支付；

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、实施侧袋机制期间的集合计划费用

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

### 五、集合计划税收

本集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。集合计划财产投资的相关税收，由集合计划份额持有人承担，管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 第十四部分 集合计划份额的折算

### 一、集合计划份额折算基准日

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

### 二、集合计划份额折算对象

份额折算基准日登记在册的本集合计划份额。

### 三、份额折算频率

不定期。

### 四、集合计划份额折算方式

管理人对本集合计划份额的折算方式，具体见管理人届时发布的相关公告。

### 五、集合计划份额折算期间的集合计划业务办理

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

### 六、份额折算的公告

管理人应按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告，并报中国证监会备案。

## 第十五部分 集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

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

### 二、集合计划的年度审计

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

## 第十六部分 集合计划的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

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

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

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的集合计划信息

公开披露的集合计划信息包括：

（一）集合计划招募说明书、《资产管理合同》、集合计划托管协议、产品资料概要

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

2、集合计划招募说明书应当最大限度地披露影响集合计划投资者决策的全部事项，说明集合计划申购和赎回安排、集合计划投资、集合计划产品特性、风险揭示、信息披露及集合计划份额持有人服务等内容。《资产管理合同》生效后，招募说明书的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在规定网站上；招募说明书其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新招募说明书。

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

4、产品资料概要是招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的集合计划概要信息。《资产管理合同》生效后，产品资料概要的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新产品资料概要，并登载在规定网站及集合计划销售机构网站或营业网点；产品资料概要其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新产品资料概要。

《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》变更为《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》的申请经中国证监会批准后，管理人应将集合计划招募说明书提示性公告、《资产管理合同》提示性公告登载在规定报刊上，将集合计划招募说明书、产品资料概要、《资产管理合同》和集合计划托管协议登载在规定网站上，并将产品资料概要登载在集合计划销售机构网站或营业网点；托管人应当同时将《资产管理合同》、集合计划托管协议登载在网站上。

（二）《资产管理合同》生效公告

管理人应当在规定媒介上登载《资产管理合同》生效公告。

（三）集合计划净值信息



《资产管理合同》生效后，在开始办理集合计划份额申购或者赎回前，管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

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

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

#### （四）集合计划份额申购、赎回价格

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

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

管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成集合计划年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成集合计划中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。

管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成集合计划季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

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

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

## （六）临时报告

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

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

- 1、集合计划份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《资产管理合同》终止、集合计划清算；
- 3、转换集合计划运作方式、集合计划合并；
- 4、更换管理人、托管人、集合计划份额登记机构，集合计划改聘会计师事务所；
- 5、管理人委托服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；
- 6、管理人、托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、管理人变更持有百分之五以上股权的股东、管理人的实际控制人变更；
- 8、管理人的高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门托管部门负责人发生变动；
- 9、管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，管理人、托管人专门托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 10、涉及集合计划财产、集合计划管理业务、集合计划托管业务的诉讼或仲裁；
- 11、管理人或其高级管理人员、集合计划投资经理因集合计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，托管人或其专门托管部门负责人因托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 12、管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 13、集合计划收益分配事项；
- 14、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

- 15、任一类集合计划份额净值估值错误达该类集合计划份额净值百分之零点五；
- 16、本集合计划开始办理申购、赎回；
- 17、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；
- 18、本集合计划连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 19、本集合计划暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 20、发生涉及集合计划申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 21、管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 22、调整集合计划份额类别设置；
- 23、本集合计划实施集合计划份额折算；
- 24、启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项；
- 25、集合计划信息披露义务人认为可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和资产管理合同约定的其他事项。

#### （七）澄清公告

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

#### （八）集合计划份额持有人大会决议

集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （九）实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### （十）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）等文件中披露本集合计划股指期货交易情况，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集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （十一）投资资产支持证券的信息披露

管理人在集合计划年度报告及中期报告中披露本集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。管理人在集合计划季度报告中披露本集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期末按市值占集合计划净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。

#### （十二）融资业务的信息披露

管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本集合计划参与融资业务的交易情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。

#### （十三）投资股票期权信息披露

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）等文件中披露本集合计划股票期权交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股票期权交易对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （十四）参与港股通交易的信息披露

本集合计划若投资港股通标的股票，管理人应当在年度报告、中期报告和季度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中按届时有效的法律法规或监管机构的要求披露港股通标的股票的投资情况。若中国证监会对集合计划通过港股通机制投资其他股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。

