

华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划  
招募说明书  
(更新)

集合计划管理人：华创证券有限责任公司

集合计划托管人：中信银行股份有限公司

## 重要提示

华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划由华创银杏低风险套利集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)备案。

华创银杏低风险套利集合资产管理计划的集合计划管理人为华创证券有限责任公司，集合计划托管人为中信银行股份有限公司。华创银杏低风险套利集合资产管理计划自 2013 年 5 月 22 日起开始募集，于 2013 年 5 月 28 日结束募集工作，于 2013 年 5 月 31 日正式成立，并于 2013 年 7 月 8 日取得中国证券业协会《关于华创证券有限责任公司发起设立华创银杏低风险套利集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013] 688 号）。

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，华创银杏低风险套利集合资产管理计划参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律法规及中国证监会的规定进行变更，并将原集合计划名称变更为“华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划”，变更后的《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》自集合计划管理人公告的生效之日起生效，原《华创银杏低风险套利集合资产管理合同》同日失效。

集合计划管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。中国证监会对华创银杏低风险套利集合资产管理计划变更为本集合计划的备案，并不表明其对集合计划的投资价值和市场前景作出实质性判断或保证，也不表明投资于集合计划没有风险。

本集合计划投资于证券市场，集合计划净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本集合计划前，需充分了解本集合计划的产品特性，并承担集合计划投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于集合计划份额持有人连续大量赎回集合计划产生的流动性风险，启用侧袋机制等流动性风险管理工具带来的风险，集合计划管理人在集合计划管

理实施过程中产生的积极管理风险，集合计划的特定风险等。

投资有风险，投资者在投资集合计划之前，请仔细阅读集合计划的招募说明书、集合计划产品资料概要和资产管理合同，全面认识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，谨慎做出投资决策。

资产管理合同生效后，原华创银杏低风险套利集合资产管理计划份额变更为本集合计划 A 类份额。资产管理合同生效后，集合计划管理人不办理 A 类份额的申购业务。自资产管理合同生效之日起（包括资产管理合同生效之日）或自每一 A 类份额开放期结束之日次日起（包括该日）3 个月的期间为 A 类份额封闭期，自每个 A 类份额封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）5 个工作日的期间为 A 类份额开放期。投资者仅可在 A 类份额开放期内办理 A 类份额赎回业务。因此 A 类份额持有人面临在 A 类份额封闭期内不能赎回 A 类份额的风险。

本集合计划 B 类份额为资产管理合同生效后进行申购的份额。资产管理合同生效后，本集合计划对于每份 B 类份额设定一年的最短持有期，最短持有期内 B 类份额封闭运作。投资者持有的 B 类份额自最短持有期到期日的下一个工作日起，方可申请办理 B 类份额的赎回业务。因此 B 类份额持有人面临在最短持有期内不能赎回 B 类份额的风险。

本集合计划资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。本集合计划可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于科创板股票或选择不将集合计划资产投资于科创板股票，集合计划资产并非必然投资于科创板股票。

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。

集合计划的过往业绩并不预示其未来表现。

集合计划管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划财产，但不保证投资集合计划一定盈利，也不保证最低收益。集合计划管理人管理的其他集合计划的业绩并不构成对集合计划业绩表现的保证。集合计划管理人提醒投资人集合计划投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，集合计划运营状况与集合计划净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

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

## 目 录

|                                    |     |
|------------------------------------|-----|
| 第一部分、绪言 .....                      | 5   |
| 第二部分、释义 .....                      | 6   |
| 第三部分、集合计划管理人 .....                 | 13  |
| 第四部分、集合计划托管人 .....                 | 25  |
| 第五部分、相关服务机构 .....                  | 29  |
| 第六部分、集合计划的基本情况 .....               | 31  |
| 第七部分、集合计划的历史沿革 .....               | 33  |
| 第八部分、集合计划的存续 .....                 | 34  |
| 第九部分、集合计划份额的封闭期、最短持有期和开放期 .....    | 35  |
| 第十部分、集合计划份额的申购与赎回 .....            | 37  |
| 第十一部分、集合计划的投资 .....                | 48  |
| 第十二部分、集合计划的财产 .....                | 58  |
| 第十三部分、集合计划资产的估值 .....              | 59  |
| 第十四部分、集合计划的收益与分配 .....             | 66  |
| 第十五部分、集合计划的费用与税收 .....             | 68  |
| 第十六部分、集合计划的会计与审计 .....             | 72  |
| 第十七部分、集合计划的信息披露 .....              | 73  |
| 第十八部分、侧袋机制 .....                   | 80  |
| 第十九部分、风险揭示 .....                   | 83  |
| 第二十部分、资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算 ..... | 92  |
| 第二十一部分、资产管理合同的内容摘要 .....           | 94  |
| 第二十二部分、集合计划托管协议的内容摘要 .....         | 113 |
| 第二十三部分、对集合计划份额持有人的服务 .....         | 135 |
| 第二十四部分、招募说明书的存放及查阅方式 .....         | 136 |
| 第二十五部分、备查文件 .....                  | 137 |

## 第一部分、绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、（以下简称“《基金法》”）《公开募集证券投资基金运作管理办法》（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》”）和其他相关法律法规的规定及《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合计划”）等编写。

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

本招募说明书根据集合计划的资产管理合同编写，并经中国证监会备案。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。集合计划投资人自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人的当事人，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。集合计划投资人欲了解集合计划份额持有人的权利和义务，应详细查阅资产管理合同。

## 第二部分、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、集合计划或本集合计划：指华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划
- 2、集合计划管理人：指华创证券有限责任公司
- 3、集合计划托管人：指中信银行股份有限公司
- 4、资产管理合同：指《华创证券创享一年持有期债券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：指集合计划管理人与集合计划托管人就集合计划签订之《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新
- 7、集合计划产品资料概要：《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新
- 8、生效公告：指《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同生效公告》
- 9、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对资产管理合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日

- 实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施，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》修改的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 14、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订
- 15、《反洗钱法》：指 2006 年 10 月 31 日，中华人民共和国第十届全国人民代表大会常务委员会第二十四次会议中通过的，自 2007 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国反洗钱法》
- 16、《反洗钱工作指引》：指中国证券投资基金业协会根据《中国证券投资基金业协会章程》，于 2012 年 11 月 16 日重新修订的《基金管理公司反洗钱工作指引》
- 17、中国证监会：指中国证券监督管理委员会
- 18、银行保险监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会
- 19、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，包括集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划份额持有人
- 20、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于集合资产管理计划的自然人
- 21、机构投资者：指依法可以投资集合资产管理计划的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织



- 22、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，经中国证监会批准，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
- 23、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集合资产管理计划的其他投资人的合称
- 24、集合计划份额持有人：指依资产管理合同和招募说明书合法取得集合计划份额的投资人
- 25、集合计划销售业务：指集合计划管理人或销售机构宣传推介集合计划，办理集合计划份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务
- 26、销售机构：指华创证券有限责任公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得集合计划销售业务资格并与集合计划管理人签订了集合计划销售服务协议，办理集合计划销售业务的机构
- 27、登记业务：指集合计划登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人集合计划账户的建立和管理、集合计划份额登记、集合计划销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管集合计划份额持有人名册和办理非交易过户等
- 28、登记机构：指办理登记业务的机构。集合计划的登记机构为华创证券有限责任公司或接受华创证券有限责任公司委托代为办理登记业务的机构
- 29、集合计划账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、集合计划管理人管理的集合计划份额余额及其变动情况的账户
- 30、集合计划交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回等业务而引起的集合计划份额变动及结余情况的账户
- 31、资产管理合同生效日：指《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效日，原《华创银杏低风险套利集合资产

管理合同》同日失效

- 32、资产管理合同终止日：指资产管理合同规定的资产管理合同终止事由出现后，集合计划财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
- 33、存续期：指资产管理合同生效至终止之间的期限
- 34、集合计划份额类别：指根据运作方式、申购、赎回规则、管理费率、业绩报酬等的不同将本集合计划份额分为 A 类份额和 B 类份额，两类份额分别设置代码，并分别计算和公告集合计划份额净值和集合计划份额累计净值
- 35、A 类份额：资产管理合同生效后，原华创银杏低风险套利集合资产管理计划份额变更为本集合计划的 A 类份额，资产管理合同生效后，集合计划管理人不办理 A 类份额的申购业务，投资者仅可在 A 类份额开放期内办理 A 类份额赎回业务
- 36、B 类份额：指资产管理合同生效后进行申购的份额。资产管理合同生效后，本集合计划对于每份 B 类份额设定一年的最短持有期，最短持有期内 B 类份额封闭运作。投资者持有的 B 类份额自最短持有期到期日的下一个工作日起，方可申请办理 B 类份额的赎回业务
- 37、A 类份额封闭期：本集合计划的 A 类份额封闭期为自资产管理合同生效之日起（包括资产管理合同生效之日）或自每一 A 类份额开放期结束之日次日起（包括该日）3 个月的期间。本集合计划的第一个 A 类份额封闭期为自资产管理合同生效之日起 3 个月。下一个 A 类份额封闭期为首个 A 类份额开放期结束之日次日起的 3 个月，以此类推。本集合计划 A 类份额封闭期内不办理 A 类份额的赎回业务
- 38、A 类份额开放期：本集合计划办理 A 类份额赎回业务的 A 类份额开放期为本集合计划每个 A 类份额封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）5 个工作日的期间，具体期间由集合计划管理人在 A 类份额封闭期结束前公告说明。如 A 类份额封闭期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使 A 类份额无法按时开放赎回业务的，A 类份额开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作

日开始。如在 A 类份额开放期内发生不可抗力或其他情形致使 A 类份额无法按时开放赎回业务的，A 类份额开放期时间中止计算。自不可抗力或其他情形影响因素消除之日次一工作日起，继续计算该 A 类份额开放期时间，直到满足 A 类份额开放期的时间要求

- 39、最短持有期：资产管理合同生效后，本集合计划对于每份 B 类份额设定一年的最短持有期，即：自 B 类份额申购确认日起，至 B 类份额申购确认日次 12 个月的月度对日的期间内，投资者不能提出赎回申请；B 类份额申购确认日次 12 个月的月度对日的下一个工作日起，投资者方可申请办理 B 类份额的赎回业务。若该日历月度实际不存在对应日期的，则顺延至下一日。B 类份额在最短持有期内不办理赎回业务
- 40、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 41、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
- 42、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)，n 为自然数
- 43、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
- 44、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
- 45、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。本集合计划 A 类份额不开放申购
- 46、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和招募说明书规定的条件要求将集合计划份额兑换为现金的行为
- 47、集合计划转换：指集合计划份额持有人按照资产管理合同和集合计划管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有集合计划管理人管理的、某一集合计划的集合计划份额转换为集合计划管理人管理的其他集合计划份额的行为
- 48、转托管：指集合计划份额持有人在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
- 49、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

- 50、巨额赎回：指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)超过上一工作日集合计划总份额的 10%
- 51、元：指人民币元
- 52、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
- 53、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
- 54、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
- 55、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
- 56、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
- 57、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括集合计划管理人网站、集合计划托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
- 58、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等
- 59、摆动定价机制：指当开放式集合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

- 60、侧袋机制：指将集合计划投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户
- 61、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
- 62、不可抗力：指资产管理合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件
- 63、中国：指中华人民共和国。就资产管理合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

## 第三部分、集合计划管理人

### 一、集合计划管理人概况

名称：华创证券有限责任公司

住所：贵州省贵阳市中华北路 216 号华创大厦

法定代表人：陶永泽

设立日期：2002 年 1 月 22 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字[2002]6 号

组织形式： 有限责任公司

注册资本：922592.31 万

存续期限：持续经营

联系电话：010-66500950

### 二、主要人员情况

#### 1. 董事会成员

(1) 陶永泽，男，1963 年 6 月生，中共党员，重庆人，本科学历，毕业于贵州工学院、桂林陆军学院。历任陆军云南某部排长，连指导员，师组织干事，贵州省政府办公厅科员，副主任科员，主任科员，副处级秘书，中国联通筹备组工作人员及深圳、贵州分公司筹备负责人，贵州省贵财投资公司副总经理，贵州实联信托投资公司总经理。现任华创证券有限责任公司董事长，华创阳安股份有限公司董事长，金汇财富资本管理有限公司董事，中国证券业协会第七届理事会理事、证券科技委员会主任委员，上海证券交易所第五届理事会政策咨询委员会联席主任、风险管理委员会委员，中国证券投资基金业协会第三届监事会监事。

(2) 彭波，男，1970 年 12 月生，中共党员，重庆人，本科学历，贵州工业大学机械制造工艺及设备专业毕业，高级政工师。1993 年参加工作，历任贵阳特殊钢有限责任公司配件分厂团委书记，贵州省机械工业厅科技与质量监督处科员，中共贵州省委组织部（企业工委）企业党建处副主任科员，贵州省国资委办公室、企业领导人员管理处主任科员、副处长，贵州白酒交易所董事长，

贵州股权金融资产交易中心董事长，华创证券有限责任公司党委委员、党委副书记、纪委书记、执委会委员。现任华创证券有限责任公司党委书记、副董事长、执委会联席主任，华创阳安股份有限公司董事，兴贵投资有限公司董事长兼总经理。

(3) 张小艾，男，1970年9月生，中共党员，贵州凯里人，中国财政科学研究院会计学硕士，中国注册会计师协会非执业会员、律师、美国汉弗莱项目访问学者。1993年参加工作，历任安徽财经大学教师，中国证监会信息中心、培训中心、机构监管部、证券公司风险处置办公室、证券基金机构监管部主任科员、副处长、助理调研员、调研员（主持工作），中国证券投资基金业协会党委委员、理事、副会长、母基金专业委员会联席主席，华融证券党委副书记、华融瑞泽投资管理公司代董事长、华融汇通资产管理公司董事（总经理级），华创阳安股份有限公司副总经理。现任华创证券有限责任公司董事，华创阳安股份有限公司总经理，金汇财富资本管理有限公司董事长。

