

华安证券睿赢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：华安证券股份有限公司

集合计划托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

2023年7月

## 目录

重要提示.....	1
第一部分 绪言.....	3
第二部分 释义.....	4
第三部分 集合计划管理人.....	9
第四部分 集合计划托管人.....	25
第五部分 相关服务机构.....	31
第六部分 集合计划的历史沿革.....	37
第七部分 集合计划合同的存续.....	38
第八部分 集合计划份额的申购和赎回.....	39
第九部分 集合计划的投资.....	52
第十部分 集合计划的业绩.....	65
第十一部分 集合计划的财产.....	66
第十二部分 集合计划资产估值.....	67
第十三部分 集合计划的收益与分配.....	74
第十四部分 集合计划的费用与税收.....	76
第十五部分 集合计划的会计与审计.....	80
第十六部分 集合计划的信息披露.....	81
第十七部分 侧袋机制.....	88
第十八部分 风险揭示.....	90
第十九部分 集合计划合同的变更、终止和集合计划财产的清算.....	95
第二十部分 集合计划合同的内容摘要.....	97
第二十一部分 集合计划托管协议的内容摘要.....	116
第二十二部分 集合计划份额持有人服务.....	155
第二十三部分 其他应披露事项.....	157
第二十四部分 招募说明书存放及其查阅方式.....	159
第二十五部分 备查文件.....	160

## 重要提示

华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划由华安理财1号稳定收益集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。原集合计划为限定性集合资产管理计划，于2010年2月8日获得中国证监会《关于核准华安证券有限责任公司设立华安理财1号稳定收益集合资产管理计划的批复》（证监许可【2010】181号），自2010年5月10日起开始推广，并于2010年6月10日结束，于2010年6月23日成立。

自《华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划合同》生效日起，《华安理财1号稳定收益集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

集合计划管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本集合计划募集的注册，并不表明其对本集合计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。

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，投资人在投资本集合计划前，应全面了解本集合计划的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并承担集合计划投资中出现的各类风险，包括：市场风险、管理风险、流动性风险（包括但不限于特定投资标的流动性较差风险、巨额赎回风险、启用摆动定价机制或侧袋机制等流动性风险管理工具带来的风险等）、集合计划管理人在集合计划管理实施过程中产生的集合计划管理风险等，本集合计划的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。投资有风险，投资人认购（或申购）集合计划时应认真阅读本集合计划的招募说明书及《集合计划合同》。

本集合计划A类计划份额只开放赎回，不开放申购。

本集合计划B类计划份额每个开放日开放申购，但本集合计划对集合计划份额持有人持有的B类计划份额均设置一年的最短持有期限。在最短持有期限内，B类计划份额不能赎回；在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），B类计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。

由于本集合计划A类和B类计划份额的费用收取方式存在不同，各集合计划份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权。

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资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书（更新）所载有关财务数据和净值表现截止日为 2023 年 3 月 31 日。

## 第一部分 绪言

本集合计划按照中国法律法规成立并运作，若集合计划合同、招募说明书的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

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》）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称《销售办法》）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（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》以及《华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划合同》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。本集合计划是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本集合计划管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本集合计划的合同编写，并经中国证监会备案。集合计划合同是约定集合计划当事人之间权利、义务的法律文件。集合计划投资人自依集合计划合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人，其持有集合计划份额的行为本身即表明其对集合计划合同的承认和接受，并按照《基金法》、集合计划合同及其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，应详细查阅集合计划合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合计划或本集合计划：指华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划

2、集合计划管理人：指华安证券股份有限公司

3、集合计划托管人：指上海浦东发展银行股份有限公司

4、集合计划合同或资产管理合同：指《华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划合同》及对本集合计划合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指集合计划管理人与集合计划托管人就本集合计划签订之《华安证券睿赢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《华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》及其定期的更新

7、产品资料概要：指《华安证券睿赢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、集合计划份额发售公告：指《华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划集合计划份额发售公告》

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集合计划合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

10、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订、自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《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 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1

日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

17、集合计划合同当事人：指受集合计划合同约定，根据集合计划合同享有权利并承担义务的法律主体，包括集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划份额持有人

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定可以投资于在中国境内证券市场的中国境外的机构投资者

21、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》（包括其不时修订）及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

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

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

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

管及定期定额投资等业务。

25、销售机构：指华安证券股份有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得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

26、登记业务：指集合计划登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人集合计划账户的建立和管理、集合计划份额登记、集合计划销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管集合计划份额持有人名册和办理非交易过户等

27、登记机构：指办理登记业务的机构。集合计划的登记机构为华安证券股份有限公司或接受华安证券股份有限公司委托代为办理登记业务的机构

28、集合计划账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、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

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

30、集合计划合同生效日：指《华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划合同》的生效日，原《华安理财 1 号稳定收益集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

31、集合计划合同终止日：指集合计划合同规定的集合计划合同终止事由出现后，集合计划财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

32、存续期：指集合计划合同生效至终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

35、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)，n 为自然数

36、开放日：指为投资人办理集合计划份额申购、赎回或其他业务的工作日

37、开放时间：指开放日集合计划接受申购、赎回或其他交易的时间段

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

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



40、赎回：指集合计划合同生效后，集合计划份额持有人按集合计划合同规定的条件要求将集合计划份额兑换为现金的行为

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

42、转托管：指集合计划份额持有人在本集合计划的不同销售机构之间实施的变更所持集合计划份额销售机构的操作

43、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集合计划申购申请的一种投资方式

44、巨额赎回：指本集合计划单个开放日，集合计划净赎回申请(赎回申请份额总数加上集合计划转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及集合计划转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日集合计划总份额的10%

45、元：指人民币元

46、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。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定

47、摆动定价机制：指当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，确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

48、集合计划收益：指集合计划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

49、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

50、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

51、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

52、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

53、A类计划份额：（或称“A类份额”）指对于投资者依据原《华安理财1号稳定收益集合资产管理计划》参与集合计划获得的集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划A类计划份额。在本集合计划存续期间，A类计划份额只开放赎回，不开放申购