#### （十五）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

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

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

管理人、托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为集合计划信息披露义务人公开披露的集合计划信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到不低于法律法规规定的最低期限。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，管理人、托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。

#### 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，管理人和托管人可暂停或延迟披露集合计划相关信息：

- 1、不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；
- 2、集合计划投资所涉及的证券/期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、发生暂停集合计划估值的情形时；
- 4、法律法规、《资产管理合同》或中国证监会规定的其他情况。

## 第十七部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

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

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

### 二、实施侧袋机制期间集合计划份额的申购与赎回

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

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

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

### 三、实施侧袋机制期间的集合计划投资

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

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

管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

#### 四、实施侧袋机制期间的集合计划估值

本集合计划实施侧袋机制的，管理人和托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的集合计划净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### 五、实施侧袋账户期间的集合计划费用

1、本集合计划实施侧袋机制的，主袋账户的管理费、托管费按主袋账户集合计划资产净值作为基数计提；侧袋账户的托管费根据法律法规按侧袋账户集合计划资产净值为基数计提，法律法规对侧袋账户的计提基数等另有规定的，从其规定。

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

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

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

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

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

#### 七、侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

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

##### 2、集合计划净值信息

管理人应按照招募说明书“集合计划的信息披露”部分规定的集合计划净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的各类集合计划份额净值和各类集合

计划份额累计净值。实施侧袋机制期间本集合计划暂停披露各类侧袋账户份额净值和累计净值。

### 3、定期报告

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



## 第十八部分 风险揭示

### 一、投资本集合计划的风险

集合计划风险即集合计划收益的不确定性，所有可能影响集合计划业绩的因素都属于风险的来源，而风险管理本质上就是在一定约束条件下对预期收益和预期风险的平衡。科学严谨的风险管理对集合计划投资管理绩效至关重要，与投资者利益休戚相关，因此对风险的识别、评估和控制应贯穿集合计划投资的全过程。

本集合计划将通过专业的风险管理与业绩评估系统，通过量化的归因分析和严格的风险预算进行动态风险控制，实现组合风险与收益优化配比。

本集合计划所涉及的风险按来源主要分为系统性风险、非系统性风险、集合计划管理风险、流动性风险和本集合计划特定风险。

#### （一）系统性风险

系统性风险是指因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的风险，主要包括政策风险，经济周期风险，利率风险，购买力风险等因素。

##### 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和法律法规的变化对证券市场产生一定影响，从而导致市场价格波动，影响集合计划收益而产生的风险。

##### 2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，经济运行周期性的变化会对集合计划所投资的证券的基本面产生影响，从而影响证券的价格而产生风险。

##### 3、利率风险

金融市场利率的波动会直接导致股票市场及债券市场的价格和收益率产生变动，同时也影响到证券市场资金供求状况，以及拟投资上市公司的融资成本和利润水平。上述变化将直接影响证券价格和本集合计划的收益。

##### 4、购买力风险

集合计划收益的一部分将通过现金形式来分配，而现金的购买力可能因为

通货膨胀的影响而下降，从而使集合计划的实际投资收益下降。

#### 5、汇率风险

汇率的变动可能会影响集合计划投资标的的价格和集合计划资产的实际购买力。

#### 6、其他风险

因战争、自然灾害等不可抗力产生的风险。

#### （二）非系统性风险

非系统性风险是指个别证券特有的风险，包括企业的信用风险、经营风险、财务风险及债券发行人的信用风险等。拟投资上市公司的经营状况受到多种因素影响，如管理层能力、财务状况、市场前景、行业竞争能力、技术更新、研究开发、人员素质等都会导致上市公司盈利发生变化。如果集合计划所投资的上市公司经营不善，将导致其股票价格下跌或股息、红利减少，从而使集合计划投资收益下降。集合计划可以通过多样化投资来分散这种非系统性风险。

#### （三）集合计划管理风险

集合计划管理风险指管理人在集合计划管理实施过程中产生的风险，主要包括管理风险、交易风险、运营风险及道德风险。

#### 1、管理风险

在集合计划管理运作过程中，由于管理人的知识、经验、判断、决策、技能等主观因素的限制而影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，或者由于集合计划数量模型设计不当或实施差错导致集合计划收益水平偏离业绩基准从而影响集合计划收益水平。对主要业务人员如投资经理的依赖也可能产生管理风险。

#### 2、交易风险

由于交易权限或业务流程设置不当导致交易执行流程不畅通，交易指令的执行产生偏差或错误，或者由于故意或重大过失未能及时准确执行交易指令，事后也未能及时通知相关人员或部门，导致集合计划利益的直接损失。