(4) 陈强，男，1975年10月生，湖南岳阳人，本科学历，湖南财经学院金融学专业毕业，上海财经大学EMBA，首批保荐代表人。1998年参加工作，历任深圳飞亚达(集团)董事会证券事务代表，海通证券深圳分公司项目经理，兴业证券深圳投行部高级经理，江南证券（现中航证券）投行事业部副总经理、北京分部总经理，平安证券投行深圳区域总部执行总经理，中航证券总裁助理、承销与保荐分公司总经理，华创证券有限责任公司副总经理、投行业务负责人、执委会副主任。现任华创证券有限责任公司董事、执委会联席主任、总裁，金汇财富资本管理有限公司董事，上海证券交易所第五届上市委员会委员、科创板发展委员会委员。

(5) 巫兰，女，1968年6月生，中共党员，贵州天柱人，管理学硕士学历，毕业于中国人民大学。1991年参加工作，历任中科院计算所科智语言信息处理有限公司部门经理，北京中企华资产评估公司项目经理，中国证监会人事教育部处长，中国证监会非上市公众公司监管部公司监管处、综合处处长，东

海证券股份有限公司合规总监兼首席风险官，中国证券业协会自律处分委员会副主任委员，江苏证券业协会自律监察与合规风控专业委员会主任委员。现任华创证券有限责任公司董事，华创阳安股份有限公司副总经理兼财务总监、董事会秘书。

(6) 华中炜，男，1978年10月生，中共党员，安徽潜山人，研究生学历，华中科技大学西方经济学博士。2000年参加工作，历任大众日报社记者，中国经济时报社编辑，汤森路透集团高级分析师、北京中文资讯部高级主管，中国银行间市场交易商协会信息研究部主管，华创证券有限责任公司研究所首席宏观分析师、所长助理、副所长，总经理助理兼研究所所长、资产管理业务管理部总经理。现任华创证券有限责任公司董事、执委会委员、副总裁兼研究产品管理部总经理，金汇财富资本管理有限公司董事。

(7) 娄爱东，女，1966年12月生，天津人。北京大学国际法学学士，中国首批证券执业律师，中华全国律师协会金融证券专业委员会委员。长期从事境内外股票发行与上市、公司并购、资产重组、外商投资及民商事诉讼和仲裁等法律服务；参与了七十余家境内外上市公司的并购和资产重组。历任中国证监会第十、第十一届发行审核委员会专职委员。现任北京市康达律师事务所律师、高级合伙人、内核负责人，国泰君安等多家证券公司内核委员会委员，国投创新等多家投资机构投资委员会委员，华创证券有限责任公司独立董事。

(8) 张子学，男，1968年8月生，中共党员，河南滑县人。中国社会科学院金融所博士后、中国政法大学公司法与证券法学博士、中国人民大学诉讼法学硕士、美国天普大学民商法硕士。曾短期任职于国家工商局、中国人民银行，历任中国证监会办公厅副处长、上市公司监管部处长、行政处罚委员会副主任审理员、并购重组审核委员会委员、行政复议委员会委员。现任中国政法大学民商经济法学院教授，中国证监会博士后科研工作站导师，中国证券投资基金业协会自律监察委员会委员，中国保险资产管理业协会股权投资及私募基金评估专家，上海证券交易所复核委员会委员，深圳证券交易所纪律处分委员



会委员，华创证券有限责任公司独立董事。

(9) 李明，男，1966年10月生，中国致公党员，安徽芜湖人，博士学历，财政部财政科学研究所会计专业毕业。1987年参加工作，历任建行惠州分行会计部员工，中国银行芜湖分行国际业务部员工。现任中国财政科学研究院财务与会计研究中心研究员、会计学博导，中国致公党中央经济委员会委员，中国会计学会常务理事，中国成本研究会常务理事，中国注册会计师协会专家委员会委员，华创证券有限责任公司独立董事。

## 2. 监事会成员

(1) 邱健，女，1965年5月生，贵州贵阳人，研究生学历，南开大学金融学专业毕业，加拿大魁北克大学席库提米分校项目管理硕士，经济师。1987年参加工作，先后从事人民银行贵州省分行会计、计划、资金管理与调度工作，历任建设银行海南省洋浦开发区分行资金计划部副经理、洋浦湾办事处主任，贵阳市商业银行资金计划部、投资业务部总经理，华创证券有限责任公司筹备组成员、财务总监、总经理。现任华创证券有限责任公司监事会主席，华创阳安股份有限公司监事。

(2) 董卫东，男，1968年10月生，中共党员，山东鄄城人，本科学历，贵州大学计算机软件专业毕业。1990年参加工作，历任贵州证券公司贵阳北京路证券营业部电脑部经理，贵州证券公司电脑管理中心职员，中国证监会贵州监管局机构监管处主任科员、副调研员，华创证券有限责任公司经纪业务管理部、稽核审计部、运维中心总经理、零售总监。现任华创证券有限责任公司监事、财富管理总监，华创期货有限责任公司董事。

(3) 姜敏斐，男，1991年2月生，中共党员，江苏常州人，金融学硕士，毕业于中央财经大学。2015年参加工作，历任中国金融期货交易所经理助理、中国证监会期货监管部干部（抽调）、金汇财富资本管理有限公司高级经理。现任华创证券有限责任公司监事，华创阳安股份有限公司证券事务代表、董事

会办公室副主任。

(4) 李云波，男，1970年10月生，贵州正安人，本科学历，四川大学哲学专业毕业。1992年参加工作，历任贵阳华烽机械厂宣传干事，贵州政通律师事务所律师，贵州实联信托投资公司办公室职员，贵州实联信托投资公司借用至中国证监会贵阳特派办稽查处协助工作，华创证券有限责任公司综合管理部副总经理、法律与稽核事务部副总经理（主持工作）、稽核与风险管理部副总经理（主持工作）、稽核与风险管理部总经理、合规与风险管理部总经理、合规与法律事务部总经理。现任华创证券有限责任公司监事、风险处置办主任。

(5) 欧阳勇，男，1969年5月生，中共党员，贵州台江人，研究生学历，财政部财政科学研究所财政学专业毕业，经济学硕士，经济师。1991年参加工作，曾就职于贵阳矿山机器厂装配分厂、研究所，贵州证券投行部，汉唐证券贵阳业务总部。历任华创证券有限责任公司财务并购部总经理助理、副总经理、总经理，办公室副总经理（主持工作）、总经理。现任华创证券有限责任公司监事、人力资源部总经理，华创期货有限责任公司董事。

### 3. 管理层成员

(1) 陈强，男，1975年10月生，湖南岳阳人，本科学历，湖南财经学院金融学专业毕业，上海财经大学EMBA，首批保荐代表人。1998年参加工作，历任深圳飞亚达(集团)董事会证券事务代表，海通证券深圳分公司项目经理，兴业证券深圳投行部高级经理，江南证券（现中航证券）投行事业部副总经理、北京分部总经理，平安证券投行深圳区域总部执行总经理，中航证券总裁助理、承销与保荐分公司总经理，华创证券有限责任公司副总经理、投行业务负责人、执委会副主任。现任华创证券有限责任公司董事、执委会联席主任、总裁，金汇财富资本管理有限公司董事，上海证券交易所第五届上市委员会委员、科创板发展委员会委员。

(2) 彭波，男，1970年12月生，中共党员，重庆人，本科学历，贵州工

业大学机械制造工艺及设备专业毕业，高级政工师。1993年参加工作，历任贵阳特殊钢有限责任公司配件分厂团委书记，贵州省机械工业厅科技与质量监督处科员，中共贵州省委组织部（企业工委）企业党建处副主任科员，贵州省国资委办公室、企业领导人员管理处主任科员、副处长，贵州白酒交易所董事长，贵州股权金融资产交易中心董事长，华创证券有限责任公司党委委员、党委副书记、纪委书记、执委会委员。现任华创证券有限责任公司党委书记、副董事长、执委会联席主任，华创阳安股份有限公司董事，兴贵投资有限公司董事长兼总经理。

（3）刘学杰，男，1965年11月生，四川开县人，本科学历，成都电讯工程学院计算机专业毕业，高级工程师。1986年参加工作，历任中国振华集团建新厂总工办副主任，贵州省国际信托投资公司贵阳证券部总经理助理、电脑部经理（兼），华创证券有限责任公司信息技术管理部总经理、公司技术总监。现任华创证券有限责任公司执委会委员、副总裁、首席信息官，云码通数据运营股份有限公司董事长。

（4）任劼，女，1965年12月生，中共党员，贵州黄平人，中南财经政法大学财政金融专业毕业，在职研究生学历，审计师。1987年参加工作，历任贵州省审计厅财政处、金融处主任科员，贵州证券稽核部、财务部经理，华创证券有限责任公司计划财务部总经理。现任华创证券有限责任公司执委会委员、副总裁、财务总监、董事会秘书。

（5）杨帆，男，1968年6月生，中共党员，重庆人，本科学历，贵州财经大学财政金融专业毕业，经济师。1988年参加工作，历任贵州省财政厅科员，贵州省国际信托投资公司信贷部科员、经理助理，上海证券部交易部经理、总经理助理，贵阳证券部副总经理，华创证券有限责任公司中华北路营业部总经理、经纪业务管理部总经理、监事会主席。现任华创证券有限责任公司执委会委员、合规总监、首席风险官。

(6) 华中炜，男，1978年10月生，中共党员，安徽潜山人，研究生学历，华中科技大学西方经济学博士。2000年参加工作，历任大众日报社记者，中国经济时报社编辑，汤森路透集团高级分析师、北京中文资讯部高级主管，中国银行间市场交易商协会信息研究部主管，华创证券有限责任公司研究所首席宏观分析师、所长助理、副所长，总经理助理兼研究所所长、资产管理业务管理部总经理。现任华创证券有限责任公司董事、执委会委员、副总裁兼研究产品管理部总经理，金汇财富资本管理有限公司董事。

(7) 王嵩，男，1972年3月生，中共党员，贵州贵阳人，本科学历，中南财经政法大学金融学专业毕业，经济师（金融类）。1994年参加工作，历任交通银行贵阳分行延西分理处会计，中国兵器工业总公司海南分公司投资部证券市场投资经理，贵州证券投资银行部发行与承销业务主办、总经理助理、贵阳延安中路营业部副总经理、贵阳新华路营业部副总经理，汉唐证券贵阳新华路营业部副总经理、总经理，华创证券有限责任公司贵阳新华路证券营业部总经理、贵阳北京路证券营业部总经理、期货工作对接小组负责人，贵州白酒交易所总经理，贵州股权金融资产交易中心总经理，华创证券有限责任公司总经理助理兼零售业务总部总经理。现任华创证券有限责任公司执委会委员、副总裁，华创期货有限责任公司董事长。

(8) 冷银辉，男，1973年2月生，中共党员，贵州遵义人，本科学历，贵州财经大学贸易经济系贸易经济专业毕业。1997年参加工作，历任贵州省经济贸易委员会市场流通处办事员、科员、副主任科员，贵州省人民政府国有资产监督管理委员会企业改革处主任科员，贵州省人民政府国有资产监督管理委员会办公室（党委办公室）主任科员、副主任、主任，机关党委委员、机关工会主席等职务。现任华创证券有限责任公司党委委员、纪委书记、工会主席、执委会委员，华创阳安股份有限公司监事。

(9) 李秀敏，男，1970年11月生，湖北孝感人，山西财经大学审计学本科毕业，经济学学士学位，清华大学EMBA，保荐代表人。1992年参加工作，历任

湖北省孝感市财贸学校财会教研室审计学教研组组长，深圳天健信德会计师事务所经理助理，深圳证券交易所发行审核部审核员（其间借调中国证监会发行监管部从事 IPO 发行审核工作），华夏证券股份有限公司投行项目管理部总经理，江南证券有限责任公司总裁助理，招商证券股份有限公司投资银行总部董事，中航证券有限公司总经理助理兼投资银行内核负责人，华创证券有限责任公司总经理助理兼投资银行内核负责人、投行业务质控与内核管理部总经理、稽核审计部总经理。现任华创证券有限责任公司执委会委员、副总裁兼股权债权产品管理部总经理。

（10）胡玄，男，1982 年 11 月生，中共党员，贵州大方人，中国人民大学金融学专业毕业，研究生学历。2007 年参加工作，曾任中再资产管理股份有限公司固定收益部投资经理、副处长，华创证券有限责任公司总经理助理。现任华创证券有限责任公司执委会委员、副总裁、首席投资官兼固定收益部总经理、权益投资部总经理，金汇财富资本管理有限公司副董事长。

（11）陈旭敏，男，1974 年 2 月生，中共党员，江西都昌人，本科学历，毕业于南昌大学。1997 年参加工作，曾任申万宏源证券创新部投资总监，中融信托助理总裁，华创证券有限责任公司总经理助理。现任华创证券有限责任公司执委会委员、副总裁兼投资交易部总经理、销售交易部总经理。

#### 4. 集合计划投资经理

肖帅女士，证券执业编号 S0360120040012，已取得基金从业资格，证书编号：A20190703006421，中国科学院大学管理学院硕士，7 年投资交易经验。2013 年 6 月至 2015 年 5 月任职于包商银行股份有限公司资产管理部，任理财经理、资金交易员，从事理财产品的资产配置及投资交易工作，2015 年 6 月加入华创证券有限责任公司，任固定收益投资经理，无兼职机构。最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

#### 5. 投资决策委员会成员

组长：高山

委员：华中炜、刘韵、肖帅、孙旭、齐昶斯、周宁

执行秘书：裴洋

### 三、集合计划管理人的职责

- 1.依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理集合计划份额的申购、赎回和登记事宜。
- 2.办理集合计划备案手续。
- 3.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.编制集合计划季度报告、中期和年度集合计划报告。
- 7.计算集合计划资产净值，计算并公告集合计划份额净值、集合计划份额累计净值，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.按照规定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.以集合计划管理人名义，代表集合计划份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。
- 12.有关法律、法规和中国证监会规定的其他职责。