54、B类计划份额：（或称“B类份额”）指依据本合同，在投资者申购时不收取申购费用，也不计提销售服务费的份额

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

56、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的媒介

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

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

59、不可抗力：指集合计划合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

### 第三部分 集合计划管理人

#### 一、集合计划管理人概况

名称：华安证券股份有限公司

住所及办公地址：安徽省合肥市政务区天鹅湖路 198 号

成立时间：2001 年 1 月 8 日

法定代表人：章宏韬

注册资本：4,697,653,638.00 元

电话：0551-65980158

传真：0551-65161861

联系人：秦磁

公司的前身是安徽省证券公司。2016 年 12 月 6 日，经中国证监会《关于核准华安证券股份有限公司首次公开发行股票批复》（证监许可〔2016〕2630 号）批准公司首次公开发行股票 80000 万股并在上海证券交易所上市，发行完成后，公司总股本由 28.21 亿股增加至 36.21 亿股。公司于 2017 年 1 月 4 日完成工商变更登记手续，注册资本变更为 36.21 亿元。公司于 2021 年 6 月进行了配股，之后注册资本增加为 4,697,653,638 元。

股权结构：华安证券股份有限公司为 A 股上市公司，截止 2022 年 12 月 31 日，公司前十大股东股权结构如下表所示：

股东名称	股份数量（股）	占股份总数的比例
安徽省国有资本运营控股集团有限公司	1,131,727,143	24.09%
安徽出版集团有限责任公司	579,973,297	12.34%
东方国际创业股份有限公司	231,541,527	4.93%
安徽省皖能股份有限公司	213,023,389	4.53%
安徽交控资本投资管理有限公司	175,666,812	3.74%
安徽古井集团有限责任公司	130,000,000	2.77%
安徽省能源集团有限公司	125,476,294	2.67%
浙江东方金融控股集团股份有限公司	93,600,000	1.99%
中国建设银行股份有限公司—国泰中证	57,847,307	1.23%

全指证券公司交易型开放式指数证券投资 基金		
中国银河证券股份有限公司	51,026,900	1.09%

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员

章宏韬，中国国籍，无永久境外居留权，大学本科学历，工商管理硕士，经济师。历任安徽省农村经济管理干部学院政治处职员，安徽省农村经济委员会调查研究处秘书、副科秘书，安徽证券交易中心综合部（办公室）经理助理、副经理（副主任），安徽省证券公司合肥蒙城路营业部总经理，公司办公室副主任、总裁助理兼办公室主任、副总裁、公司董事、总裁。现任公司党委书记、董事长，兼任中国证券业协会理事、投资者服务与保护委员会副主任委员，上海证券交易所市场交易管理委员会副主任委员，安徽上市公司协会副会长，安徽省金融学会副会长。

陈蓓，中国国籍，无永久境外居留权，大学本科。历任安徽省体委文史办公室工作人员、副主任科员，安徽省直团工委组织部副部长、部长，安徽团省委组织部干部科科长，团省委学校部、组织部、联络部副部长、部长，安徽省纪委信访室正处级干部、省委巡视办副主任、省纪委机关党委专职副书记、纪检监察干部监督室主任，公司党委委员、纪委书记。现任公司党委副书记、董事、工会主席，兼任华安金控董事。

徐义明，中国国籍，无永久境外居留权，大学本科。历任安徽省公路桥梁工程公司机械处出纳、会计、主办会计、财务科长、副总会计师、总会计师、副总经理，安徽省交通投资集团公司财务部副部长、部长，安徽皖通高速公路股份有限公司党委委员、副总经理。现任安徽交控资本投资管理有限公司党委书记、董事长，兼任华安证券董事、安徽交控金石私募基金管理有限公司董事、安徽安益通股权投资管理有限公司董事长、安徽高速融资租赁有限公司董事长、安徽交控招商私募基金管理有限公司董事、安徽省交控建设管理有限公司董事、安徽交控商业保理有限公司董事长。

舒根荣，中国国籍，无永久境外居留权，研究生学历，经济师。历任安徽省

能源集团有限公司战略策划部主管、金融管理部主管、主管、副主任。现任安徽省皖能资本投资有限公司副总经理，兼任华安证券董事，安徽安元创新风险投资基金有限公司董事。

李捷，中国国籍，无永久境外居留权，研究生学历，硕士学位，高级工程师。历任上海纺织（集团）有限公司党委工作部部长、新闻中心主任，上海纺织装饰有限公司执行董事、总经理、党委副书记、党委书记等职务。现任东方国际创业股份有限公司党委副书记、董事、总经理，兼任华安证券董事，上海纺织装饰有限公司执行董事、总经理，上海纺织进出口有限公司执行董事、总经理，上海飞船进出口有限公司执行董事，上海东松医疗科技股份有限公司董事，上海纺织集团（兰溪）进出口有限公司董事、经理，东方翌睿（上海）投资管理有限公司董事。

胡凌飞，中国国籍，无永久境外居留权，大学本科学历，管理学学士。历任无锡市翠竹房地产开发有限公司总经理助理，安徽科学技术出版社教材开发部业务主办，华晟投资管理有限责任公司投资部副主任，安徽出版集团经营发展部主任助理，安徽华文创业投资管理有限公司总经理助理。现任安徽华文创业投资管理有限公司副总经理，兼任华安证券董事，安徽省安泰科技股份有限公司董事、安徽安华创新风险投资基金有限公司董事、安徽国元互联网金融信息服务股份有限公司董事。

龚胜昔，中国国籍，无永久境外居留权，工商管理硕士，正高级会计师。历任合肥市茶叶公司财务科会计，合肥市供销工业品公司财务会计科会计，安徽中华会计师事务所项目经理，安徽华普会计师事务所审计三部经理，公司计划财务部总经理助理、副总经理、总经理，公司财务总监兼计划财务部总经理，副总裁兼财务总监。现任公司财务总监、职工董事，兼任华安嘉业董事，华富瑞兴董事，华安期货董事。