#### 3、运营风险

由于运营系统、网络系统、计算机或交易软件等发生技术故障或瘫痪等情况而无法完成集合计划的申购、赎回、注册登记、清算交收等指令而产生

的操作风险，或者由于操作过程效率低下或人为疏忽和错误而产生的操作风险。

#### 4、道德风险

是指员工违背职业道德、法规和公司制度，通过内幕信息、利用工作程序中的漏洞或其他不法手段谋取不正当利益所带来的风险。

#### （四）流动性风险

本集合计划的流动性风险主要体现为集合计划申购、赎回等因素对集合计划造成的流动性影响。在集合计划交易过程中，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、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本集合计划的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，同时本集合计划基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本集合计划的流动性风险适中。

##### 2、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

集合计划出现巨额赎回情形下，管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全额赎回或部分延期赎回。同时，如本集合计划单个集合计划份额持有人在单个开放日申请赎回集合计划份额超过集合计划总份额一定比例以上的，管理人有权对其采取延期办理赎回申请或延缓支付赎回款项的措施。

##### 3、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，管理人将严格依照法律法规及资产管理合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向集合计划份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但集合计划启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露集合计划份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有集合计划份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，集合计划份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本集合计划不披露侧袋账户份额的净值，即便管理人在定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，管理人不承担任何保证和承诺的责任。

管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，管理人计算各项投资运作指标和集合计划业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，集合计划业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本集合计划披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

#### （五）本集合计划的特定风险

1、本集合计划若参与港股通标的股票的投资，还需承担汇率风险以及境外市场的风险。

##### （1）汇率风险

本集合计划以人民币募集和计价，但本集合计划通过港股通投资香港证券市场，可投资的港股通标的股票以港币计价。由于人民币汇率在未来存在不确定性，存在因汇率变动而蒙受损失的可能性，因此，投资本集合计划存在一定的汇率风险。

## （2）香港市场的风险

1) 与内地 A 股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，因此，受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险影响更大。

2) 香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

a. 香港市场实行 T+0 回转交易，香港市场证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此每日涨跌幅空间相对较大。

b. 只有内地与香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日。在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险。

c. 香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所（以下简称“联交所”）规定的其他情形时，联交所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行交易的风险；出现境内证券交易服务公司认定的交易异常情况时，境内证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

d. 由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本集合计划在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本集合计划可能面临卖出港股后资金不能及时到账，造成支付赎回款日期比正常情况延后的风险。

3) 本集合计划的港股投资通过港股通进行，面临着港股通制度及其调整的风险：

a. 根据现行的港股通规则，本集合计划因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者其他异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，可以通过港股通卖出，但不得买入；因发行人供股、港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利凭证在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得买入，其行权等事宜按照中国证监会、中国登记

结算有限责任公司的相关规定处理；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，不得通过港股通买入或卖出。

b. 本集合计划将仅通过沪港、深港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。在联交所开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本集合计划将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

c. 现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入；本集合计划可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

## 2、股指期货投资风险

本集合计划投资于股指期货，因此存在因投资股指期货而带来的风险：

- （1） 市场风险：由于标的价格变动而产生的衍生品的价格波动。
- （2） 市场流动性风险：当集合计划交易量大于市场可报价的交易量而产生的风险。
- （3） 结算流动性风险：集合计划保证金不足而无法交易衍生品，或因指数波动导致保证金低于维持保证金而必须追缴保证金的风险。
- （4） 基差风险：期货市场价格与标的价格不一致所产生的风险。
- （5） 信用风险：交易对手不愿或无法履行契约的风险。
- （6） 作业风险：因交易过程、交易系统、人员疏失、或其他不可预期时间所导致的损失。

## 3、股票期权投资风险

本集合计划投资于股票期权，因此存在因投资股票期权而带来的风险：

- （1） 市场风险：由于标的价格变动而产生的衍生品的价格波动。
- （2） 流动性风险：当集合计划交易量大于市场可报价的交易量而产生的风险。
- （3） 保证金风险：由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

(4) 基差风险：指衍生品合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同衍生品合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。