### 四、集合计划管理人承诺

1、集合计划管理人不得从事违反法律法规的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反法律法规行为的发生。

2、集合计划管理人建立健全内部控制制度，采取有效措施，禁止将集合计划财产用于下列投资或活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他集合计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其集合计划管理人、集合计划托管人出资；
- (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。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，如适用于集合计划，则集合计划投资不再受相关限制。

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

(1) 越权或违规经营，违反资产管理合同或托管协议；

(2) 故意损害集合计划份额持有人或其他集合计划相关机构的合法利益；

(3) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；

(4) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(5) 玩忽职守、滥用职权；

(6) 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；

(7) 除按依法进行集合计划资产管理外，直接或间接进行股票投资；

(8) 其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 4、集合计划经理承诺

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

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

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

(4) 不以任何形式为除集合计划管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

#### 五、集合计划管理人的内部控制制度

##### 1. 内部控制的原则

集合计划管理人的内部控制遵循以下原则：

(1) 全面性：风险管理针对公司面临的所有风险类别，覆盖公司及子公司的所有业务、部门和人员，渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节，确保风险管理无空白或漏洞。

(2) 合规性：风险管理战略必须符合国家有关法律法规、中国证监会和公司章程的有关规定，需与公司的经营规模、业务范围、风险状况及公司所处的环境相适应，并与公司的长期发展目标保持一致。

(3) 制衡性：公司部门和岗位的设置需权责分明、相互制衡，有冲突职务需相对分离。

(4) 及时性：在风险发生或发现时及时进行风险管理，讲究时效。风险管理策略及方法根据公司经营战略、经营方针等内部环境的变化和国家法律法规等外部环境的改变及时进行完善。

(5) 独立性：公司建立具有独立性的风险控制体系，风险管理部根据公司的授权独立开展风险管理工作。

(6) 制度管理原则：制定并持续完善资产管理业务的风险管理制度，并保证各项制度的贯彻落实。

(7) 定性和定量相结合原则：建立健全风险管理指标体系和风险评估标准，采取定量评估和定性分析相结合的方法，客观、准确地计量和管理风险。

## 2. 完备严密的内部控制体系

公司全面风险管理组织架构由五个层级和三道防线构成，五个层级分别为：董事会、经理层（执行委员会）、风险管理职能部门、相关业务管理支持部门、业务部门及分支机构及子公司。

三道防线分别为：相关业务管理支持部门、业务部门及分支机构为第一道防线，负责事前与事中的自我防范；风险管理部、合规与法律事务部为第二道防线，负责事前与事中的风险管理及事后的风险处置；稽核审计部为第三道防线，执行事中与事后的独立监督与评价职责。

## 3. 内部控制制度的内容

内部控制制度指规范内部控制的一系列规章制度和业务规则，内部控制制度制订的基本依据为法律法规、中国证监会及其他主管部门有关文件的规定。

(1) 公司基本管理制度——是管理人在经营管理方面进行内部控制的制度依据。基本管理制度包括但不限于风险管理制度、投资管理办法、会计核算管理办法、信息披露管理办法、稽核制度、信息系统管理办法等；



(2)部门规章制度以及业务流程——部门规章制度以及业务流程是在公司基本管理制度的基础上，对业务管理操作的具体规则约定和说明。

公司建立健全投资者适当性、投资决策、公平交易、会计核算、风险控制、合规管理、投诉处理等管理制度，加强从业人员管理和岗位监督与制衡，完善激励约束机制，建立健全应急处理机制，建立公平交易制度和关联交易管理办法，控制敏感信息的不当流动和使用，切实防范内幕交易、利用未公开信息交易、利益冲突和利益输送。

#### 4、集合计划管理人关于内部控制的声明

本公司确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是本公司董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本公司特别声明以上关于内部控制和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和公司的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

## 第四部分、集合计划托管人

### 一、集合计划托管人基本情况

#### 1、基本情况

名称：中信银行股份有限公司(简称：中信银行)

住所：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼

法定代表人：朱鹤新

成立时间：1987 年 4 月 20 日

批准设立机关和批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14 号组织形式：股份有限公司

注册资本：489.35 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2004]125 号

联系人：中信银行资产托管部

联系电话：4006800000

传真：010-85230024

客服电话：95558

网址：[bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com)

经营范围：保险兼业代理业务；吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式集合计划业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资集合计划、企业年金集合计划、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行保险监督管理委员会批准的其他业务。（企业依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

## 2、主要人员情况

方合英先生，中信银行执行董事、行长兼财务总监。方先生于 2018 年 9 月加入中信银行董事会。方先生自 2014 年 8 月起任中信银行党委委员，2014 年 11 月起任中信银行副行长，2017 年 1 月起兼任中信银行财务总监，2019 年 2 月起任中信银行党委副书记。方先生现同时担任信银（香港）投资有限公司、中信银行（国际）有限公司及中信国际金融控股有限公司董事。此前，方先生于 2013 年 5 月至 2015 年 1 月任中信银行金融市场业务总监，2014 年 5 月至 2014 年 9 月兼任中信银行杭州分行党委书记、行长；2007 年 3 月至 2013 年 5 月任中信银行苏州分行党委书记、行长；2003 年 9 月至 2007 年 3 月历任中信银行杭州分行行长助理、党委委员、副行长；1996 年 12 月至 2003 年 9 月在中信银行杭州分行工作，历任信贷部科长、副总经理，富阳支行行长、党组书记，国际结算部副总经理，零售业务部副总经理，营业部总经理；1996 年 7 月至 1996 年 12 月任浦东发展银行杭州城东办事处副主任；1992 年 12 月至 1996 年 7 月在浙江银行学校实验城市信用社信贷部工作，历任信贷员、经理、总经理助理；1991 年 7 月至 1992 年 12 月在浙江银行学校任教师。方先生为高级经济师，毕业于北京大学，获高级管理人员工商管理硕士学位，拥有二十余年中国银行业从业经验。

谢志斌先生，中信银行副行长，分管托管业务。谢先生自 2019 年 6 月起担任中信银行副行长，自 2019 年 2 月起担任中信银行党委委员。此前，谢先生于 2015 年 7 月至 2019 年 1 月任中国光大集团股份公司纪委书记、党委委员。2012 年 3 月至 2015 年 7 月任中国出口信用保险公司总经理助理，期间于 2014 年 1 月至 2015 年 7 月挂职任内蒙古自治区呼和浩特市委常委、副市长。2011 年 3 月至 2012 年 3 月任中国出口信用保险公司党委委员、总经理助理。2001 年 10 月至 2011 年 3 月历任中国出口信用保险公司人力资源部职员、总经理助理、副总经理、总经理（党委组织部部长助理、副部长、部长），深圳分公司党委书记，河北省分公司负责人、党委书记、总经理。1991 年 7 月至 2001 年 10 月历任中国人民保险公司科员、主任科员、副处长。谢先生为经济师，毕业于中国人民大学，获经济学博士学位。

杨璋琪先生，中信银行资产托管部总经理，硕士研究生学历。杨先生 2018

年1月至2019年3月，任中信银行金融同业部副总经理；2015年5月至2018年1月，任中信银行长春分行副行长；2013年4月至2015年5月，任中信银行机构业务部总经理助理；1996年7月至2013年4月，就职于中信银行北京分行（原总行营业部），历任支行行长、投资银行部总经理、贸易金融部总经理。

### 3、托管业务经营情况

2004年8月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2021年第一季度末，中信银行托管202只公开募集证券投资基金，以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，托管总规模达到10.97万亿元人民币。

## 二、集合计划托管人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

作为集合计划托管人，中信银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证集合计划财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护集合计划份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

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

### 3、内部控制制度及措施

托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信

息披露人员负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

三、集合计划托管人对集合计划管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定，对基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金托管人发现基金管理人重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

## 第五部分、相关服务机构

### 一、集合计划份额销售机构

#### 1、直销机构

名称：华创证券有限责任公司

注册地址：贵州省贵阳市中华北路 216 号华创大厦

办公地址：贵州省贵阳市中华北路 216 号华创大厦

法定代表人：陶永泽

电话：95513

联系人：客服中心

#### 2、其他销售机构

集合计划管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售本集合计划，并在集合计划管理人网站公示。

### 二、注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

电话：4008—058—058

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市海华永泰律师事务所

注册地址：上海市华阳路 112 号 2 号楼东虹桥法律服务园区 302 室

办公地址：上海市陆家嘴环路 1366 号富士康大厦 12 层

负责人：冯加庆

电话：（021）58773177

传真：（021）58773268

联系人：张兰

经办律师：梁丽金、张兰

### 四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称：大华会计师事务所（特殊普通合伙）贵州分所

住所：贵阳市观山湖区金阳北路3号附1号金阳汇诚商业办公楼13楼19号

办公地址：贵阳市观山湖区金阳北路3号附1号金阳汇诚商业办公楼13楼19号

执行事务合伙人：江山

电话：0851-85802030

传真：0851-85802278

联系人：江山

经办会计师：江山

## 第六部分、集合计划的基本情况

### 一、集合计划名称

华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划

### 二、集合计划类别

债券型集合资产管理计划

### 三、集合计划运作方式

契约型开放式

#### 1、A类份额的运作方式

资产管理合同生效后，原华创银杏低风险套利集合资产管理计划份额变更为本集合计划A类份额。资产管理合同生效后，集合计划管理人不办理A类份额的申购业务。

本集合计划A类份额自资产管理合同生效日起每封闭3个月集中开放赎回一次，A类份额开放期为5个工作日。本集合计划A类份额封闭期内不办理A类份额的赎回业务。本集合计划A类份额以定期开放方式运作，其A类份额封闭期为自资产管理合同生效之日起（包括资产管理合同生效之日）或自每一A类份额开放期结束之日次日起（包括该日）3个月的期间。本集合计划的第一个A类份额封闭期为自资产管理合同生效之日起3个月。首个A类份额封闭期结束之后第一个工作日起进入5个工作日的首个A类份额开放期，如A类份额封闭期结束之日后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使A类份额无法按时开放赎回业务的，A类份额开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。如在A类份额开放期内发生不可抗力或其他情形致使A类份额无法按时开放赎回业务的，A类份额开放期时间中止计算，自不可抗力或其他情形影响因素消除之日次一工作日起，继续计算该A类份额开放期时间，直到满足A类份额开放期的时间要求。下一个A类份额封闭期为首个A类份额开放期结束之日次日起的3个月，以此类推。

#### 2、B类份额的运作方式

资产管理合同生效后，本集合计划B类份额开放日常申购业务，但对于每份B类份额设定一年的最短持有期，即：自B类份额申购确认日起，至B类份额申购确认日次12个月的月度对日的期间内，投资者不能提出赎回申请；B类



份额申购确认日次 12 个月的月度对日的下一个工作日起,投资者方可申请办理 B 类份额的赎回业务。若该日历月度实际不存在对应日期的,则顺延至下一日。B 类份额在最短持有期内不办理赎回业务。

#### 四、集合计划份额面值

本集合计划份额面值为人民币 1.00 元。

#### 五、集合计划存续期限

本集合计划自资产管理合同生效日起存续不得超过 3 年。

#### 六、集合计划份额类别

根据运作方式、申购、赎回规则、管理费率、业绩报酬等的不同将本集合计划份额分为 A 类份额和 B 类份额。资产管理合同生效后,原华创银杏低风险套利集合资产管理计划份额变更为本集合计划的 A 类份额,集合计划管理人不办理 A 类份额的申购业务,投资者仅可在 A 类份额开放期内办理 A 类份额赎回业务。本集合计划 B 类份额为资产管理合同生效后进行申购的份额。资产管理合同生效后,本集合计划对于每份 B 类份额设定一年的最短持有期,最短持有期内 B 类份额封闭运作。投资者持有的 B 类份额自最短持有期到期日的下一个工作日起,方可申请办理 B 类份额的赎回业务。

本集合计划两类份额分别设置代码,并分别计算和公告集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

本集合计划不同类别份额之间不得互相转换。

根据本集合计划运作情况,在不违反法律法规规定、资产管理合同约定以及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,集合计划管理人在履行适当程序后可以增加新的集合计划份额类别、调整现有集合计划份额类别的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式或者停止现有集合计划份额类别的销售,或对集合计划份额分类办法及规则进行调整等,而无需召开计划份额持有人大会,但调整实施前管理人需及时公告。

## 第七部分、集合计划的历史沿革

华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划由华创银杏低风险套利集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。

华创银杏低风险套利集合资产管理计划的集合计划管理人为华创证券有限责任公司，集合计划托管人为中信银行股份有限公司。华创银杏低风险套利集合资产管理计划自 2013 年 5 月 22 日起开始募集，于 2013 年 5 月 28 日结束募集工作，于 2013 年 5 月 31 日正式成立，并于 2013 年 7 月 8 日取得中国证券业协会《关于华创证券有限责任公司发起设立华创银杏低风险套利集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013] 688 号）。

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，华创银杏低风险套利集合资产管理计划参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律法规及中国证监会的规定进行变更，并将原集合计划名称变更为“华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划”，变更后的《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》自集合计划管理人公告的生效之日起生效，原《华创银杏低风险套利集合资产管理合同》同日失效。

## 第八部分、集合计划的存续

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

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

本集合计划自本资产管理同生效日起存续期不得超过 3 年。

## 第九部分、集合计划份额的封闭期、最短持有期和开放期

### 一、A 类份额封闭期和 A 类份额开放期

#### 1、A 类份额封闭期

本集合计划的 A 类份额封闭期为自资产管理合同生效之日起（包括资产管理合同生效之日）或自每一 A 类份额开放期结束之日次日起（包括该日）3 个月的期间。本集合计划的第一个 A 类份额封闭期为自资产管理合同生效之日起 3 个月。下一个 A 类份额封闭期为首个 A 类份额开放期结束之日次日起的 3 个月，以此类推。