郑振龙先生，中国国籍，无永久境外居留权，博士学位。历任厦门大学财金系助教、教师、副教授，金融系教授。现任厦门大学管理学院教授，兼任华安证券独立董事、厦门国际银行外部监事、东兴证券股份有限公司独立董事。

李晓玲，中国国籍，无永久境外居留权，经济学学士学位，会计学教授、博士生导师。历任安徽大学工商管理学院教授、硕士生导师、系主任，安徽大学财务处处长，安徽大学商学院教授、博士生导师、院长。现为安徽大学商学院退休

教授，兼任华安证券独立董事、安徽安利材料科技股份有限公司独立董事、安徽合力股份有限公司独立董事、安徽江淮汽车集团股份有限公司独立董事，龙迅半导体(合肥)股份有限公司独立董事。

曹啸，中国国籍，无永久境外居留权，博士学位。历任富国基金管理有限公司基金部研究员，上海财经大学金融学院讲师、副教授、硕士生导师，现任上海财经大学金融学院院长助理、教授、博士生导师，兼任华安证券股份有限公司独立董事。

刘培林，中国国籍，无永久境外居留权，博士学位。历任国务院山西榆次液压件厂人事教育处人事管理科员、新疆阿勒泰地区发展计划委员会副主任、国务院发展研究中心发展战略和区域经济研究部研究室副主任、主任、副部长、巡视员、一级巡视员。现任浙江大学求是智库岗研究员，浙江大学区域协调发展研究中心首席专家、研究员，浙江大学共享与发展研究院副院长，嘉兴学院长三角一体化发展研究中心联合主任。

## 2、监事会成员

马军伟，中国国籍，无永久境外居留权，大学本科，投资经济专业。历任安徽古井贡酒股份有限公司证券事务代表，资本运作中心副主任、主任；安徽古井集团有限责任公司战略发展中心总监助理。现任安徽古井集团有限责任公司战略发展中心总监，兼任华安证券监事，安徽汇智富创业投资有限公司董事，安徽龙瑞玻璃有限公司董事，安徽瑞景商旅（集团）有限责任公司董事，安徽古井房地产集团有限责任公司董事，中国物流亳州有限公司监事。

张海峰，中国国籍，无永久境外居留权，大学本科。历任安徽省证券公司淮南营业部交易部负责人、财务部经理、经理助理、副总经理，公司淮南朝阳路营业部总经理，淮南分公司总经理、宿州分公司总经理。现任公司综合管理部总经理、职工监事。

方达，中国国籍，无境外永久居留权，管理学学士学位，高级会计师。历任天健会计师事务所高级审计员，浙江东方集团股份有限公司资产财务部主办会计（期间于浙江省国资委财务监督与统计评价处挂职）、投资管理部经理助理，浙江东方金融控股集团股份有限公司投资管理部经理助理。现任浙江东方金融控股集团股份有限公司投资管理部副经理，兼任华安证券监事。

盛靖，中国国籍，无永久境外居留权，大学本科学历，中国国籍，无永久境

外居留权。历任华安证券铜陵淮河北路营业部技术维护职员、技术维护主管，华安证券登记结算部账户业务经理，池州南湖路营业部副总经理、总经理，祁门县副县长（挂职），池州分公司副总经理（主持工作）、铜陵分公司副总经理（主持工作）。现任华安证券铜陵分公司总经理。

李赞，中国国籍，无永久境外居留权，同等学历硕士研究生。历任安徽省证券公司计划财务总部清算中心业务主管，华安证券计划财务总部经理助理，公司团委副书记（主持工作），公司六安梅山路营业部副总经理，公司合肥润安大厦营业部副总经理、总经理，公司合肥金寨路营业部总经理，公司工会副主席、工会办副主任，现任华安证券稽核审计部副总经理、职工监事。

### 3、公司高级管理人员

赵万利，中国国籍，无永久境外居留权，大学本科，公共管理硕士。历任安徽省证券公司深圳证券营业部和资产管理部员工，公司经纪业务总部经理、风险管理部副总经理、办公室副主任、办公室主任、总裁助理兼办公室主任、董事会秘书兼办公室主任，公司副总裁。现任公司党委委员、总裁，兼任华富基金董事长，华安嘉业董事，华富瑞兴董事，中国证券业协会发展战略委员会委员，安徽省证券期货业协会副会长。

张建群，中国国籍，无永久境外居留权，工商管理硕士，注册会计师。历任中国建设银行安徽省分行营业部会计处会计主管，安徽证监局机构处五级助手、副主任科员、主任科员、副处长，安徽证监局期货处副处长、处长，公司合规总监、首席风险官兼合规管理部总经理。现任公司党委委员、副总裁，兼任华安期货董事，华安金控董事，中国证券业协会投资银行委员会委员，上海证券交易所科创板发展委员会委员，安徽省证券期货业协会投行业务委员会主任委员。

周庆华，中国国籍，博士研究生学历。历任蔚深证券兰州营业部总经理助理、新安营业部市场部经理，招商证券股票销售交易部副总经理、机构营业部总经理，西南证券机构客户部总经理，光大证券机构业务总部总经理、研究所所长，中天国富证券公司公司副总裁，现任公司副总裁。

顾勇，中国国籍，管理科学与工程专业硕士研究生。历任富国基金证券分析师，中国大地财产保险股份有限公司投资管理部投资处副处长，战略发展部规划处处长、战略发展部总经理助理、计划财务部兼资产管理部总经理助理、计划财务部兼资产管理部副总经理，永安财产保险股份有限公司党委委员、董事、副总

裁、首席财务官，德邦证券股份有限公司高级总裁助理兼科技金融部总经理、副总裁。现任华安证券副总裁。

唐泳，中国国籍，无永久境外居留权，法学硕士。历任马鞍山钢铁股份有限公司H型钢厂工艺筹备组成员、生产科计划员、生产科调度长、生产科副科长，公司经纪业务部员工、业务拓展部经理助理、业务拓展部副经理（主持工作）、经纪业务部副总经理、资产管理总部副总经理（主持工作）、资产管理总部总经理，公司总裁助理。现任公司副总裁，兼任华安金控董事，中国证券业协会资产管理业务委员会委员。