(5) 信用风险：交易对手不愿或无法履行契约的风险。

(6) 操作风险：因交易过程、交易系统、人员疏失、或其他不可预期时间所导致的损失。

#### 4、资产支持证券的投资风险

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

#### 5、融资业务的风险

本集合计划在法律法规允许的前提下可进行融资业务，存在信用风险、投资风险和合规风险等风险。集合计划份额持有人需承担由此带来的风险与成本。具体而言，信用风险是指集合计划在融资业务中，因交易对手方违约无法按期偿付证券相关权益、返还证券，导致集合计划资产损失的风险。投资风险是指集合计划在融资业务中，因投资策略失败、对投资标的预判失误等导致集合计划资产损失的风险。合规风险是指由于违反相关监管法规，从而受到监管部门处罚的风险，主要包括业务超出监管部门规定范围、风险控制指标超过监管部门规定阈值等。

#### 6、存托凭证投资风险

本集合计划的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的集合计划所面临的共同风险外，本集合计划还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能

引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

#### （六）其他风险

主要是由其他不可预见或不可抗力因素导致的风险，如战争、自然灾害等有可能导致集合计划财产损失或影响集合计划收益水平。

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



## 第十九部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算

### 一、《资产管理合同》的变更

1、变更《资产管理合同》涉及法律法规规定或资产管理合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的，应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和资产管理合同约定可不经集合计划份额持有人大会决议通过的事项，由管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

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

### 二、《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

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

### 三、集合计划财产的清算

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

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

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

### 4、集合计划财产清算程序：

(1)《资产管理合同》终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管

集合计划；

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

5、集合计划财产清算的期限为 6 个月，但因本集合计划所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

#### 四、清算费用

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

#### 五、集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、集合计划财产清算的公告

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

#### 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

## 第二十部分 资产管理合同内容摘要

### 一、资产管理合同当事人及权利义务

#### (一) 管理人简况

名称：上海海通证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

法定代表人：裴长江

成立日期：2012 年 6 月 26 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]418 号

组织形式：有限责任公司（非自然人投资或控股的法人独资）

注册资本：22 亿元

存续期限：持续经营

联系电话：021-23219000

#### (二) 管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

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

(2) 依照《资产管理合同》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；

(3) 销售集合计划份额；

(4) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；

(5) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定监督托管人，如认为托管人违反了《资产管理合同》及国家有关法律的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护集合计划投资者的利益；

(6) 在托管人更换时，提名新的托管人；

(7) 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；

(8) 担任或委托其他符合条件的机构担任集合计划登记机构办理集合计划

登记业务并获得《资产管理合同》规定的费用；

(9) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；

(10) 在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(11) 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；

(12) 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；

(13) 以管理人的名义，代表集合计划份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

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

(15) 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；

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

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

(2) 办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受托管人的监督；

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

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

(16) 按规定保存集合计划财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；

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

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

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

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

(21) 监督托管人按法律法规和《资产管理合同》规定履行自己的义务，托

管人违反《资产管理合同》造成集合计划财产损失时，管理人应为集合计划份额持有人利益向托管人追偿；

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

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

(24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

### (三) 托管人简况

名称：中国民生银行股份有限公司（以下简称“中国民生银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：高迎欣

成立时间：1996年2月7日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]101号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：43,782,418,502元人民币

存续期间：1996年02月07日至长期

### (四) 托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

(6) 在管理人更换时，提名新的管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

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

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

(5) 保管由管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；

(6) 按规定开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《资产管理合同》的约定，根据管理人的投资指令或登记结算机构业务规则，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对集合计划财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，

说明管理人在各重要方面的运作是否严格按照《资产管理合同》的规定进行；如果管理人有未执行《资产管理合同》规定的行为，还应当说明托管人是否采取了适当的措施；

(11) 保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；

(12) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《资产管理合同》、托管协议的规定监督管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

(五) 集合计划份额持有人的权利与义务

投资者持有本集合计划份额的行为即视为对《资产管理合同》的承认和接受，投资者自依据《资产管理合同》取得集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《资产管理合同》的当事人，直至其不再持有本集合计划的份额。集合计划



份额持有人作为《资产管理合同》当事人并不以在《资产管理合同》上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份集合计划份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享集合计划财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余集合计划财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的集合计划份额；

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

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

(6) 查阅或者复制公开披露的集合计划信息资料；

(7) 监督管理人的投资运作；

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

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守《资产管理合同》、招募说明书等信息披露文件；

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

(3) 关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳集合计划申购款项及法律法规和《资产管理合同》所规定的费用；

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

(6) 不从事任何有损集合计划及其他《资产管理合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

- (8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## 二、集合计划份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

集合计划份额持有人大会由集合计划份额持有人组成，集合计划份额持有人的合法授权代表有权代表集合计划份额持有人出席会议并表决。集合计划份额持有人持有的每一集合计划份额拥有平等的投票权。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暂不设日常机构。在本集合计划存续期内，根据本集合计划的运作需要，集合计划份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