本集合计划 A 类份额封闭期内不办理 A 类份额的赎回业务。

#### 2、A 类份额开放期

本集合计划办理 A 类份额赎回业务的 A 类份额开放期为本集合计划每个 A 类份额封闭期结束之后第一个工作日起 5 个工作日的期间。如 A 类份额封闭期结束之后第一个工作日因不可抗力或其他情形致使 A 类份额无法按时开放赎回业务的，A 类份额开放期自不可抗力或其他情形的影响因素消除之日起的下一个工作日开始。本集合计划 A 类份额的开放日为在 A 类份额开放期内销售机构办理 A 类份额赎回等业务的工作日。如在 A 类份额开放期内发生不可抗力或其他情形致使 A 类份额无法按时开放赎回业务的，A 类份额开放期时间中止计算。自不可抗力或其他情形影响因素消除之日次一工作日起，继续计算该 A 类份额开放期时间，直到满足 A 类份额开放期的时间要求。

### 二、B 类份额最短持有期

资产管理合同生效后，本集合计划对于每份 B 类份额设定一年的最短持有期，即：自 B 类份额申购确认日起，至 B 类份额申购确认日次 12 个月的月度对日的期间内，投资者不能提出赎回申请；B 类份额申购确认日次 12 个月的月度对日的下一个工作日起，投资者方可申请办理 B 类份额的赎回业务。若该日历月度实际不存在对应日期的，则顺延至下一日。

本集合计划 B 类份额自资产管理合同生效之日起不超过 3 个月内开始办理 B 类份额的申购业务。

### 三、封闭期、最短持有期与开放期示例

1、假设原集合计划变更为本集合计划后的资产管理合同于 2021 年 9 月 1 日生效，则本集合计划的第一个 A 类份额封闭期为资产管理合同生效之日起 3 个月，即 2021 年 9 月 1 日至 2021 年 11 月 30 日；本集合计划管理人确定本集合计划的第一个 A 类份额开放期为 5 个工作日，则第一个 A 类份额开放期为自 2021 年 12 月 1 日至 2021 年 12 月 7 日；第二个 A 类份额封闭期为第一个 A 类份额开放期结束之日次日起的 3 个月，即 2021 年 12 月 8 日至 2022 年 3 月 8 日，以此类推。

2、假设原集合计划变更为本集合计划后的资产管理合同于 2021 年 9 月 1 日生效，本集合计划管理人确定本集合计划 B 类份额自 2021 年 11 月 1 日起开始办理 B 类份额的申购业务。对于申购确认日为 2021 年 11 月 2 日的 B 类份额，该 B 类份额的最短持有期为自 2021 年 11 月 2 日至 2022 年 11 月 2 日。自 2022 年 11 月 3 日起，投资者方可申请办理该 B 类份额的赎回业务。

## 第十部分、集合计划份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

本集合计划的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售机构将由集合计划管理人在招募说明书或其他相关公告中列明或在集合计划管理人网站上公示。集合计划管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在集合计划管理人网站上予以公示。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。

若集合计划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申购与赎回，具体办法由集合计划管理人另行公告。

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本集合计划 A 类份额不开放申购。集合计划管理人在 A 类份额开放期内的每个工作日办理 A 类份额的赎回。集合计划管理人自 B 类份额最短持有期到期日的下一个工作日起办理 B 类份额的赎回业务，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但集合计划管理人根据法律法规、中国证监会的要求或资产管理合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

本集合计划每个 A 类份额开放期的具体时间以集合计划管理人届时公告为准。

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

B 类份额在最短持有期到期日的下一个工作日起，B 类份额持有人方可就 B 类份额提出赎回申请。如果投资人多次申购本集合计划 B 类份额，则其持有的

B 类份额的赎回开放时间可能不同。

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

### 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在集合计划管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人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华创银杏低风险套利集合资产管理计划的份额期限连续计算；

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。

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购集合计划份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；集合计划份额登记机构确认集合计划份额时，申购生效。若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成立。

集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；集合计划份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，集合计划管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系

统故障、银行数据交换系统故障或其它非集合计划管理人及集合计划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除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或资产管理合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照资产管理合同有关条款处理。

### 3、申购和赎回申请的确认

集合计划管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，本集合计划登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购未生效，则申购款项本金退还给投资人。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定生效，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、赎回申请及申购份额、赎回金额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

### 五、申购和赎回的数量限制

1、集合计划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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

2、集合计划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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

3、集合计划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，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

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

5、集合计划管理人可在不违反法律法规规定和资产管理合同约定的情形下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。集合计划管理人必须在调



整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购和赎回的费率

### 1、申购费率

本集合计划 A 类份额不开放申购。投资人申购本集合计划 B 类份额的申购费率为 0。

### 2、赎回费率

#### (1) A 类份额

本集合计划 A 类份额的赎回费率如下：

| A类份额持有期限    | 赎回费率 |
|-------------|------|
| 持有期限<7 日    | 1.5% |
| 7日≤持有期限<30日 | 0.1% |
| 持有期限≥30日    | 0    |

A 类份额的赎回费用由赎回本集合计划 A 类份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回 A 类份额时收取。对于持续持有 A 类份额少于 7 日的投资人收取的赎回费，将全额计入集合计划财产。对持续持有 A 类份额长于或等于 7 日的投资人收取的赎回费，将赎回费总额 25% 的部分计入集合计划财产，未计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：A 类份额持有期限从登记机构确认投资人持有原华创银杏低风险套利集合资产管理计划的份额期限连续计算。

#### (2) B 类份额

本集合计划对于每份 B 类份额设定一年的最短持有期，投资人需至少持有本集合计划 B 类份额满一年，在一年的最短持有期内不能提出赎回申请，不收取赎回费。

3、集合计划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、集合计划管理人可以在不违反法律法规规定及《资产管理合同》约定的情形下根据市场情况制定集合计划促销计划，定期或不定期地开展集合计划促销活动。在集合计划促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，集

合计划管理人可以适当调低申购费率、赎回费率。

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

#### 七、申购份额与赎回金额的计算方式

##### 1、申购份额的计算

本集合计划 B 类份额的申购份额的计算方式如下：

申购份额 = 申购金额/T 日 B 类集合计划份额净值

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

例：某投资人投资 10,000 元申购本集合计划 B 类份额，假设申购当日 B 类集合计划份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

申购份额=10,000/1.0500=9523.81 份

即：投资人投资10,000元申购本集合计划B类份额，假设申购当日B类集合计划份额净值为1.0500元，则其可得到9523.81份B类份额。

##### 2、赎回金额的计算

本集合计划的赎回金额为赎回总额扣减应计提的业绩报酬（如有）及赎回费用（如有）。其中：

赎回总额=赎回份数×T 日该类集合计划份额净值—应计提的业绩报酬（如有）

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额—赎回费用

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

例：某投资人赎回本集合计划 10,000 份 A 类份额，持有时间为 7 天，对应的赎回费率为 0.10%，假设赎回当日 A 类集合计划份额净值是 1.0500 元，且该投资人该笔 A 类份额未产生业绩报酬，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.0500-0=10,500.00 元

赎回费用=10,500.00×0.10%=10.50 元

赎回金额=10,500.00-10.50=10,489.50 元

即：投资人赎回本集合计划 1 万份 A 类份额，持有时间为 7 天，对应的赎回费率为 0.10%，假设赎回当日 A 类集合计划份额净值是 1.0500 元，且该投资人该笔 A 类份额未产生业绩报酬，则其可得到的赎回金额为 10,489.50 元。

例：某投资人在 B 类份额最短持有期后赎回其持有满一年的 B 类份额 10,000 份，不收赎回费，假设赎回当日 B 类集合计划份额净值是 1.2500 元，且该投资人该笔 B 类份额产生的业绩报酬为 500 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.2500-500=12,000.00 元

赎回费用=12,000.00×0=0.00 元

赎回金额=12,000.00-0.00=12,000.00 元

即：投资人在 B 类份额最短持有期后赎回其持有满一年的 B 类份额 10,000 份，不收赎回费，假设赎回当日 B 类集合计划份额净值是 1.2500 元，且该投资人该笔 B 类份额产生的业绩报酬为 500 元，则其可得到的赎回金额为 12,000.00 元。

### 3、T 日集合计划份额净值的计算

T 日各类集合计划份额净值 = T 日各类集合计划资产净值 / T 日该类集合计划份额总数。

T 日的各类集合计划份额净值在当天收市后计算，均精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。集合计划管理人应当按照资产管理合同的约定披露集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

### 八、拒绝或暂停申购的情形

资产管理合同生效后，集合计划管理人不办理 A 类份额的申购业务。

发生下列情况时，集合计划管理人可拒绝或暂停接受投资人的 B 类份额申购申请：

- 1、因不可抗力导致集合计划无法正常运转。
- 2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，集合计划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，导致集合计划管理人无法计算

当日集合计划资产净值。

4、集合计划管理人认为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或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。

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

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

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

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

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、7、9 项暂停申购情形之一且集合计划管理人决定暂停接受投资人 B 类份额申购申请时，集合计划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。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，集合计划管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，集合计划管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致集合计划管理人不能支付赎回款项。

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

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致集合计划管理人无法计算当日集合计划资产净值。

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且集合计划管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，集合计划管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，集合计划管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按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，集合计划管理人应及时恢复赎回业务的办理，如发生暂停 A 类份额赎回的情况，A 类份额开放期时间将相应顺延，具体时间见集合计划管理人届时公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本集合计划单个开放日内的集合计划份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上集合计划转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及集合计划转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一工作日的集合计划总份额的 10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当集合计划管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对集合计划资产净值

造成较大波动时，集合计划管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日集合计划总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 在发生巨额赎回时，如发生单个开放日内单个集合计划份额持有人申请赎回的集合计划份额超过前一工作日的集合计划总份额的 10%时，集合计划管理人有权先行对该单个集合计划份额持有人超出前一工作日集合计划总份额 10%以上的部分赎回申请实施延期办理，集合计划管理人只接受其集合计划总份额 10%以内（含 10%）部分作为当日有效赎回申请，而对该单个集合计划份额持有人 10%以内（含 10%）的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”条款处理。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，集合计划管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个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 日内在指定媒介上刊登公告。

#### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、如发生暂停的时间为 1 日，集合计划管理人应于重新开放日，在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；如发生暂停的时间超过 1 日，则集合计划管理人可以根据需要增加公告次数，但集合计划管理人须依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、集合计划转换

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

## 十三、集合计划的非交易过户

集合计划的非交易过户是指集合计划登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户，或者按照相关法律法规或国家有权机关要求的方式进行处理的行为。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，或按法律法规或国家有权机关要求的方式执行。

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

## 十四、集合计划的转托管

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

## 十五、定期定额投资计划

集合计划管理人可以为投资人办理定期定额投资计划，具体规则由集合计划管理人另行规定。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，每期扣款金额必须不低于集合计划管理人在相关公告或更新的招募说明书

中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

#### 十六、集合计划的冻结和解冻与质押及转让

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

集合计划管理人可以根据法律法规或监管机构的规定办理集合计划份额的质押业务，并制定相应的业务规则。

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

十七、集合计划管理人可在不违反相关法律法规、不对集合计划份额持有人利益产生不利影响的前提下，根据具体情况在履行适当程序后，对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。

#### 十八、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回

本集合计划实施侧袋机制的，本集合计划的申购和赎回安排详见本招募说明书的有关规定或相关公告。



## 第十一部分、集合计划的投资

### 一、投资目标

本集合计划主要投资于债券资产，严格管理权益类品种的投资比例，在控制集合计划资产净值波动的基础上，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货、股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，本集合计划投资于股票资产的比例不超过集合计划资产的 20%。

每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

### 三、投资策略

#### A. 大类资产配置策略

本集合计划将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在股票、债券和银行存款等资产类别之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例。

#### B. 债券组合管理策略

##### 1、利率策略

利率策略主要是从组合久期及组合期限结构两个方向制定针对市场利率因素的投资策略。通过全面研究国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标，根据对市场利率水平的变化趋势的预期，可以制定出组合的目标久期，预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。

利用收益率曲线斜度变化可以制定相应的债券组合期限结构策略，例如：子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

## 2、类属配置策略

债券类属策略主要是通过研究国民经济运行状况，货币市场及资本市场资金供求关系，以及不同时期市场投资热点，分析国债、金融债、企业债券等不同债券种类的利差水平，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

## 3、信用债策略

信用债品种的选择采取以利率研究和发行人偿债能力研究为核心的分析方式，在对宏观经济、利率走势、发行人经营及财务状况进行分析的基础上，结合信用品种的发行条款，建立信用债备选库，并以此为基础拟定信用品种的投资方法。

本集合计划投资于信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于 AA，其中本集合计划投资于 AAA 信用评级的信用债的比例不低于集合计划资产净值的 50%；本集合计划投资于 AA+信用评级的信用债的比例不超过集合计划资产净值的 50%；本集合计划投资于 AA 信用评级的信用债的比例不超过集合计划资产净值的 20%；信用评级参照评级机构（中债资信除外）评定的最新债项评级，无债项评级的参照主体评级。

### （1）宏观环境和行业分析

主要关注宏观经济状况和经济增长速度、宏观经济政策及法律制度对企业信用级别的影响；行业分析主要关注企业所处的行业类型（成长型、周期型、

防御型）、产业链结构及行业在产业链中的位置、行业的竞争程度和行业政策对企业信用级别的影响。

## （2）发债主体基本面分析

主要包括定性分析和定量分析两个方面：

定性分析主要包括对企业性质和内部治理情况、企业财务管理的风格、企业的盈利模式、企业在产业链中的位置、产品竞争力和核心优势的分析，以及企业的股东背景、政府对企业的支持、银企关系、企业对国家或地方的重要程度等企业的外部支持分析。

定量分析主要包括资本结构分析、现金获取能力分析、盈利能力分析以及偿债能力分析四部分，定量分析的重点是选取适当的财务指标并挖掘其中蕴含的深层含义及互动关系，定量地实现企业信用水平的区分和预测。