王孝佳，中国国籍，无永久境外居留权，研究生学历，理学硕士。历任大立光电复合材料投资有限公司研发工程师、项目部经理，公司证券投资管理部职员、总经理助理、证券投资管理总部副总经理，公司总裁助理兼固定收益部总经理。现任公司副总裁兼证券投资部总经理、固定收益部总经理，兼任华安金控董事。

徐峰，中国国籍，无永久境外居留权，工学博士，正高级工程师。历任安徽大学计算机系辅导员、团总支副书记、讲师，安徽证券交易中心电讯工程部经理助理、副经理，公司信息技术部副总经理，总裁助理兼登记结算部总经理，总裁助理兼经纪业务部总经理，副总裁兼首席信息官，现任公司党委委员、首席信息官，兼任华富基金董事，中国证券业协会托管结算委员会委员，深圳证券交易所技术发展委员会委员。

龚胜昔，中国国籍，无永久境外居留权，工商管理硕士，正高级会计师。历任合肥市茶叶公司财务科会计，合肥市供销工业品公司财务会计科会计，安徽中华会计师事务所项目经理，安徽华普会计师事务所审计三部经理，公司计划财务部总经理助理、副总经理、总经理，公司财务总监兼计划财务部总经理，副总裁兼财务总监。现任公司财务总监、职工董事，兼任华安嘉业董事，华富瑞兴董事，华安期货董事。

汲杨，中国国籍，无永久境外居留权，学士学位，具有公司律师执业资格。历任安徽证券交易中心交易部交易管理员、安徽证券交易中心综合部文员、公司稽核部职员、办公室职员、法律事务经理、风险管理部合规经理、办公室副主任、合肥合作化南路营业部总经理、公司营销管理总部机构及私人客户部总经理、金融市场部总经理，公司董事会秘书兼办公室主任，现任公司总裁助理兼办公室主任，兼任华安金控董事长，上海证券交易所投资者教育和保护专门委员会委员，



安徽上市公司协会董秘工作委员会副主任委员，安徽省金融学会副秘书长。

刘晓东，中国国籍，无永久境外居留权，大专学历，中共党员。历任中国人民解放军淮南军分区军人服务社职工、主任，安徽省证券管理办公室信息法律处科员、副主任科员，中国证监会合肥特派办稽查处副主任科员、主任科员，中国证监会合肥特派办公司处主任科员，中国证监会安徽监管局公司处主任科员，中国证监会安徽监管局办公室副主任（主持工作），中国证监会安徽监管局机构处处长，中国证监会安徽监管局稽查处处长，安徽省国有资本运营控股集团有限公司投资部研究员，公司合规总监、首席风险官兼合规管理部总经理。现任公司合规总监兼法律合规部总经理，兼任中国证券业协会合规管理与廉洁从业委员会委员、安徽省证券期货业协会合规管理委员会主任委员。

余海春，中国国籍，无永久境外居留权，硕士研究生学历，历任中国人民银行和县支行员工，安徽省证券公司合肥营业部员工，上海自忠路营业部业务经理，合肥第二营业部业务经理、经理助理，公司证券投资总部交易部经理、副总经理，池州东湖南路营业部总经理，合肥花园街营业部总经理，公司办公室主任，固定收益部总经理，证券投资管理总部总经理，华富基金管理有限公司总经理。现任公司总裁助理兼机构管理部总经理，兼任安徽省证券期货业协会诚信建设与投资者保护委员会主任委员。

丁峰，中国国籍，无永久境外居留权，经济学硕士学位，高级经济师。历任公司安庆龙山路营业部副总经理，巢湖营业部总经理，安庆人民路营业部总经理（其间挂任祁门县委常委、副县长），稽核部总经理，风险管理部总经理兼职工监事。现任公司首席风险官兼风险管理部总经理，兼任华安金控董事，华安期货监事。

#### 4、投资经理

本集合计划历任投资经理为：2010年6月23日至2011年11月30日，姜涛；2010年11月30日至2013年1月21日，胡学刚；2013年1月21日至2013年5月2日，胡学刚、邵子瑄；2013年5月2日至2016年9月5日，邵子瑄、余晓彬；2016年9月5日至2017年12月14日，余晓彬、张欣；2017年12月14日至2020年6月2日，张欣；2020年6月2日至2020年7月14日，唐泳、张欣、张钰；2020年7月14日至今，张欣、刘杰。

唐泳，法学硕士，历任马鞍山钢铁股份有限公司H型钢厂工艺筹备组成员、

生产科计划员、生产科调度长、生产科副科长，公司经纪业务部员工、业务拓展部经理助理、业务拓展部副经理（主持工作）、经纪业务部副总经理、公司资产管理总部副总经理（主持工作）。现任公司总裁助理、资产管理总部总经理。证券从业经验十多年,偏重于固定收益品种的投资,对现金管理产品投资运行和风险控制有着深刻的理解，投资经验丰富，投资风格稳健。

姜涛，经济学硕士，中级经济师，证券投资管理从业多年，理论经验与实战经验相结合，投资风格稳健。

胡学刚，硕士学位，研究投资工作经历十多年，对固定收益市场投资有着深刻的理解与独特的见解、对新股等一级市场投资机会把握准确，擅长各类资产的组合配置。

余晓彬，经济学硕士，证券从业多年，投研工作经验多年，2009年加入华安证券资产管理部，擅长新股定价研究和债券、债券型基金等固定收益类投资。

邵子瑄，金融学硕士，具有多年大资金资产配置经验，具备债券、股票和基金多品种投资能力和多市场投资经历，投资风格稳健。

张钰，经济学硕士，2016年1月进入华安证券资产管理总部任交易员，2018年担任现金管理产品的投资助理工作。专注于组合头寸管理、货币政策及利率趋势研究、信用债资质及信用利差趋势研究。