### (一) 召开事由

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

- (1) 终止《资产管理合同》；
- (2) 更换管理人；
- (3) 更换托管人；
- (4) 转换集合计划运作方式；
- (5) 调整管理人、托管人的报酬标准或提高销售服务费；
- (6) 变更集合计划类别；
- (7) 本集合计划与其他集合计划的合并；
- (8) 变更集合计划投资目标、范围或策略；
- (9) 变更集合计划份额持有人大会程序；
- (10) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本集合计划总份额 10%以上（含 10%）集合计划份额的持有人（以管理人收到提议当日的集合计划份额计算，下同）就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会；
- (12) 对资产管理合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《资产管理合同》或中国证监会规定的其它应当召开集合计划份额持有人大会的事项。

2、在法律法规规定和《资产管理合同》约定的范围内且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由管理人和托管人协商，并按照监管部门要求履行适当程序后修改，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《资产管理合同》规定的范围内调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率、销售服务费或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《资产管理合同》进行修改；

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

(5) 集合计划推出新业务或服务；

(6) 调整本集合计划份额类别的设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整；

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

(8) 按照法律法规和《资产管理合同》规定不需召开集合计划份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、管理人未按规定召集或不能召集时，由托管人召集；

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

4、代表集合计划份额 10%以上（含 10%）的集合计划份额持有人就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会，应当向管理人提出书面提议。管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的集合计划份额持有人代表和托管人。管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日

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

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

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

（三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

3、如召集人为管理人，还应另行书面通知托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为托管人，则应另行书面通知管理人到指定地点对表

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

#### （四）集合计划份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按资产管理合同约定通知托管人（如果托管人为召集人，则为

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

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

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

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

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

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、 议事内容及提案权

议事内容为关系集合计划份额持有人利益的重大事项,如《资产管理合同》

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

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

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

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

### (2) 通讯开会

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

### (六) 表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

（1）如大会由管理人或托管人召集，集合计划份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的集合计划份额持有人和代理人中选举两名集合计划份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由集合计划份额持有人自行召集或大会虽然由管理人或托管人召集，但是管理人或托管人未出席大会的，集合计划份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的集合计划份额持有人中选举三名集合计划份额持有人代表担任监票人。管理人或托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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



## 2、通讯开会

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

### （八）生效与公告

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

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

（九）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，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，管理人经与托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

### （十）实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

5、如果管理人授权代表和托管人授权代表均未能主持大会，现场开会由出席大会的相关集合计划份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名集合计划份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人；

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

7、特别决议应当经参加大会的相关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。

侧袋机制实施期间，集合计划份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的集合计划份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

### 三、合同的变更、终止与集合计划财产的清算

#### （一）《资产管理合同》的变更

1、变更《资产管理合同》涉及法律法规规定或本合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的，应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和资产管理合同约定可不经集合计划份额持有人大会决议通过的事项，由管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

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

#### （二）《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

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

### （三）集合计划财产的清算

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

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

（2）对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对集合计划财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对集合计划剩余财产进行分配。

5、集合计划财产清算的期限为 6 个月，但因本集合计划所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。

### （四）清算费用

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

#### （五）集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）集合计划财产清算的公告

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

#### （七）集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

### 四、争议的处理和适用的法律

发生纠纷时，本合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方均有权将争议提交上海仲裁委员会仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

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

《资产管理合同》受中国法律（为资产管理合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

### 五、资产管理合同存放地和投资人取得合同的方式

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

## 第二十一部分 集合计划托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 管理人

本集合计划的管理人为上海海通证券资产管理有限公司，基本信息如下：

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

法定代表人：裴长江

总经理：李井伟

成立日期：2012 年 6 月 26 日

实缴注册资本：22 亿元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：海通证券股份有限公司持股 100%

联系人：苗童

联系电话：021-23219000

#### (二) 托管人

名称：中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

邮政编码：100031

法定代表人：高迎欣

成立日期：1996 年 2 月 7 日

基金托管业务批准文号：证监基金字 [2004] 101 号

组织形式：其他股份有限公司（上市）

注册资本：43,782,418,502 元人民币

存续期间：1996 年 02 月 07 日至长期

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现、发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外

汇；从事结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；保险兼业代理业务。（市场主体依法自主选择经营项目，开展经营活动；保险兼业代理业务以及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；不得从事国家和本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