## （3）内部信用评级定量分析体系

经过广泛的调研，基于我国目前实际情况，考虑到国内外评级、以及专业的发行评级与投资评级的差异，从投资角度建立内部的公司债评级体系，其分析过程包括以下几个部分：

1) 行业内财务数据指标筛选。基于可比原则，采用因子分析对行业内各公司多个具有信息冗余的财务数据指标（相关性较高）进行筛选，选择能够反映公司总体财务信息的财务数据指标。

2) 行业内公司综合评价。基于可比原则，利用筛选指标对行业内公司进行整体的综合评级，得到反映公司行业内所处相对位置的信用分数。

3) 行业内信用等级的切分。根据信用分数的统计分布进行类别划分。

4) 系统校验与跟踪分析。根据财务数据指标等信息的变化适时对信用等级进行调整，并建立与信用利差相应的跟踪。

5) 信用利差分析与定价。基于实际研究，通过寻找信用利差异动所带来的定价偏差，获取与承担风险相适宜的收益。

## 4、相对价值策略

本集合计划认为市场存在着失效的现象，短期因素的影响被过分夸大。债券市场的参与者众多，投资行为、风险偏好、财务与税收处理等各不相同，发掘存在于这些不同因素之间的相对价值，也是本集合计划发现投资机会的重要

方面。本集合计划密切关注国家法律法规、制度的变动，通过深入分析市场参与者的立场和观点，充分利用因市场分割、市场投资者不同风险偏好或者税收待遇等因素导致的市场失衡机会，形成相对价值投资策略，为本集合计划的投资带来增加价值。

#### 5、债券选择策略

根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。

#### 6、资产支持证券等品种投资策略

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

#### 7、可交换债券及可转换债券投资策略

本集合计划投资于可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）的比例不超过集合计划资产净值的 20%。

可转换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值，本集合计划管理人将对可转换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资。此外，本集合计划还将根据新发可转债的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转债新券的申购。

### C. 股票投资策略

#### 1、新股申购策略

本集合计划通过对新股发行公司的行业景气度、财务稳健性、公司竞争力、利润成长性等因素的分析，参考同类公司的估值水平，进行股票的价值评估，从而判断一、二级市场价差的大小，并根据资金成本、过往新股的中签率及上市后股价涨幅的统计、股票锁定期间投资风险的判断，制定新股申购策略。

#### 2、二级市场股票投资策略

本集合计划二级市场股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选高成长性的优势企业进行投资。本集合计划将结合对宏观经济状况、行业成

长空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断，对公司的盈利能力、偿债能力、营运能力、成长性、估值水平、公司战略、治理结构和商业模式等方面进行定量和定性的分析，深入挖掘盈利预期稳步上升、成长性发生根本变化且价值低估的上市公司，构建股票投资组合，并持续地进行组合的优化调整，控制流动性风险和集中性风险，保证股票组合的稳定性和收益性。

### 3、科创板股票投资策略

主要投资符合下列条件的科创板上市公司：所处行业为国家产业政策鼓励，或者是限制国内相关产业发展、亟需补齐短板的紧缺产业；在行业中掌握核心技术优势，具有自主知识产权，具备一定竞争壁垒的核心竞争力；持续保持高强度的技术研发投入，并具备将研发成果转化为实用产品的能力；具有良好的公司治理结构和社会责任历史，从公司控制人、管理层和中层技术人员均有完善的激励机制，企业信息披露公开透明等。

#### D. 国债期货投资策略

本集合计划投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场定性和定量的分析，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平等指标进行跟踪监控，在追求集合计划资产安全的基础上，力求实现集合计划资产的中长期稳定增值。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，本集合计划投资于股票资产的比例不超过集合计划资产的 20%；

(2) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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、存出保证金和应收申购款等；

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

(4) 管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

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

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

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

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

(9) 本集合计划应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(10) 本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%; 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;

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

(12) 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;

(13) 本集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的 140%;

(14) 本集合计划投资于信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于 AA, 其中本集合计划投资于 AAA 信用评级的信用债的比例不低于集合计划资产净值的 50%; 本集合计划投资于 AA+信用评级的信用债的比例不超过集合计划资产净值的 50%; 本集合计划投资于 AA 信用评级的信用债的比例不超过集合计划资产净值的 20%; 信用评级参照评级机构(中债资信除外)评定的最新债项评级, 无债项评级的参照主体评级;

(15) 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；

(16) 集合计划管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合计划持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；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；

(17) 本集合计划参与国债期货交易，应当遵守下列要求：

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

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

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

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

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

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（11）、（12）情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等集合计划管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，集合计划管理人应当在 10 个交易日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。

集合计划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。集合计划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，详见托管协议中有关托管人投资监督具体约定。

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。如法律法规或监管部门取消上述限制，且适用于本集合计划，则集合计划管理人在履行适当程序后，不需要经集合计划份额持有人大会审议，本集合计划投资不再受相关限制。如本集合计划增加投资品种，投资限制以法律法规和中国证监会的规定为准。

## 2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他集合计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其集合计划管理人、集合计划托管人出资；
- (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。

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

3、集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到集合计划托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交集合计划管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。集合计划管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

## 五、业绩比较基准



中债综合财富(1-3年)指数收益率\*80%+沪深300指数收益率\*10%+中证500指数收益率\*10%。

中债综合财富(1-3年)指数是中债金融估值中心有限公司编制的综合反映银行间和交易所债券市场中短期债券价格走势情况的宽基指数,可反映中短期债券的整体价格和投资回报情况,本集合计划资产配置以1-3年内到期的信用债为主,与该指数的期限相匹配;选用沪深300指数作为对标,可反映主要行业龙头的偏价值风格,选用中证500指数可反映中大市值的成长风格,两个对标指数的结合适合作为本集合计划股票投资部分的业绩比较基准。基于本集合计划的投资范围和投资比例限制,该业绩比较基准能够较好地反映本集合计划的风险收益特征,适合作为本集合计划的业绩比较基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能够表征本集合计划风险收益特征的指数,则管理人可与托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后,调整或变更本集合计划的业绩比较基准并及时公告。

## 六、风险收益特征

本集合计划为债券型集合计划,其预期风险和预期收益率低于股票型集合计划和混合型集合计划,高于货币市场集合计划。

## 七、集合计划管理人代表集合计划行使相关权利的处理原则及方法

1、集合计划管理人按照国家有关规定代表集合计划独立行使相关权利,保护集合计划份额持有人的利益;

2、有利于集合计划财产的安全与增值;

3、不谋求对上市公司的控股;

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,集合计划管理人经与集合计划托管人协商一致,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本招募说明书的有关规定。

## 第十二部分、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集合计划款以及其他投资所形成的价值总和。

### 二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

### 三、集合计划财产的账户

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

### 四、集合计划财产的保管和处分

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

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

## 第十三部分、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/期货交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露集合计划净值的非交易日。

### 二、估值对象

集合计划所拥有的股票、债券、国债期货和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。

### 三、估值原则

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

(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,集合计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(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，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，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的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

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

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

##### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）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、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、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

6、本集合计划可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

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

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

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

如集合计划管理人或集合计划托管人发现集合计划估值违反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集合计划管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由集合计划管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照集合计划管理人对集合计划净值的计算

结果对外予以公布，集合计划托管人对此不承担责任。

## 五、估值程序

1、某一类别集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，某一类别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，由此产生的误差计入集合计划财产。集合计划管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制，具体可参见相关公告。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算集合计划资产净值、各类集合计划份额净值及各类集合计划份额累计净值，并按规定公告。

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

## 六、估值错误的处理

集合计划管理人和集合计划托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当某一类别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，视为该类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，如果由于集合计划管理人或集合计划托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，

由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 错误偏差达到该类集合计划份额净值的 0.25%时，集合计划管理人应



当通报集合计划托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类集合计划份额净值的 0.5%时，集合计划管理人应当公告、通报集合计划托管人，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、因不可抗力或其他情形致使集合计划管理人、集合计划托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4、法律法规、中国证监会规定和资产管理合同认定的其它情形。

#### 八、集合计划净值的确认

用于集合计划信息披露的各类集合计划份额净值由集合计划管理人负责计算，集合计划托管人负责进行复核。集合计划管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值并发送给集合计划托管人。集合计划托管人对净值计算结果复核确认后发送给集合计划管理人，由集合计划管理人依据资产管理合同和相关法律法规的规定对集合计划净值予以公布。

#### 九、特殊情形的处理

1、集合计划管理人按本部分第四款有关估值方法规定的第 7、8 项条款进行估值时，所造成的误差不作为集合计划份额估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所及登记机构发送的数据错误，集合计划管理人和集合计划托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的集合计划资产估值错误，集合计划管理人和集合计划托管人可以免除赔偿责任。但集合计划管理人和集合计划托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

#### 十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

本集合计划实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估

值并披露主袋账户的集合计划净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。

## 第十四部分、集合计划的收益与分配

### 一、集合计划利润的构成

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

### 二、集合计划可供分配利润

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

### 三、集合计划收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《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相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

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、由于本集合计划各类集合计划份额收取管理费和业绩报酬的情况不同，各集合计划份额类别对应的可供分配利润将有所不同，同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

### 四、收益分配方案

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

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本集合计划收益分配方案由集合计划管理人拟定，并由集合计划托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上刊登公告。

#### 六、集合计划收益分配中发生的费用

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

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

## 第十五部分、集合计划的费用与税收

### 一、集合计划费用的种类

- 1、集合计划管理人的管理费；
- 2、集合计划托管人的托管费；
- 3、集合计划管理人的业绩报酬；
- 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、审计费用、律师费、诉讼费和仲裁费等；
- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券/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、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。

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、集合计划管理人的管理费

本集合计划 A 类份额的管理费按前一日该类集合计划资产净值的 0.2% 年费率计提。本集合计划 B 类份额的管理费按前一日该类集合计划资产净值的 0.8% 年费率计提。两类份额的管理费计提的计算公式相同，管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{该类份额的年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的该类集合计划资产净值

集合计划管理人的管理费每日计算，管理费计算逐日累计至每季度季末，按季度支付，由集合计划托管人于次季度首日起 5 个工作日内依据集合计划管理人划款指令从本集合计划资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 2、集合计划托管人的托管费

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

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

集合计划托管人的托管费每日计算，托管费计算逐日累计至每季度季末，按季度支付，由集合计划托管人于次季度首日起 5 个工作日内依据集合计划管理人划款指令从本集合计划资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

上述“一、集合计划费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，其中集合计划每个自然年度产生的审计费用按当年天数预提摊销，由集合计划托管人从集合计划财产中支付。

### 三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

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

2、集合计划管理人和集合计划托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；

3、《资产管理合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目。

### 四、实施侧袋机制期间的集合计划费用

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

### 五、集合计划税收

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

## 六、集合计划管理人的业绩报酬

### 1、业绩报酬计提原则

在投资者全部或部分赎回集合计划份额、集合计划终止财产清算完毕时，管理人按投资者每笔份额或计划终止时所持有份额在该期间超过业绩报酬计提标准以上部分计提业绩报酬。

### 2、业绩报酬计算方法、计提比例和提取频率

以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，对于 A 类份额而言，原集合计划推广期参与的为原集合计划成立日，原集合计划存续期参与的为参与当日，对于 B 类份额而言，本集合计划存续期内申购的为申购当日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率作为计提业绩报酬的基准。

业绩报酬计提日为投资者赎回集合计划份额申请日、集合计划终止日。

年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1 - P_0}{P_0^*} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

P1 为该投资者赎回份额或计划终止时持有的份额对应的本次业绩报酬计提日的集合计划份额累计净值；

P0 为该投资者赎回份额或计划终止时持有的份额对应的上一业绩报酬计提日的集合计划份额累计净值；

P0\*为该投资者赎回份额或计划终止时持有的份额对应的上一业绩报酬计提日的集合计划份额净值；

D 为该投资者赎回份额或计划终止时持有的份额对应的上一业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的自然天数；

R 为年化收益率；

管理人业绩报酬计算公式如下：

$$H = \max(R - I, 0) \times D / 365 \times M \times X$$

H 为该投资者每笔赎回份额或计划终止时持有的份额对应的应提取的业绩报酬；

I 为该投资者每笔赎回份额或计划终止时持有的份额对应的管理人业绩报

酬计提标准，A 类份额的计提标准为 4.3%/年，B 类份额的计提标准为 4.0%/年；

M 为该投资者每笔赎回份额或计划终止时持有的份额对应的在上一业绩报酬计提日的集合计划资产净值总额；

X 为管理人业绩报酬提取比例，A 类份额的提取比例为 100%，B 类份额的提取比例为 20%。

托管人对业绩报酬计提金额不进行复核，根据管理人提供的数据进行估值。

### 3、业绩报酬支付

由集合计划管理人向集合计划托管人发送业绩报酬划付指令，集合计划托管人于 5 个工作日内将业绩报酬划拨给登记机构，由登记机构将业绩报酬支付给集合计划管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。



## 第十六部分、集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

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

### 二、集合计划的年度审计

- 1、集合计划管理人聘请与集合计划管理人、集合计划托管人相互独立的符合《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，应事先征得集合计划管理人同意。
- 3、集合计划管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报集合计划托管人。更换会计师事务所需按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

## 第十七部分、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。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本集合计划从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

本集合计划信息披露义务人应当以保护集合计划份额持有人利益为根本出发点，按照法律、行政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。规定网站包括集合计划管理人网站、集合计划托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他集合计划管理人、集合计划托管人或者集合计划销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人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）《资产管理合同》、集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要、集合计划托管协议

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

2、集合计划招募说明书应当最大限度地披露影响集合计划投资者决策的全部事项，说明集合计划申购和赎回安排、集合计划投资、集合计划产品特性、风险揭示、信息披露及集合计划份额持有人服务等内容。《资产管理合同》生效后，集合计划招募说明书的信息发生重大变更的，集合计划管理人应当在3个工作日内，更新集合计划招募说明书并登载在规定网站上；集合计划招募说明书其他信息发生变更的，集合计划管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，集合计划管理人不再更新集合计划招募说明书。