张欣，工学硕士，证券从业经历十年，侧重于固定收益类资产配置，熟悉现金管理类产品投资运行，注重风险控制。

刘杰，经济学硕士，证券从业工作经历11年，股票投资及研究经验丰富。2017年8月加入华安证券，现任资产管理总部投资经理。

#### 5、公司公募资产管理业务决策委员会成员

唐泳，公募决策委员会成员主任委员，现任公司总裁助理、资产管理总部总经理；

张欣，公募决策委员会成员委员，现任公司资产管理总部公募投资部总监；

樊艳，公募决策委员会成员委员，现任公司资产管理总部公募投资部投资经理；

刘杰，公募决策委员会成员委员，现任公司资产管理总部公募投资部投资经理；

程蕾，公募决策委员会成员委员，现任公司风险管理部经理；

吴景伟，公募决策委员会成员委员，现任公司合规管理部经理；

章亚，公募决策委员会成员委员，现任公司计划财务部经理。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、集合计划管理人的职责

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

(1) 依法募集资金；

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

(3) 依照《集合计划合同》收取集合计划管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售集合计划份额；

(5) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；

(6) 依据集合计划合同及有关法律规规定监督集合计划托管人，如认为集合计划托管人违反了集合计划合同及国家有关法律规规定，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人的利益；

(7) 在集合计划托管人更换时，提名新的集合计划托管人；

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

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任集合计划登记机构办理集合计划登记业务并获得集合计划合同规定的费用；

(10) 依据集合计划合同及有关法律规规定决定集合计划收益的分配方案

(11) 在集合计划合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使权利，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) 在遵守届时有有效的法律法规和监管规定，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，为支付本集合计划应付的赎回、交易清算等款项，集合计划管理人有权代表集合计划份额持有人在必要限度内以集合计划资产作

为质押进行融资；

(15) 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；

(16) 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；

(17) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关集合计划认购、申购、赎回、转换、非交易过户和定期定额投资等业务规则，在法律法规和本集合计划合同规定的范围内决定和调整集合计划的除管理费率、托管费率之外的集合计划相关费率结构和收费方式；

(18) 委托第三方机构办理本集合计划的交易、清算、估值、结算等业务；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他权利。

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

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

(2) 办理集合计划备案手续；

(3) 自集合计划合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划财产；

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

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

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

(7) 依法接受集合计划托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算集合计划份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合集合计划合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告集合计划资产净值，确定集合计划份额申购、赎回的价格；

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(10) 编制季度、中期和年度集合计划报告；

(11) 严格按照《基金法》、集合计划合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(12) 保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《集合计划合同》及其他有关法律法规或监管机构另有规定或要求外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向监管机构、司法机关或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

(13) 按集合计划合同的约定确定集合计划收益分配方案，及时向集合计划份额持有人分配集合计划收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

(23) 以集合计划管理人名义，代表集合计划份额持有人利益行使诉讼权利

或实施其他法律行为；

(24) 集合计划管理人在募集期间未能达到集合计划的备案条件，集合计划合同不能生效，集合计划管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在集合计划募集期结束后 30 日内退还集合计划认购人；

(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集合计划合同约定的其他义务。

#### 四、集合计划管理人关于遵守法律法规的承诺

1、集合计划管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、集合计划管理人承诺不从事以下违反《基金法》的行为，并承诺建立健全的内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

(1) 将集合计划管理人固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待管理的不同集合计划财产；

(3) 利用集合计划财产为集合计划份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 依照法律、行政法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

3、集合计划管理人承诺加强人员管理，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，不从事以下活动：

(1) 越权或违规经营；

(2) 违反集合计划合同或托管协议；

(3) 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权益；

(4) 在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；

(5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；

(6) 玩忽职守、滥用职权；

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

(8) 协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易；

(9) 违反证券交易场所业务规则，利用对敲、倒仓等手段操纵市场价格，扰乱市场秩序；

(10) 贬损同行，以提高自己；

(11) 在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；

(12) 以不正当手段谋求业务发展；

(13) 有悖社会公德，损害证券投资基金人员形象；

(14) 其他法律、行政法规禁止的行为。

## 五、 集合计划管理人关于禁止性行为的承诺

为维护集合计划份额持有人的合法权益，本集合计划禁止从事下列行为：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

(5) 向集合计划管理人、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) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

如法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，则本集合计划投资不再受相关限制。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其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循集合计划份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合中国证监会的规定，并履行信息披露义务。

## 六、 集合计划投资经理承诺

1、依照有关法律、法规和集合计划合同的规定，本着谨慎的原则为集合计划份额持有人谋取最大利益；

2、不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；

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

4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 七、集合计划管理人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

公司资产管理业务内部控制的总体目标是建立科学规范、稳健高效的经营机制，确保资产管理业务能够规范、持续、健康发展。具体包括以下目标：

（1）确保公司资产管理业务的经营运作严格遵守国家有关法律、法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营风格。

（2）防范和化解经营风险，建立有效的风险控制体系，确保公司资产管理业务的健康运行，保障公司资产及客户资产的安全，最大限度地保护计划持有人的合法权益。

（3）确保自身发展战略和经营目标的全面实施，不断提高公司资产管理业务经营管理水平，实现资产管理业务的持续、稳定、健康发展。

### 2、内部控制原则

**合法合规原则。**公司资产管理业务内部控制机制以及相关制度必须严格遵守国家法律、法规、规章和相关规定。

**全面性原则。**内部控制机制必须覆盖公司资产管理业务相关的各个部门和岗位，并渗透到资产管理业务各个环节。

**有效性原则。**通过科学的内控手段和方法，建立合理、切实可行的内部控制程序，保障内部控制制度的有效执行。任何员工不得拥有超越制度约束的权力。

**独立性原则。**资产管理业务的部门和岗位应当保持一定的独立性，公司资产管理业务客户资产独立运作，与公司自有资产、其他资产的运作保持分离。

**相互制衡原则。**公司资产管理业务的部门和岗位设置必须权责分明、相互制衡。

**防火墙原则。**公司负责资产管理业务的部门和人员与公司投行业务、经纪业务、自营业务和固定收益等部门，必须在物理和制度上有效隔离；公募资产管理业务与私募资产管理业务根据相关规定实现人员隔离。

**审慎性原则。**公司资产管理业务内部控制的核心是风险控制，内部控制机制的建立应以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

**适时性原则。**公司资产管理业务内部控制制度，应当随着国家法规制度等外



部环境变化以及公司经营方针等内部环境变化及时进行相应的修订和完善。

成本效益原则。公司资产管理业务应当通过科学的经营管理方法，降低运作成本，提高经济效益，努力实现效益最佳的内部控制效果。

### 3、主要内部控制体系

公司资产管理业务内部控制体系包括内部控制体系主体和内部控制制度体系。

公司内部控制体系的主体包括董事会、董事会风险控制和投资决策委员会、经营管理层、公司公募资产管理业务决策委员会、合规管理部、风险管理部、稽核部、资产管理总部以及其他相关部门。公司根据自身经营的特点，设立顺序递进、权责统一、严密有效的四道内部控制防线。包括：