## 二、托管人对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资产管理计划合同的约定，对集合计划投资范围、投资对象进行监督。集合资产管理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资产管理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，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本集合计划根据法律法规的规定参与融资业务。在法律法规允许的情况下并履行适当程序后，本集合计划可以参与融券业务，本管理人开展融券投资前，需与本托管人协商确认一致后，方可投资。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于股票资产（含存托凭证）的比例占集合计划资产的60%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或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、应收申购款等。

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

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

(1) 本集合计划投资于股票资产（含存托凭证）的比例占集合计划资产的 60%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%）；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于集合计划资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(3) 本集合计划持有一家上市公司的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），其市值不超过集合计划资产净值的 10%；

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

(5) 本集合计划投资于股指期货的投资限制：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%；在任何交易日日终，持有的买入股指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；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%；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%；本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于股票投资比例的有关约定；

(6) 本集合计划投资于股票期权的投资限制：因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过集合计划资产净值的 10%；开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所

需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；未平仓的期权合约面值不得超过集合计划资产净值的 20%，其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 管理人管理且本托管人托管的全部公开募集性质的集合资产管理计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(11) 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；

(12) 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；

(13) 本集合计划债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过本集合计划上一日净资产的 40%；本集合计划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；

(14) 管理人管理且本托管人托管的全部公开募集性质的开放式集合资产管理计划持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；管理人管理且本托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

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

(16) 本集合计划与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主



体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与资产管理合同约定的投资范围保持一致；

(17) 本集合计划仅在参与融资时遵守下列要求：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，不得超过集合资产管理计划资产净值的 95%；

(18) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(19) 本集合计划投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；

(20) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(11)、(15)、(16)项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使本集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门取消上述限制，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。

(三) 托管人根据有关法律法规的规定及集合资产管理计划合同的约定，对本托管协议第十五条第九款投资禁止行为进行监督。托管人通过事后监督方式对管理人投资禁止行为进行监督。

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交管理人董事会审议。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如果法律法规对资产管理合同约定投资组合比例限制进行变更的，以

变更后的规定为准。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。

（四）托管人根据有关法律法规的规定及集合资产管理计划合同的约定，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，应及时向托管人说明理由，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。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资产管理计划合同的约定，对管理人投资流通受限证券进行监督。

管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确集合计划投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。托管人对管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。首次投资流通受限证券前，管理人应与托管人就流通受限证券投资签订风险控制补充协议。

1. 本集合计划投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原

因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本集合计划不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本集合计划投资的流通受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司、银行间清算所股份有限公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本集合计划投资的流通受限证券应保证登记存管在本集合计划名下，管理人负责相关工作的落实和协调，并确保托管人能够正常查询。因管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题，造成托管人无法安全保管本集合计划资产的责任与损失，及因流通受限证券存管直接影响本集合计划安全性的责任及损失，由管理人承担。

本集合计划投资流通受限证券，不得预付任何形式的保证金。

2. 管理人对本集合计划投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决集合计划运作的流动性问题。如因巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致现金周转困难时，管理人应保证提供足额现金确保集合计划的支付结算。对本集合计划因投资流通受限证券导致的流动性风险，托管人不承担任何责任。如因管理人违反集合资产管理计划合同或预先确定的投资流通受限证券的比例导致本集合计划出现损失致使托管人承担连带赔偿责任的，管理人应赔偿托管人由此遭受的损失。

3. 本集合计划有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，管理人应在两日内编制临时报告书，予以公告。

4. 托管人根据有关规定有权对管理人进行以下事项监督：

- 1) 本集合计划投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。
- 2) 在集合计划投资流通受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。
- 3) 有关比例限制的执行情况。
- 4) 信息披露情况。
5. 相关法律法规对集合计划投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

（六）管理人应当对投资中期票据业务进行研究，认真评估中期票据投资业务的风险，本着审慎、勤勉尽责的原则进行中期票据的投资业务。管理人根据法律、法规、监管部门的规定，制定了经公司董事会批准的集合计划投资中期票据相关制度（以下简称“《制度》”），以规范对中期票据的投资决策流程、风险控制。管理人《制度》的内容与本协议不一致的，以本协议的约定为准。

（七）本集合计划如投资银行存款，托管人根据有关法律法规的规定及集合资产管理计划合同的约定，对集合计划投资银行存款的交易对手范围是否符合有关规定进行监督；管理人在签署银行存款协议前，应将草拟的银行存款协议送托管人审核。

（八）托管人根据有关法律法规的规定及集合资产管理计划合同的约定，对计划资产净值计算、各类集合计划份额净值计算、应收资金到账、费用开支及收入确定、收益分配、相关信息披露、宣传推介材料中登载业绩表现数据等进行监督和核查。