3、集合计划产品资料概要是集合计划招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的集合计划概要信息。《资产管理合同》生效后，集合计划产品资料概要的信息发生重大变更的，集合计划管理人应当在3个工作日内，更新集合计划产品资料概要并登载在规定网站、集合计划销售机构网站或营业网点；集合计划产品资料概要其他信息发生变更的，集合计划管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，集合计划管理人不再更新集合计划产品资料概要。

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

集合计划管理人应及时将集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要、《资产管理合同》和集合计划托管协议登载在规定网站上，其中集合计划产品资料概要还应当登载在集合计划销售机构网站或营业网点；集合计划托管人应当同时将《资产管理合同》、集合计划托管协议登载在规定网站上。

（二）集合计划净值信息

《资产管理合同》生效后，在 A 类份额封闭期内，集合计划管理人应当至少每周在规定网站披露一次 A 类份额的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值；在开始办理 B 类份额申购或者赎回前，集合计划管理人应当至少每周在规定网站披露一次 B 类份额的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

在 A 类份额开放期内，集合计划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营业网点披露开放日 A 类份额的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值；在开始办理 B 类份额申购或者赎回后，集合计划管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、集合计划销售机构网站或营业网点披露开放日 B 类份额的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

集合计划管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在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各类集合计划份额累计净值。

### （三）集合计划份额申购、赎回价格

集合计划管理人应当在《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。

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

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

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

集合计划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。

集合计划运作期间，如报告期内出现单一投资者持有集合计划份额达到或超过集合计划总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，集合计划管理人至少应当在集合计划定期报告“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产品的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

#### （五）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、延长资产管理合同期限；
- 4、转换集合计划运作方式、集合计划合并；
- 5、更换集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划份额登记机构，集合计划改聘会计师事务所；
- 6、集合计划管理人委托集合计划服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，集合计划托管人委托集合计划服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；
- 7、集合计划管理人、集合计划托管人的法定名称、住所发生变更；
- 8、集合计划管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- 9、集合计划管理人的高级管理人员、集合计划投资经理和集合计划托管人专门托管部门负责人发生变动；
- 10、集合计划管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，集合计划管理人、集合计划托管人专门托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

11、涉及集合计划管理业务、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼或仲裁；

12、集合计划管理人或其高级管理人员、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，集合计划托管人或其专门托管部门负责人因集合计划托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

13、集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；

14、集合计划收益分配事项；

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

16、某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；

17、本集合计划开始办理申购、赎回；

18、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；

19、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；

20、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；

21、变更集合计划份额类别的设置或集合计划份额分类规则；

22、本集合计划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；

23、集合计划管理人采用摆动定价机制进行估值；

24、集合计划信息披露义务人认为可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和资产管理合同约定的其他事项。

#### （六）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的，以及

可能损害集合计划份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清。

#### （七）清算报告

《资产管理合同》终止的，集合计划管理人应当依法组织清算组对集合计划财产进行清算并作出清算报告。清算报告应当经过符合《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。清算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。

#### （八）投资资产支持证券相关公告

本集合计划应当在集合计划年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

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

#### （九）投资国债期货的信息披露

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

#### （十）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，详见本招募说明书的有关规定。

#### （十一）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

集合计划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规定。

集合计划托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《资产管理

合同》的约定，对集合计划管理人编制的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购赎回价格、集合计划定期报告、更新的招募说明书、集合计划产品资料概要、集合计划清算报告等相关集合计划信息进行复核、审查，并向集合计划管理人进行书面或者电子确认。

集合计划管理人、集合计划托管人应当在规定的报刊中选择一家报刊披露本集合计划信息。

集合计划管理人、集合计划托管人应当向中国证监会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。

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

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

#### 八、暂停或延迟披露集合计划信息的情形

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

- 1、不可抗力；
- 2、当特定资产占前一估值日集合计划资产净值 50%以上时，经与集合计划托管人协商一致暂停估值的；
- 3、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；
- 4、法律法规、资产管理合同或中国证监会规定的情况。



## 第十八部分、侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

当集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护集合计划份额持有人利益的原则，集合计划管理人经与集合计划托管人协商一致，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。

集合计划管理人应当在启用侧袋机制当日向中国证监会及所在地的中国证监会派出机构备案，并在次日发布临时公告，并在五个工作日内聘请符合《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。

侧袋机制启用后，集合计划管理人应及时向集合计划销售机构提示侧袋机制启用的相关事宜。

### 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，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请；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。集合计划管理人应依法向投资者进行充分披露。

2、实施侧袋机制期间，集合计划管理人不办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，集合计划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、除集合计划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工作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。集合计划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

考虑主袋账户资产。

集合计划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。

集合计划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，集合计划管理人和集合计划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、实施侧袋机制期间的集合计划费用

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

2、与处置侧袋账户资产相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，且不得收取管理费和业绩报酬。

3、因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由集合计划管理人承担。

#### 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，集合计划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，集合计划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，集合计划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，集合计划管理人应参照集合计划清算报告的相关要求，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集合计划管理人应按规定及时发布临时公告。

## 2、集合计划净值信息

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

## 3、定期报告

侧袋机制实施期间，集合计划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。

## 第十九部分、风险揭示

### 一、投资于本集合计划的主要风险

集合计划风险表现为集合计划收益的波动，集合计划管理过程中任何影响集合计划收益的因素都是集合计划风险的来源。作为代理集合计划投资人进行投资的工具，科学严谨的风险管理对于集合计划投资管理成功与否至关重要。因此在集合计划管理过程中，对风险的识别、评估和控制应贯穿集合计划投资管理的全过程。集合计划的风险按来源可以分为市场风险、管理风险、流动性风险、投资策略风险和其他风险。

#### 1、市场风险

金融资产价格受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，资产价格的变化导致集合计划收益水平变化，产生风险。

##### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致市场价格波动，从而影响集合计划收益。

##### （2）利率风险

金融市场利率波动会导致证券市场价格及利息收益的变动，同时直接影响企业的融资成本和利润水平。集合计划投资于债券，收益水平会受到利率变化的影响。

##### （3）通货膨胀风险

由于通货膨胀率提高，集合计划的实际投资价值会因此降低。

##### （4）再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券和回购等利息收入再投资收益的影响。当利率下降时，集合计划从投资的固定收益证券和回购所得的利息收入进行再投资时，将获得比以前少的收益率。

##### （5）法律风险

由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致了集合计划资产损失的风险。

#### 2、管理风险

在集合计划管理运作过程中集合计划管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响集合计划收益水平。因此，本集合计划可能因为集合计划管理人的管理水平、管理手段和管理技术等因素影响集合计划收益水平。

### 3、信用风险

指集合计划在交易过程发生交收违约，或者集合计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或者上市公司信息披露不真实、不完整，都可能导致集合计划资产损失和收益变化。

### 4、流动性风险

(1) 本集合计划A类份额以定期开放的方式运作，即以封闭运作和开放运作相交替循环的方式运作，且资产管理合同生效后，集合计划管理人不办理A类份额的申购业务。本集合计划对于每份B类份额设定一年的最短持有期，B类份额最短持有期内该类份额封闭运作。投资人可在本集合计划开放日办理各类集合计划份额的申购或赎回业务。为切实保护存量集合计划份额持有人的合法权益，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，本集合计划管理人将合理控制集合计划份额持有人集中度，审慎确认申购赎回业务申请，包括但不限于：

① 当接受申购申请对存量集合计划份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，集合计划管理人应当采取设定单个投资者当日申购金额上限或本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。

② 当发生大额申购或赎回情形时，集合计划管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。

③ 当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与集合计划托管人协商确认后，集合计划管理人应当暂停接受集合计划申购申请、赎回申请或延缓支付赎回款项。

#### (2) 本集合计划拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、

短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货、股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。除此之外，本集合计划管理人将根据历史经验和现实条件，制定出现金持有量的上下限计划，在该限制范围内进行现金比例调控或现金与证券的转化。本集合计划管理人会进行标的的分散化投资并结合对各类标的资产的预期流动性合理进行资产配置，以防范流动性风险。

### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

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

2) 部分延期赎回：当集合计划管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，集合计划管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日集合计划总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

3) 在发生巨额赎回时，如发生单个开放日内单个集合计划份额持有人申请赎回的集合计划份额超过前一工作日的集合计划总份额的 10%时，集合计划管理人有权先行对该单个集合计划份额持有人超出前一工作日集合计划总份

10%以上的部分赎回申请实施延期办理，集合计划管理人只接受其集合计划总份额 10%以内（含 10%）部分作为当日有效赎回申请，而对该单个集合计划份额持有人 10%以内（含 10%）的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述“1）全额赎回”或“2）部分延期赎回”条款处理。

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

（4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响  
集合计划管理人经与集合计划托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及资产管理合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下集合计划管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：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、侧袋机制等流动性风险管理工具。

延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项等工具的情形、程序见本招募说明书“第十部分、集合计划份额的申购与赎回”之“九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”和“十、巨额赎回的情形及处理方式”的相关规定。若本集合计划延期办理巨额赎回申请，投资者被延期办理的集合计划份额将面临集合计划份额净值波动的风险并对投资者资金安排形成影响。若本集合计划暂停接受赎回申请，投资者将面临无法赎回本集合计划的风险。若本集合计划延缓支付赎回款项，赎回款到账时间将延后，可能对投资者的资金安排带来不利影响。

本集合计划收取的短期赎回费适用于持续持有 A 类份额少于 7 日的投资者，费率为 1.5%。短期赎回费由上述投资者承担，在赎回 A 类份额时收取，并全额计入集合计划财产。短期赎回费将增加持续持有 A 类份额少于 7 天投资者的投资成本，对其可获取的赎回款项造成不利影响。

暂停集合计划估值适用于特定资产占前一估值日集合计划资产净值 50%以上的情形，届时集合计划管理人与集合计划托管人协商确认后，将暂停集合计划估值，并采取延缓支付赎回款项或暂停接受集合计划申购赎回申请的措施。

若本集合计划暂停集合计划估值，一方面投资者将无法获知该估值日的集合计划份额净值信息；另一方面集合计划将延缓支付赎回款项或暂停接受集合计划的申购赎回申请。延缓支付赎回款项可能影响投资者的资金安排，暂停接受集合计划申购赎回将导致投资者无法申购或者赎回本集合计划。

当本集合计划发生大额申购或赎回情形时，本集合计划管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性，具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则规定。当日参与申购和赎回交易的投资者存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。

#### （5）启用侧袋机制的风险揭示

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

集合计划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，集合计划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，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的集合计划净资产减少进行按投资损失处理，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。

### 5、本集合计划的特定风险



(1) 资产管理合同生效后，原华创银杏低风险套利集合资产管理计划份额变更为本集合计划A类份额。资产管理合同生效后，集合计划管理人不办理A类份额的申购业务。自资产管理合同生效之日起（包括资产管理合同生效之日）或自每一A类份额开放期结束之日次日起（包括该日）3个月的期间为A类份额封闭期，自每个A类份额封闭期结束之后第一个工作日起（包括该日）5个工作日的期间为A类份额开放期。投资者仅可在A类份额开放期内办理A类份额赎回业务。因此A类份额持有人面临在A类份额封闭期内不能赎回A类份额的风险。

本集合计划B类份额为资产管理合同生效后进行申购的份额。资产管理合同生效后，本集合计划对于每份B类份额设定一年的最短持有期，最短持有期内B类份额封闭运作。投资者持有的B类份额自最短持有期到期日的下一个工作日起，方可申请办理B类份额的赎回业务。因此B类份额持有人面临在最短持有期内不能赎回B类份额的风险

(2) 开放日如果出现较大数额的净赎回申请，则使集合计划资产变现困难，集合计划可能面临一定的流动性风险，存在着集合计划份额净值波动的风险。

(3) 本基金可投资于国债期货，国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

#### (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) 投资的股票的风险：

投资股票主要面临系统性和非系统性两大风险。

系统性风险又称市场风险，也称不可分散风险。是指由于某种因素的影响和变化，导致股市上所有股票价格的下跌，从而给股票持有人带来损失的可能性。系统性风险主要是由政治、经济及社会环境等宏观因素造成，投资人无法通过多样化的投资组合来化解的风险。主要有政策风险、利率风险、购买力风险、市场风险。

非系统性风险一般是指对某一个股或某一类股票发生影响的不确定因素。如上市公司的经营管理、财务状况、市场销售、重大投资等因素，它们的变化都会对公司的股价产生影响。此类风险主要影响某一种股票，与市场的其它股票没有直接联系。主要有经营风险、财务风险、信用风险、道德风险等。投资新股还会面临由于公司业绩、市场行情等因素跌破发行价格的风险。如本集合计划参与定向增发等流通受限证券的投资，本计划可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期限内证券价格大幅下跌的风险。

特别的，本计划投资于“科创板”股票，除了以上投资股票标的的共性风险外，还存在如下特定风险：

A、科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。

B、科创板企业可能存在首次公开发行前最近3个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形。

C、科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退出。

D、科创板企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，

市场可比公司较少，传统估值方法可能不适用，发行定价难度较大，科创板股票上市后可能存在股价波动的风险。

E、科创板制度允许上市公司设置表决权差异安排。上市公司可能根据此项安排，存在控制权相对集中，以及因每一特别表决权股份拥有的表决权数量大于每一普通股份拥有的表决权数量等情形，而使普通投资者的表决权及对公司日常经营等事务的影响力受到限制。

F、科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，在上市后的前5个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为20%，有可能产生的股价波动较大的风险。

#### （6）投资策略风险和债券品种配置风险

在集合计划管理人在结合分析宏观、微观分析和市场失衡的特点选择具体的投资策略过程中，可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断偏差，致使本集合计划的业绩表现不一定领先于市场平均水平。

债券品种配置风险是指由于当利率的波动或是债券信用级别的变化导致不同债券品种利差发生变化时，集合计划在配置不同比例的资金购买不同品种的债券而隐含的风险。

### 6、其他风险

#### （1）技术风险

计算机、通讯系统、交易网络等技术保障系统或信息网络支持出现异常情况，可能导致集合计划日常的申购赎回无法按正常时限完成、注册登记系统瘫痪、核算系统无法按正常时限显示产生净值、集合计划的投资交易指令无法及时传输等风险。