(1) 建立一线岗位自控与互控为基础的第一道内控防线。各岗位责任明确，有详细的岗位职责和业务流程，各岗位人员在授权范围内承担责任。直接与客户、技术系统、资金、有价证券、重要空白凭证、业务用章等接触的岗位，必须严格实行双人负责制度。属于单人单岗处理的业务，原则上由上一级主管履行监督职责。

(2) 建立部门与部门之间、各部门内设部门之间的自控和互控为基础的第二道内控防线。公司在相关部门之间建立合理的重要业务处理凭证传递机制和顺畅的信息传递制度，相关部门分别在授权范围内承担各自职责，并相互监督制衡。各部门在内部自行检查，发现和消除各类风险隐患，规范业务流程，完善内控管理。

(3) 建立合规管理部、风险管理部、稽核部对各部门、各岗位、各项业务全面实施监督反馈的第三道内控防线。合规管理部和风险管理部对业务运作中的风险进行识别、评估、监测、反馈、防范并提出改进建议，对业务风险进行事前审核、事中监测和事后检查，审核和管理合同文本。稽核部对业务经营活动开展常规稽核和非常规稽核，检查和评价公司内部制度的建设和执行情况。

(4) 建立以董事会及董事会风险控制与投资决策委员会、经营管理层、公司公募资产管理业务决策委员会为主体的第四道内控防线。董事会及董事会风险控制与投资决策委员会代表董事会对公司集合资产管理业务风险进行总体控制，发现公司内部控制中出现的隐患并组织解决，对公司合规管理部、风险管理部、稽核部等部门的工作予以监督、指导。公司公募资产管理业务决策委员会负责贯

彻和落实公司资产管理业务有关内控制度，研究确定客户资产投资策略和配置原则，审议投资对象和进行投资授权。

公司内部控制制度体系按照其所管理的层次，由三个层次的制度构成：第一层次是公司章程；第二层次是公司资产管理业务管理和内部控制制度；第三层次是公司资产管理总部及相关部门根据业务需要制定的实施细则及操作流程等。

## 第四部分 集合计划托管人

### 一、集合计划托管人基本情况

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋

法定代表人：郑杨

成立日期：1992 年 10 月 19 日

批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1992]350 号

基金托管业务批准文号：证监基金字〔2003〕105 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：朱萍

联系电话：（021）31888888

### 二、主要人员情况

郑杨，男，1966 年出生，研究生学历，博士学位，高级经济师。曾任国家经贸委经济法规司调研处副处长；中国机电设备招标中心开发处处长、第七招标业务处处长；国家外汇管理局资本项目司副司长；中国人民银行上海分行党委委员、副行长、国家外汇管理局上海市分局副局长；中国人民银行上海总部党委委员、副主任兼外汇管理部主任；上海市金融工作党委副书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市金融办主任；上海市金融工作党委书记、市地方金融监管局（市金融工作局）局长。现任上海浦东发展银行党委书记、董事长。

潘卫东，男，1966 年出生，硕士研究生，高级经济师。曾任宁波证券公司业务一部副经理；上海浦东发展银行宁波分行资财部总经理兼任北仑办事处主任、宁波分行副行长；上海浦东发展银行产品开发部总经理；上海浦东发展银行昆明分行行长、党组书记；上海市金融服务办公室挂职并任金融机构处处长；上海国际集团党委委员、总经理助理，上海国际集团党委委员、副总经理，上海国际信托有限公司党委书记、董事长；上海浦东发展银行党委委员、执行董事、副

行长、财务总监。现任上海浦东发展银行党委副书记、副董事长、行长，上海国际信托有限公司董事长。

李国光，男，1967年出生，硕士研究生。历任上海浦东发展银行天津分行资财部总经理，天津分行行长助理、副行长，总行资金总部副总经理，总行资产负债管理委员会主任，总行清算作业部总经理，沈阳分行党委书记、行长。现任上海浦东发展银行总行资产托管部部门负责人。

### 三、基金托管业务经营情况

截止 2023 年 3 月 31 日，上海浦东发展银行证券投资基金托管规模为 12379.80 亿元，托管证券投资基金共三百九十七只。

### 四、集合计划托管人的职责

- 1、以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；
- 2、设立专门的集合计划托管部门，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名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- 4、除依据《基金法》、集合计划合同及其他有关规定外，不得利用集合计划财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管集合计划财产；
- 5、保管由集合计划管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；
- 6、按规定开设集合计划财产的资金账户和证券账户，按照集合计划合同的约定，根据集合计划管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 7、保守集合计划商业秘密，除《基金法》、集合计划合同及其他有关法律法规或监管机构另有规定或要求外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向监管机构、司法机关或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的的情况除外；

8、复核、审查集合计划管理人计算的集合计划资产净值、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、中期和年度集合计划报告出具意见，说明集合计划管理人在各重要方面的运作是否严格按照集合计划合同的规定进行；如果集合计划管理人有未执行集合计划合同规定的行为，还应当说明集合计划托管人是否采取了适当的措施；

11、保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；

12、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、依据《基金法》、集合计划合同及其他有关规定，召集集合计划份额持有人大会或配合集合计划管理人、集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；