（九）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、集合资产管理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，并及时向中国证监会报告。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。

（十）管理人有义务配合和协助托管人依照法律法规、集合资产管理计划合同和本托管协议对业务执行核查。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、集合资产管理计划合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送监督报告的事项，管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（十一）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，或者违反集合资产管理计划合同约定的，应当立即通知管理人，由此造成的损失由管理人承担，并及时向中国证监会报告。

（十二）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、管理人对托管人的业务核查

（一）管理人对托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括托管人安全保管计划财产、开设计划财产的资金账户、证券账户等投资所需账户、复核管理人计算的计划资产净值、各类集合计划份额净值、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计划财产、未对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》、集合资产管理计划合同、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在下一工作日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、集合计划财产保管

#### （一）计划财产保管的原则

1. 计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。计划财产的债权、

不得与管理人、托管人固有财产的债务相抵销，不同计划财产的债权债务，不得相互抵销。管理人、托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

2. 管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，计划财产不属于其清算财产。

3. 托管人应安全保管计划财产。未经管理人依据合法程序作出的合法合规指令，托管人不得自行运用、处分、分配计划的任何财产。非因计划财产本身承担的债务，不得对计划财产强制执行。

4. 托管人按照规定开设计划财产的资金账户、证券账户等投资需要的账户。

5. 托管人对所托管的不同计划财产分别设置账户，独立核算，分账管理，确保计划财产的完整与独立。

6. 托管人根据管理人的指令，按照集合资产管理计划合同和本协议的约定保管计划财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。

7. 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。由此给计划财产造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿计划财产的损失，托管人对此不承担任何责任。

8. 除依据法律法规和集合资产管理计划合同的规定外，托管人不得委托第三人托管计划财产。

## （二）集合计划的银行账户的开立和管理

1. 托管人应负责本集合计划的银行账户的开设和管理。

2. 托管人应以本集合计划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。账户名称、账户预留印鉴以管理人向托管人出具的开户委托文件为准，托管人负责账户预留印鉴的保管和使用。该账户为不可提现账户。管理人应依法履行受益所有人识别义务，在开立托管账户时按照开户银行要求，就相关信息的提供、核实等提供必要的协助，并确保所提供信息以及证明材料的真实性、准确性。

3. 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。

4. 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。

5. 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计划资产的支付。

### （三）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上海分公司、深圳分公司为本集合计划开立托管人与本集合计划联名的证券账户。

2. 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书面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. 证券账户的开立由托管人负责，账户资产的管理和运用由管理人负责。

4. 托管人以自身法人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、证券结算保证金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许集合计划从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，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。

### （四）债券托管账户的开设和管理

集合资产管理计划合同生效后，托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户，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。

### （五）定期存款账户的开设与管理

集合计划投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟

账户。定期存款账户户名应与托管专户保持一致，该账户预留印鉴经与托管人商议后预留。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，协议内容应至少包含起息日、到期日、存款金额、存款账户、存款利率、存款是否可以提前支取、定存到期支取账户、存款证实书如何交接以及存款证实书不得转让质押等条款。协议须约定托管人经办行名称、地址和账户，并将本集合计划托管专户指定为唯一回款账户，协议中涉及托管人相关职责的约定须由管理人和托管人双方协商一致后签署。

#### （六）其他账户的开立和管理

1. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和集合资产管理计划合同的规定开立，在管理人和托管人商议后由托管人负责开立。新账户按有关规定使用并管理。

2. 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）计划财产投资的有关有价凭证等的保管

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、银行间市场清算所股份有限公司、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、银行存款开户证实书等有价凭证的购买和转让，由管理人和托管人共同办理。托管人对由托管人及托管人委托保管的机构以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任，但托管人应妥善保管凭证。

#### （八）与计划财产有关的重大合同的保管

与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。重大合同的保管期限不低于法律法规规定的最低期限。



### （九）特别约定

本计划属于对原集合计划变更为“海通策略优选混合型集合资产管理计划”的规范，本协议生效后，针对以海通半年升集合资产管理计划的名义已经开立的账户，包括但不限于托管账户、证券账户、银行间账户、集合计划基金账户、存款账户等，管理人与托管人应互相配合，共同完成账户名称及开户资料的变更。

如法律法规或监管机构允许集合计划变更投资范围或投资其他品种，管理人在履行适当程序后，将其纳入本集合计划的投资范围。管理人拟实施《资产管理合同》中未明确列示投资品及其他《资产管理合同》签署后市场新增交易品种的投资的，应于开始实施投资前与托管人就此类新增投资品的会计核算、估值、清算、监督、系统支持等达成一致。