（2）战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致集合计划资产的损失。

（3）金融市场危机、行业竞争、代理机构违约、托管行违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或者集合计划份额持有人的利益受损。

### 二、声明

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

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

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

## 第二十部分、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，由集合计划管理人和集合计划托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《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、集合计划管理人、集合计划托管人职责终止，在6个月内没有新集合计划管理人、新集合计划托管人承接的；
- 3、《资产管理合同》约定的其他情形；
- 4、《资产管理合同》期限届满而未延期；
- 5、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，集合计划管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人、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财产；

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、集合计划财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经符合《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集合计划托管人保存，保存时间不低于法律法规规定的最低期限。

## 第二十一部分、资产管理合同的内容摘要

### 一、资产管理合同当事人的权利、义务

#### (一) 集合计划管理人简况

名称：华创证券有限责任公司

住所：贵州省贵阳市中华北路 216 号华创大厦

法定代表人：陶永泽

成立日期：2002 年 1 月 22 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字[2002]6 号

组织形式： 有限责任公司

注册资本：922592.31 万

存续期限：持续经营

联系电话：010-66500950

#### (二) 集合计划管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

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

(3) 依照《资产管理合同》收取集合计划管理费、业绩报酬以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售集合计划份额；

(5) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；

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

(7) 在集合计划托管人更换时，提名新的集合计划托管人；

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

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任集合计划登记机构办理集合计划

登记业务并获得《资产管理合同》规定的费用；

(10) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；

(11) 在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使股东权利，为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为集合计划的利益依法为集合计划进行融资；

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

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

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划管理人的义务包括但不限于：

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

(2) 办理集合计划备案手续；

(3) 履行（或监督本计划销售机构履行）客户身份识别、客户身份以及交易记录保存等法定反洗钱义务；

(4) 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；

(5) 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；

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

(7) 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；

(8) 依法接受集合计划托管人的监督；

(9) 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；

(10) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(11) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(12) 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；

(13) 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。但依法向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

(14) 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；

(15) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

(16) 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集合计划托管人、集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；

(17) 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，保存时间不低于法律法规规定的最低期限；

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

(19) 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；

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

(21) 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；

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

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

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

(25) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(26) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(27) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

### (三) 集合计划托管人简况

名称：中信银行股份有限公司

住所：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼

法定代表人：朱鹤新

成立时间：1987 年 4 月 20 日

批准设立机关和批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14 号组织形式：股份有限公司

注册资本：489.35 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2004]125 号

### (四) 集合计划托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《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》约定获得集合计划托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督集合计划管理人对本集合计划的投资运作，如发现集合计划管理人有违反《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集合计划投资者的利益；

(4) 根据相关市场规则，为集合计划开设证券账户等投资所需账户、为集合计划办理证券、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) 在集合计划管理人更换时，提名新的集合计划管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《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，集合计划托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

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

(4) 除依据《基金法》、《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) 保管由集合计划管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；

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

(7) 保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《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。

但依法向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料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集合计划管理人核对；

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

(15) 托管人发现管理人的投资、清算指令涉嫌洗钱的，应按照《中华人民共和国反洗钱法》和反洗钱相关规定履行报告义务；

(16) 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集合计划管理人、集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；

(17) 按照法律法规和《资产管理合同》的规定监督集合计划管理人的投资运作；

(18) 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和银行保险监督管理机构，并通知集合计划管理人；

(20) 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；

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

(22) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(23) 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

集合计划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，集合计划投资者自依据《资产管理合同》取得的集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《资产管理合同》的当事人，直至其不再持有本集合计划的集合计划份额。集合计划份额持有人作为《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) 监督集合计划管理人的投资运作；

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

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《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》；

(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) 向管理人或本计划销售机构提供有关身份信息、投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构；

(5) 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；

(6) 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；

(7) 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；

(8) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(9) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(10) 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

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

本集合计划份额持有人大会不设日常机构。

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，除法律法规、资产管理合同或中国证监会另有规定外，应当召开集合计划份额持有人大会：

(1) 终止《资产管理合同》；

(2) 更换集合计划管理人（集合计划管理人更换为本集合计划管理人全资子公司或控股子公司的除外）；

(3) 更换集合计划托管人；

(4) 转换集合计划运作方式；

(5) 调整集合计划管理人、集合计划托管人的报酬标准；

(6) 变更集合计划类别；

(7) 本集合计划与其他集合计划的合并；

(8) 变更集合计划投资目标、范围或策略；

(9) 变更集合计划份额持有人大会程序；

(10) 集合计划管理人或集合计划托管人要求召开集合计划份额持有人大会；

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

(12) 对资产管理合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

(1) 法律法规要求增加的集合计划费用的收取；

(2) 在法律法规和《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；

(3) 在法律法规和资产管理合同规定的范围内，在不提高现有集合计划份额持有人适用的费率的前提下，设立新的集合计划份额类别，增加新的收费方式等；

(4) 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；

(5) 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；

(6) 因法规政策调整而需要修订业绩报酬相关基准比例的；

(7) 集合计划推出新业务或服务；

(8) 集合计划管理人、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；

(9) 集合计划管理人更换为本集合计划管理人全资子公司或控股子公司；

(10) 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

大会由集合计划管理人召集；

2、集合计划管理人未按规定召集或不能召开时，由集合计划托管人召集；

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

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

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

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

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

（三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开集合计划份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定



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

#### (四) 集合计划份额持有人出席会议的方式

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

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

- (1) 亲自出席会议者持有集合计划份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有集合计划份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法

规、《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集合计划管理人持有的登记资料相符；

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

2、通讯开会。通讯开会系指集合计划份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或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集合计划托管人（如果集合计划托管人为召集人，则为集合计划管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在集合计划托管人（如果集合计划托管人为召集人，则为集合计划管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取集合计划份额持有人的书面表决意见；集合计划托管人或集合计划管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

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

合计划份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的集合计划份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有集合计划份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有集合计划份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《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、在不违反法律法规和监管机关的规定下，本集合计划的集合计划份额持有人亦可采用其他方式授权其代理人出席集合计划份额持有人大会，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明；在会议召开方式上，本集合计划亦可采用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集合计划份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。集合计划份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

#### (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》、更换集合计划管理人、更换集合计划托管人、与其他集合计划合并、法律法规及《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。大会主持人为集合计划管理人授权出席会议的代表，在集合计划管理人授权代表未能主持大会的情况下，由集合计划托管人授权其出席会议的代表

主持；如果集合计划管理人授权代表和集合计划托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的集合计划份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名集合计划份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人。集合计划管理人和集合计划托管人拒不出席或主持集合计划份额持有人大会，不影响集合计划份额持有人大会作出的决议的效力。

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

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律法规、资产管理合同或中国证监会另有规定外，转换集合计划运作方式、更换集合计划管理人或者集合计划托管人、终止《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) 如大会由集合计划管理人或集合计划托管人召集，集合计划份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的集合计划份额持有人和代理人中选举两名集合计划份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由集合计划份额持有人自行召集或大会虽然由集合计划管理人或集合计划托管人召集，但是集合计划管理人或集合计划托管人未出席大会的，集合计划份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的集合计划份额持有人中选举三名集合计划份额持有人代表担任监票人。集合计划管理人或集合计划托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

##### 2、通讯开会

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

#### (八) 生效与公告

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

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

集合计划份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。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。

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

(九) 实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

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

6、一般决议须经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的

二分之一以上（含二分之一）通过；

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

同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。

（十）本部分关于集合计划份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，集合计划管理人经与集合计划托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

### 三、资产管理合同的解除和终止的事由、程序

#### （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，由集合计划管理人和集合计划托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《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、集合计划管理人、集合计划托管人职责终止，在 6 个月内没有新集合计划管理人、新集合计划托管人承接的；
- 3、《资产管理合同》约定的其他情形；
- 4、《资产管理合同》期限届满而未延期；
- 5、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，集合计划管理人组织集合计划财产清算小组并在中

中国证监会的监督下进行集合计划清算。

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人、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财产；

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

(四) 清算费用

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

(五) 集合计划财产清算剩余资产的分配

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

(六) 集合计划财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经符合《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集合计划托管人保存，保存时间不低于法律法规规定的最低期限。

#### 四、争议解决方式

各方当事人同意，因《资产管理合同》而产生的或与《资产管理合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交托管人所在地有管辖权的人民法院解决。除判决另有规定外，诉讼费和律师费由败诉方承担。

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》受中国法律管辖并从其解释。

#### 五、资产管理合同存放地和投资者取得资产管理合同的方式

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

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

## 第二十二部分、集合计划托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）集合计划管理人

名称：华创证券有限责任公司

住所：贵州省贵阳市中华北路 216 号华创大厦

法定代表人：陶永泽

设立日期：2002 年 1 月 22 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监机构字[2002]6 号

组织形式： 有限责任公司

注册资本：922592.31 万

存续期限：持续经营

联系电话：010-66500950

经营范围：法律、法规、国务院决定规定禁止的不得经营；法律、法规、国务院决定规定应当许可（审批）的，经审批机关批准后凭许可（审批）文件经营；法律、法规、国务院决定规定无需许可（审批）的，市场主体自主选择经营。（证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；证券投资集合计划销售业务；为期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品业务。）

#### （二）集合计划托管人

名称：中信银行股份有限公司

住所：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼

法定代表人：朱鹤新

成立时间：1987 年 4 月 20 日

批准设立文号：中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2004]125 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：489.35 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：保险兼业代理业务；吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行保险监督管理委员会批准的其他业务。（企业依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

## 二、集合计划托管人对集合计划管理人的业务监督和核查

### （一）集合计划托管人对集合计划管理人的投资行为行使监督权

1. 集合计划托管人根据有关法律法规的规定和资产管理合同的约定，对下述集合计划投资范围、投资对象进行监督。本集合计划将投资于以下金融工具：

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货、股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，本集合计划投资于股票资产的比例不超过集合计划资产的 20%。

每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

2. 集合计划托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同的约定对下述

集合计划投资比例进行监督：

(1) 本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，本集合计划投资于股票资产的比例不超过集合计划资产的 20%；

(2) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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、存出保证金和应收申购款等；

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

(4) 管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家公司的证券，不超过该证券的 10%；

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

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

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

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

(9) 本集合计划应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(10) 本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%；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；

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

(12) 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；

(13) 本集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的 140%；

(14) 本集合计划投资于信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于 AA（含），其中本集合计划投资于 AAA 信用评级的信用债的比例不低于集合计划资产净值的 50%；本集合计划投资于 AA+信用评级的信用债的比例不超过集合计划资产净值的 50%；本集合计划投资于 AA 信用评级的信用债的比例不超过集合计划资产净值的 20%；信用评级参照评级机构（中债资信除外）评定的最新债项评级，无债项评级的参照主体评级；

(15) 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；

(16) 集合计划管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合计划持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；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；

(17) 本集合计划参与国债期货交易，应当遵守下列要求：

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

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

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

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

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

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（11）、（12）情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等集合计划管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，集合计划管理人应当在 10 个交易日内进行调整，法律法规另有规定的，从其规定。

集合计划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。集合计划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，第（4）（5）（8）（12）（16）项由管理人自行监督。

如果法律法规对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。如法律法规或监管部门取消上述限制，且适用于本集合计划，则集合计划管理人在履行适当程序后，不需要经集合计划份额持有人大会审议，本集合计划投资不再受相关限制。如本集合计划增加投资品种，投资限制以法律法规和中国证监会的规定为准。

3. 集合计划托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同的约定对下述集合计划投资禁止行为进行监督：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他集合计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其集合计划管理人、集合计划托管人出资；
- （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。

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

4. 集合计划托管人依据有关法律法规的规定和资产管理合同的约定对于集合计划关联投资进行监督。

集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到集合计划托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交集合计划管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。集合计划管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

根据法律法规有关集合计划从事的关联交易的规定，集合计划管理人和集合计划托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供名单的真实性、完整性、全面性。集合计划管理人或集合计划托管人在名单变更后应及时发送对方，收到方于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。名单变更时间以收到方回函确认的时间为准。如果集合计划托管人在运作中严格遵循了监督流程，集合计划管理人仍违规进行交易，并造成集合计划资产损失的，由集合计划管理人承担责任，集合计划托管人不承担任何损失和责任。

相关交易必须事先得到集合计划托管人的同意，若集合计划托管人发现集合计划管理人与关联方进行违反法律法规规定的关联交易时，集合计划托管人应及时提醒并协助集合计划管理人采取必要措施阻止该交易的发生，若集合计划托管人采取必要措施后仍无法阻止该交易发生时，集合计划托管人有权向中国证监会报告，由此造成的损失和责任由集合计划管理人承担。对于交易所场内已成交的违规交易，集合计划托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告，集合计划托管人不承担由此造成的损失和责任。

5. 集合计划托管人依据有关法律法规的规定和资产管理合同的约定对集合计划管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 集合计划托管人依据有关法律法规的规定和资产管理合同的约定对于集合计划管理人参与银行间债券市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

集合计划管理人应在集合计划投资运作之前向集合计划托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间债券市场交易对手的名单。集合计划托管人在收到名单后 2 个工作日内回函确认收到该名单。集合计划管理人应定期或不定期对银行间债券市场现券及回购交易对手的名单进行更新，名单中增加或减少银行间债券市场交易对手时须及时通知集合计划托管人，集合计划托管人于 2 个工作日内回函确认收到后，对名单进行更新。集合计划管理人收到集合计划托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照双方原定协议进行结算。

如果集合计划托管人发现集合计划管理人与不在名单内的银行间债券市场交易对手进行交易，应及时提醒集合计划管理人撤销交易，经提醒后集合计划管理人仍执行交易并造成集合计划资产损失的，集合计划托管人不承担责任。