16、按照法律法规和集合计划合同的规定监督集合计划管理人的投资运作；

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

18、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知集合计划管理人；

19、因违反集合计划合同导致集合计划财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

20、按规定监督集合计划管理人按法律法规和集合计划合同规定履行自己的义务，集合计划管理人因违反集合计划合同造成集合计划财产损失时，应为集合计划份额持有人利益向集合计划管理人追偿；

21、执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

22、法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他义务。

## **五、集合计划托管人的内部控制制度**

### 1、内部风险控制目标

集合计划托管人确保经营活动中严格遵守国家有关法律法规、监管部门监管规则和规章制度，形成守法经营、规范运作的经营思想。确保经营业务的稳健运行，保证基金资产的安全和完整，确保业务活动信息的真实、准确、完整，保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部风险控制组织结构

总行法律合规部是全行内部控制的牵头管理部门，指导业务部门建立并维护资产托管业务的内部控制体系。总行风险监控部是全行操作风险的牵头管理部门。指导业务部门开展资产托管业务的操作风险管控工作。总行资产托管部下设内控管理处。内控管理处是全行托管业务条线的内部控制具体管理实施机构，并配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职责。

### 3、内部风险控制措施实施

集合计划托管人已建立完善的内部控制制度。内控制度贯穿资产托管业务的决策、执行、监督全过程，渗透到各业务流程和各操作环节，覆盖到从事资产托管各级组织结构、岗位及人员。内部控制以防范风险、合规经营为出发点，各项业务流程体现“内控优先”要求。

具体内控措施包括：培育员工树立内控优先、制度先行、全员化风险控制的风险管理理念，营造浓厚的内控文化氛围，使风险意识贯穿到组织架构、业务岗位、人员的各个环节。制定权责清晰的业务授权管理制度、明确岗位职责和各项操作规程、员工职业道德规范、业务数据备份和保密等在内的各项业务管理制度；建立严格完善的资产隔离和资产保管制度，托管资产与托管人资产及不同托管资产之间实行独立运作、分别核算；对各类突发事件或故障，建立完备有效的应急预案，定期组织灾备演练，建立重大事项报告制度；在基金运作办公区域建立健全安全监控系统，利用录音、录像等技术手段实现风险控制；定期对业务情况进行自查、内部稽核等措施进行监控，通过专项/全面审计等措施实施业务监控，排查风险隐患。

## 七、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

### 1、监督依据

集合计划托管人严格按照有关政策法规、以及集合计划合同、托管协议等进行监督。监督依据具体包括：

- (1) 《中华人民共和国证券法》；
- (2) 《中华人民共和国证券投资基金法》；
- (3) 《公开募集证券投资基金运作管理办法》；
- (4) 《证券投资基金销售管理办法》
- (5) 《基金合同》、《基金托管协议》；
- (6) 法律、法规、政策的其他规定。

## 2、监督内容

集合计划托管人根据集合计划合同及托管协议约定，对合同生效之后所托管基金的投资范围、投资比例、投资限制等进行严格监督，及时提示集合计划管理人违规风险。

## 3、监督方法

(1) 资产托管部设置核算监督岗位，配备相应的业务人员，在授权范围内独立行使对集合计划管理人投资交易行为的监督职责，规范运作，维护投资人的合法权益，不受任何外界力量的干预；

(2) 在日常运作中，凡可量化的监督指标，由核算监督岗通过托管业务的自动处理程序进行监督，实现系统的自动跟踪和预警；

(3) 对非量化指标、投资指令、管理人提供的各种报表和报告等，采取人工监督的方法。

## 4、监督结果的处理方式

(1) 托管人对管理人的投资运作监督结果，采取定期和不定期报告形式向管理人和中国证监会报告。定期报告包括基金监控周报等。不定期报告包括提示函、临时日报、其他临时报告等；

(2) 若托管人发现管理人违规违法操作，以电话、邮件、书面提示函的方式通知管理人，指明违规事项，明确纠正期限。在规定期限内托管人再对管理人违规事项进行复查，如果管理人对违规事项未予纠正，托管人将报告中国证监会。如果发现管理人投资运作有重大违规行为时，托管人应立即报告中国证监会，同时通知管理人限期纠正；

(3) 针对中国证监会、中国人民银行对基金投资运作监督情况的检查，应

及时提供有关情况和资料。



## 第五部分 相关服务机构

### 一、销售机构

名称：华安证券股份有限公司

住所及办公地址：安徽省合肥市政务区天鹅湖路 198 号

法定代表人：章宏韬

电话：0551-65161926

传真：0551-65161861

联系人：杨海凡

名称：上海天天基金销售有限公司

住所及办公地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

电话：021- 54509977-8620

联系人：胡乃菁

名称：上海陆家嘴国际金融资产交易市场股份有限公司

住所及办公地址：上海市浦东新区陆家嘴 1333 号

法定代表人：王之光

电话：021-22628121

联系人：谈云飞

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市北京东路 689 号 26 楼

法人代表：郑杨

联系人：朱璜

电话：021-61616886

名称：北京度小满基金销售有限公司

住所及办公地址：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

法定代表人：盛超  
联系人：段江啸  
电话：15901238796

名称：珠海盈米基金销售有限公司  
注册地址：珠海市横琴新区环岛东路3000号2719室  
法定代表人：肖雯  
联系人：陈良斌  
电话：020-89629099

名称：上海利得基金销售有限公司  
住所及办公地址：中国(上海)自由贸易试验区临港新片区海基六路70弄1号208-36室  
法定代表人：李兴春  
电话：13788978635  
联系人：郭德涵

名称：上海云湾基金销售有限公司  
住所及办公地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号1号，明月路1257号1幢1层103-1、103-2办公区  
法定代表人：冯轶明  
电话：021-20530070  
联系人：曹雪

名称：南京苏宁基金销售有限公司  
住所及办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号  
法定代表人：钱燕飞  
联系方式：18551603063  
联系人：刘念

名称：北京新浪仓石基金销售有限公司

住所及办公地址：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期（西扩）N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：穆飞虎