## 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

#### 1. 集合计划资产净值

集合计划资产净值是指计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

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。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

管理人每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。

#### 2. 复核程序

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

3. 根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照管理人对集合计划净值信息的计算结果对外

予以公布。

## （二）计划资产估值方法和特殊情形的处理

### 1、估值对象

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

### 2、估值方法

#### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

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

2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（资产管理合同另有规定的除外），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（资产管理合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

4) 交易所上市交易的可转换债券，以每日收盘价作为估值全价；

5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

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

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

(5) 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值; 选定的第三方估值机构未提供估值价格的, 采用估值技术确定公允价值。

(6) 股指期货合约, 一般以股指期货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。

(7) 股票期权合约, 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) 估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的, 将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准: 估值当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率的中间价, 或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

(9) 本集合计划投资存托凭证的估值核算, 依照境内上市交易的股票

执行。

(10) 当本集合计划发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

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

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

如管理人或托管人发现集合计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护集合计划份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

### 3、特殊情形的处理

管理人、托管人按估值方法的第(11)项进行估值时，所造成的误差不作为计划份额净值错误处理。

由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

#### (三) 集合计划份额净值错误的处理方式

管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当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。

集合资产管理计划合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1、估值错误类型

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

上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。

## 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

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

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(四) 暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4、中国证监会和集合资产管理计划合同认定的其他情形。

(五) 实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

管理人与托管人按监管机构或行业协会有关规定实施侧袋机制。

(六) 会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

(七) 集合计划账册的建立

管理人进行会计核算并编制财务会计报告。管理人、托管人分别独立地设置、记录和保管本集合计划的全套账册。托管人按规定制作相关账册

并与管理人核对。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计划资产净值的计算和公告的，以管理人的账册为准。

#### （八）财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

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两个月日内完成集合计划中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成集合计划年度报告的编制。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

###### 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。

（九）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登记与保管

份额持有人名册至少应包括份额持有人的名称和持有的集合计划份额。份额持有人名册由集合计划登记机构根据管理人的指令编制和保管，保存期自集合计划账户销户之日起不少于20年，管理人和托管人应分别保管份额持有人名册，保存期不低于法律法规规定的最低期限。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在托管人要求或编制中期报告和年报前，管理人应将有关资料送交托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。托管人不得将所保管的份额持有人名册用于集合计划托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

#### 七、争议解决方式

双方当事人同意，因托管协议而产生的或与托管协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交上海仲裁委员会仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。仲裁费用、律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，本托管协议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、尽责地履行集合资产管理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（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

#### 八、托管协议的变更与终止

##### （一）本托管协议的变更程序

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

##### （二）集合计划托管协议终止出现的情形

1. 集合资产管理计划合同终止；
2. 托管人解散、依法被撤销、破产或由其他托管人接管计划资产；
3. 管理人解散、依法被撤销、破产或由其他管理人接管集合计划管理权；
4. 发生法律法规、中国证监会或集合资产管理计划合同规定的终止事项。



## 第二十二部分 对集合计划份额持有人的服务

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

### （一）资料寄送

#### 1、集合计划投资者对账单：

管理人将向发生交易的集合计划份额持有人以书面或电子文件形式定期或不定期寄送对账单。

#### 2、其他相关的信息资料。

### （二）多种收费方式选择

管理人在合适时机将为投资者提供多种收费方式购买本集合计划，满足投资者多样化的投资需求，具体实施办法见有关公告。

### （三）集合计划电子交易服务

管理人为投资者提供集合计划电子交易服务。投资人可登录管理人的网站（[www.htsamc.com](http://www.htsamc.com)）查询详情。

### （四）联系方式

上海海通证券资产管理有限公司咨询电话：021-23219000

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

## 第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在管理人和销售机构的办公场所，投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买本招募说明书的复制件或复印件。投资人按上述方式所获得的文件或其复印件。管理人和托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十四部分 备查文件

(一) 中国证监会批准海通半年升集合资产管理计划资产管理合同变更的文件

(二) 《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》

(三) 《海通策略优选混合型集合资产管理计划托管协议》

(四) 法律意见书

(五) 管理人业务资格批件、营业执照

(六) 托管人业务资格批件、营业执照

(七) 业务规则

(八) 中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在管理人和销售机构的办公场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

上海海通证券资产管理有限公司

二〇二二年九月 日