(2) 集合计划管理人有责任控制交易对手的资信风险，按银行间债券市场的交易规则进行交易。集合计划托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如集合计划托管人事后发现集合计划管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，集合计划托管人应及时提醒集合计划管理人，集合计划托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

6. 集合计划托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同的约定，对集合计划管理人选择存款银行进行监督。

集合计划投资银行定期存款的，集合计划管理人应根据法律法规的规定及资产管理合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给集合计划托管人，集合计划托管人应据以对集合计划投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本集合计划投资银行存款应符合如下规定：

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

(2) 集合计划托管人应加强对集合计划银行存款业务的监督与核查，严格



审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

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

集合计划托管人对集合计划管理人选择存款银行的监督应依据集合计划管理人向集合计划托管人提供的符合条件的存款银行的名单执行，如集合计划托管人发现集合计划管理人将集合计划资产投资于该名单之外的存款银行，有权拒绝执行。该名单如有变更，集合计划管理人应在启用新名单前提前及时将新名单发送给集合计划托管人。

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

(三) 集合计划托管人发现集合计划管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、资产管理合同、本托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知集合计划管理人限期纠正，集合计划管理人收到书面通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向集合计划托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，集合计划托管人有权随时对通知事项进行复查，督促集合计划管理人改正。集合计划管理人对集合计划托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，集合计划托管人应报告中国证监会。

集合计划托管人发现集合计划管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知集合计划管理人。

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

集合计划管理人应积极配合和协助集合计划托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复集合计划托管人并改正，就集合计划托管人的合理疑义进行解

释或举证，对集合计划托管人按照法规要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的，集合计划管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

集合计划托管人发现集合计划管理人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知集合计划管理人限期纠正。

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

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

（四）集合计划托管人应当依照法律法规和资产管理合同约定，对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行复核和监督。

### 三、集合计划管理人对集合计划托管人的业务核查

集合计划管理人对集合计划托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于集合计划托管人安全保管集合计划财产、开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、复核集合计划管理人计算的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值、根据集合计划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。

集合计划管理人发现集合计划托管人擅自挪用集合计划财产、未对集合计划财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行集合计划管理人资金划拨指令、泄露集合计划投资信息等违反《基金法》、资产管理合同、本托管协议及其他有关规定时，集合计划管理人应及时以书面形式通知集合计划托管人限期纠正，集合计划托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向集合计划管理人发出回函。在限期内，集合计划管理人有权随时对通知事项进行复查，督促集合计划托管人改正，并予以协助配合。集合计划托管人对集合计划管理人通知的违规事项未能在限期内纠正或未在合理期限内确认的，集合计划管理人应报告

中国证监会。集合计划管理人有权要求集合计划托管人赔偿集合计划、集合计划管理人因此所遭受的损失。

集合计划管理人发现集合计划托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行保险监督管理机构，同时通知集合计划托管人限期纠正。

集合计划托管人应积极配合集合计划管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供集合计划管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复集合计划管理人并改正。

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

#### 四、集合计划财产保管

##### （一）集合计划财产保管的原则

1. 集合计划财产应独立于集合计划管理人、集合计划托管人的固有财产。
2. 集合计划托管人应安全保管集合计划财产。除依据法律法规规定、资产管理合同和本托管协议约定及集合计划管理人的正当指令外，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何财产。
3. 集合计划托管人按照规定开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。
4. 集合计划托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，与集合计划托管人的其他业务和其他集合计划或基金的托管业务实行严格的分账管理，确保集合计划财产的完整与独立。
5. 集合计划托管人根据集合计划管理人的指令，按照资产管理合同和本协议的约定保管集合计划财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
6. 除依据法律法规和资产管理合同的规定外，集合计划托管人不得委托第三人托管集合计划资产。

##### （二）集合计划的银行账户的开立和管理

1. 集合计划托管人以本集合计划的名义在其营业机构开立集合计划的银行账户，并根据集合计划管理人合法合规的指令办理资金收付。本集合计划实行

无印鉴管理。

2. 集合计划银行账户的开立和使用, 限于满足开展本集合计划业务的需要。集合计划托管人和集合计划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; 亦不得使用本集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

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

### (三) 集合计划证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

集合计划托管人以集合计划托管人和本集合计划联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

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

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

### (四) 债券托管账户的开立和管理

1. 资产管理合同生效后, 集合计划管理人负责以本集合计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格, 并代表本集合计划进行交易; 集合计划托管人负责以本集合计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户, 并由集合计划托管人负责本集合计划的债券的后台匹配及资金的清算。

2. 集合计划管理人和集合计划托管人应一起负责为本集合计划对外签订全国银行间国债市场回购主协议, 正本由集合计划托管人保管, 集合计划管理人保存副本。

### (五) 其他账户的开设和管理

在本托管协议生效之后, 本集合计划被允许从事符合法律法规规定和资产管理合同约定的其他投资品种的投资业务时, 如果涉及相关账户的开设和使用, 由集合计划管理人协助集合计划托管人根据有关法律法规的规定和资产管理合同的约定, 开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。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。

（六）集合计划财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

集合计划财产投资的有关实物证券由集合计划托管人存放于集合计划托管人的保管库；其中实物证券也可存入中央国债登记结算有限责任公司或银行间市场清算所股份有限公司或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。实物证券的购买和转让，由集合计划托管人根据集合计划管理人的指令办理。属于集合计划托管人控制下的实物证券在集合计划托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由集合计划托管人承担。集合计划托管人对集合计划托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任，但应勤勉履行定期查询等合理注意义务。

（七）与集合计划财产有关的重大合同的保管

与集合计划财产有关的重大合同的签署，由集合计划管理人负责。由集合计划管理人代表本集合计划签署的与本集合计划有关的重大合同的原件分别应由集合计划托管人、集合计划管理人保管。集合计划管理人在代表本集合计划签署与本集合计划有关的重大合同时，应尽可能保证集合计划一方持有两份以上的正本原件，以便集合计划管理人和集合计划托管人至少各持有一份正本的原件。集合计划管理人在合同签署后 30 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同送达集合计划托管人处。合同应存放于集合计划管理人和集合计划托管人各自文件保管部门，保存时间不低于法律法规规定的最低期限。对于无法取得二份以上的正本的，集合计划管理人应向集合计划托管人提供加盖公章业务章的合同复印件或传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移，由集合计划管理人保管。

## 五、集合计划资产净值计算和会计核算

（一）集合计划资产净值的计算、复核的时间和程序

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。某一类别集合计划份额净值是指每个工作日闭市后，某一类别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。各类集合计划份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。

集合计划管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制，具体可参见相关公告。国家另有规定的，从其规定。

集合计划管理人应每个工作日对集合计划资产估值，但集合计划管理人根据法律法规或资产管理合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合资产管理合同及相关法律、法规的规定。集合计划资产净值和各类集合计划份额净值由集合计划管理人负责计算，集合计划托管人复核。集合计划管理人应于每个工作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以双方认可的方式发送给集合计划托管人。集合计划托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给集合计划管理人，由集合计划管理人依据资产管理合同和相关法律法规的规定对集合计划净值予以公布。月末、年中和年末估值复核与集合计划会计账目的核对同时进行。

根据《基金法》，集合计划管理人计算并公告集合计划资产净值，集合计划托管人复核、审查集合计划管理人计算的集合计划资产净值。因此，本集合计划的会计责任方是集合计划管理人，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照集合计划管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布，集合计划托管人对此不承担责任。

## （二）集合计划资产估值方法

### 1. 估值对象

集合计划所拥有的股票、债券、国债期货和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。

### 2. 估值原则

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

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

确定公允价值。

与上述投资品种相同，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，集合计划管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

### 3. 估值方法

#### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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，确定公允价值；

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

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

4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

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

6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情

况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）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、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) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

(6) 本集合计划可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。

(7) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，



集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

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

如集合计划管理人或集合计划托管人发现集合计划估值违反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集合计划管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由集合计划管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照集合计划管理人对集合计划净值的计算结果对外予以公布，集合计划托管人对此不承担责任。

### (三) 估值错误处理

集合计划管理人和集合计划托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当某一类别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，视为该类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，如果由于集合计划管理人或集合计划托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该估值错误遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

#### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承

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

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

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

(4)估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

(1)集合计划份额净值计算出现错误时，集合计划管理人应当立即予以纠

正，通报集合计划托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

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

集合计划管理人和集合计划托管人在资产管理合同生效后，应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本集合计划的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证集合计划资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以集合计划管理人的处理方法为准。

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

(五) 集合计划定期报告的编制和复核

集合计划财务报表由集合计划管理人和集合计划托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

在资产管理合同生效后，集合计划招募说明书的信息发生重大变更的，集合计划管理人应当在三个工作日内，更新集合计划招募说明书并登载在规定网站上；集合计划招募说明书其他信息发生变更的，集合计划管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，集合计划管理人不再更新集合计划招募说明书。集合计划管理人在季度结束之日起 15 个工作日内完成季度报告编制并公告；在上半年结束之日起两个月内完成中期报告编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成年度报告编制并公告。

集合计划管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供集合计划托管人复核；集合计划托管人应当在收到报告之日起 2 个工作日内完成月度报表的复核；在收到报告之日起 7 个工作日内完成集合计划季度报告的复核；在收到报告之

日起 20 日内完成集合计划中期报告的复核；在收到报告之日起 30 日内完成集合计划年度报告的复核。集合计划托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，集合计划管理人和集合计划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。

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

集合计划托管人在对月度报表、季度、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

#### （六）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、因不可抗力或其他情形致使集合计划管理人、集合计划托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4、法律法规、中国证监会规定和资产管理合同认定的其它情形。

#### （七）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。

### 六、集合计划份额持有人名册的保管

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

集合计划份额持有人名册由集合计划的登记机构根据集合计划管理人的指令编制和保管，集合计划管理人和集合计划托管人应按照目前相关规则分别保管集合计划份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限不低于法律法规规定的最低期限。

集合计划管理人应当及时向集合计划托管人定期或不定期提交下列日期的集合计划份额持有人名册。集合计划份额持有人名册的内容必须包括集合计划

份额持有人的名称和持有的集合计划份额。集合计划托管人可以采用电子或文档的形式妥善保管集合计划份额持有人名册，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。集合计划托管人不得将所保管的集合计划份额持有人名册用于集合计划托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

若集合计划管理人或集合计划托管人由于自身原因无法妥善保管集合计划份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、集合计划协议的变更、终止与集合计划财产的清算

### （一）托管协议的变更与终止

#### 1. 托管协议的变更程序

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

#### 2. 托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）资产管理合同终止；
- （2）集合计划托管人解散、依法被撤销、破产或由其他集合计划托管人接管集合计划资产；
- （3）集合计划管理人解散、依法被撤销、破产或由其他集合计划管理人接管集合计划管理权；
- （4）发生法律法规或资产管理合同规定的终止事项。

### （二）集合计划财产的清算

#### 1、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，集合计划管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。

（2）集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人、符合《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财产；

②对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

③对集合计划财产进行估值和变现；

④制作清算报告；

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

⑥将清算报告报中国证监会备案并公告；

⑦对集合计划剩余财产进行分配。

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

### 3. 清算费用

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

### 4. 集合计划财产清算剩余资产的分配

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

### 5. 集合计划财产清算的公告

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

### 6. 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由集合计划托管人保存，保存时间不低于法律法规规定的最低期限。

#### 八、争议解决方式

因本托管协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商不能解决的，任何一方均有权将争议提交托管人所在地有管辖权的人民法院解决。除判决另有规定外，诉讼费和律师费由败诉方承担。

争议处理期间，集合计划管理人、集合计划托管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和托管协议约定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

本托管协议受中国（为本托管协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区）法律管辖并从其解释。

## 第二十三部分、对集合计划份额持有人的服务

对集合计划份额持有人的服务主要由集合计划管理人和代销机构提供。集合计划管理人为集合计划份额持有人提供以下一系列的服务。集合计划管理人有权根据集合计划份额持有人的需要、市场状况以及管理人服务能力的变化，增加、修改服务项目：

### 一、电话服务

客户服务中心自动语音系统提供每周七天、每天 24 小时的自动语音服务和查询服务，客户可以通过电话查询集合计划份额净值和集合计划份额持有人账户信息查询。同时，客服中心提供工作日每天 8:30-17:00 的电话人工服务。

华创证券有限责任公司客户服务热线：**【95513】**（免长途话费）

### 二、在线服务

通过集合计划管理人网站，投资者可以获得如下服务：

1、在线客服。投资者可点击集合计划管理人网站“在线客服”，进行咨询或留言。

2、资讯服务。投资者可通过集合计划管理人网站获取集合计划和集合计划管理人各类信息，包括集合计划法律文件、集合计划管理人最新动态、热点问题等。

华创证券有限责任公司网址：**【www.hczq.com】**

### 三、投诉建议受理

如果集合计划份额持有人对集合计划管理人提供的各项服务有疑问，可通过语音留言、传真、Email、网站信箱、手机短信等方式随时向集合计划管理人提出，也可直接与客户服务人员联系，集合计划管理人将采用限期处理、分级管理的原则，及时处理客户的投诉；同时，集合计划份额持有人的合理建议是集合计划管理人发展的动力与方向。



## 第二十四部分、招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在集合计划管理人的办公场所，投资者可在办公时间免费查阅；投资人可按工本费购买复印件，但应以正本为准。

投资者还可以直接登录集合计划管理人的网站（【[www.hczq.com](http://www.hczq.com)】）查阅和下载招募说明书。

## 第二十五部分、备查文件

(一) 中国证监会关于准予华创银杏低风险套利集合资产管理计划变更为华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划的文件

(二) 《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》

(三) 《华创证券创享一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议》

(四) 法律意见书

(五) 集合计划管理人业务资格批件和营业执照

(六) 集合计划托管人业务资格批件和营业执照

(七) 中国证监会规定的其他文件

以上第(六)项备查文件存放在集合计划托管人的办公场所,其他文件存放在集合计划管理人的办公场所。集合计划投资者在营业时间内可免费查阅,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。

华创证券有限责任公司

2023年 月 日