电话：010-62675369

联系人：邵文静

名称：大连网金基金销售有限公司

住所及办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人：樊怀东

电话：0411-39027817

联系人：辛志辉

名称：上海联泰基金销售有限公司

住所及办公地址：上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室

法人代表人：尹彬彬

电话：18402139576

联系人：方嘉瑶

公司名称：泰信财富基金销售有限公司

住所及办公地址：北京市朝阳区建国路乙 118 号 10 层 1206

法定代表人：彭浩

电话：18201874972

联系人：孔安琪

公司名称：北京雪球基金销售有限公司

住所及办公地址：朝阳区创远路 34 号院融新科技中心 C 座 22 层

法人代表人：李楠

电话：13488695016

联系人：丁晗

公司名称：京东肯特瑞基金销售有限公司

住所及办公地址：北京市海淀区知春路 76 号(写字楼)1 号楼 4 层 1-7-2

法定代表人：邹保威

电话：010-89187658

联系人：张国杰

公司名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所及办公地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路 1218 号 1 幢 202 室

法人代表人：王珺

电话：0571-26888888

联系人：程冬雷

公司名称：北京汇成基金销售有限公司

住所及办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2

法人代表人：王伟刚

电话：13811931600

联系人：史春晖

公司名称：泛华普益基金销售有限公司

住所及办公地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

法定代表人：杨远芬

电话：028-86758820

联系人：史若芬

公司名称：上海万得基金销售有限公司

住所及办公地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人：简梦雯

电话：021-50712782

联系人：董怡芳

公司名称：上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路 1207 号 306 室

办公地址：上海浦东新区银城路 116 号大华银行大厦 703 室

法定代表人：郑新林

电话：021-68889283

联系人：郑经枢

公司名称：上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市东大名路 501 号 6211 单元

办公地址：上海市浦东新区张杨路 500 号华润时代广场商务楼 14 楼

法定代表人：陶怡

电话：021-68077516

联系人：周婷

名称：财咨道信息技术有限公司

住所及办公地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

法定代表人：朱荣晖

电话：13918960890

联系人：庞文静

## 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-50938782

传真：010-50938907

联系人：赵亦清

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：安徽天禾律师事务所

注册地址：合肥市庐阳区濉溪路 278 号财富广场 B 座东楼 16 层

负责人：张晓健

电话：0551-62677062

传真：0551-62620450

经办律师：吕光、李军

### 四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称：天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市海淀区车公庄西路 19 号 68 号楼 A-1 和 A-5 区域

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 13 楼

执行事务合伙人：邱靖之

联系人：邱靖之

联系电话：010-88827666

传真：010-88018737

经办注册会计师：丁启新、户永红

## 第六部分 集合计划的历史沿革

华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划由华安理财1号稳定收益集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。原集合计划为限定性集合资产管理计划，于2010年2月8日获得中国证监会《关于核准华安证券有限责任公司设立华安理财1号稳定收益集合资产管理计划的批复》（证监许可【2010】181号），自2010年5月10日起开始推广，并于2010年6月10日结束，于2010年6月23日成立。

根据中国证监会发布的《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》的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更，本集合计划参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更。自《华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划合同》生效日起，《华安理财1号稳定收益集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

## 第七部分 集合计划合同的存续

集合计划合同生效后，连续 20 个工作日出现集合计划份额持有人数量不满 200 人或者集合计划资产净值低于人民币 5000 万元的，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集合计划合同等，并在 6 个月内召开集合计划份额持有人大会。

本集合计划自本合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起 3 年后，按照中国证监会有关规定执行。如本合同变更生效日起 3 年后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。



## 第八部分 集合计划份额的申购和赎回

### 一、申购与赎回场所

本集合计划的申购与赎回将通过销售机构进行。具体的销售网点将由集合计划在招募说明书或其他相关公告中列明。集合计划管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。集合计划投资人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。

### 二、申购与赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资者可在开放日办理集合计划份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但集合计划管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本集合计划合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

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

B类计划份额在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），B类计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。如果投资者多次申购本集合计划B类计划份额，则其持有的B类计划份额的赎回开放时间可能不同。

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

集合计划管理人不得在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。投资者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，即按照投资人认购、申购的先后次序进行顺序赎回；

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

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购集合计划份额时，必须在规定的时间内全额交付申购款项，否则所提交的申购申请不成立。投资人在提交赎回申请时须持有足够的集合计划份额余额，否则所提交的赎回申请不成立。投资人交付申购款项，申购成立；登记机构确认集合计划份额时，申购生效。集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。

正常情况下，投资人赎回（T日）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。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本集合计划合同有关条款处理。如遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故

障、银行交换系统故障或其他非集合计划管理人及集合计划托管人所能控制的因素影响了业务流程，则赎回款项划付时间相应顺延。

集合计划管理人可以在法律法规和资产管理合同允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，集合计划管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### 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。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

集合计划销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构或集合计划管理人的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

集合计划管理人可在法律法规允许的范围内、在不对集合计划份额持有人利益造成损害的前提下，对上述业务的办理时间、方式等规则进行调整。集合计划管理人应在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 五、申购与赎回的数额限制

1、投资人通过直销机构和代销机构首次申购单笔最低金额为人民币1元(含申购费，下同)，追加申购单笔最低金额为人民币1元。

实际操作中，各销售机构在符合上述规定的前提下，可根据情况调高首次申购和追加申购的最低金额，具体以销售机构公布的为准，投资人需遵循销售机构的相关规定。

2、投资者可将其全部或部分集合计划份额赎回。每次赎回集合计划份额不得低于1份，集合计划份额持有人赎回时或赎回后在销售机构网点保留的集合计划份额余额不足1份的，在赎回时需一次全部赎回。

在符合法律法规规定的前提下，各销售机构对赎回份额限制有其他规定的，需同时遵循该销售机构的相关规定。

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

4、集合计划管理人可以规定单个投资者单笔或单日申购集合计划份额上限、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。

5、集合计划管理人可以规定本集合计划单日的申购金额上限或单日净申购比例上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

6、当接受申购申请对存量集合计划份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，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。具体规定请参见招募说明书或相关公告。

7、集合计划管理人可以对集合计划的总规模进行限制，并在招募说明书或相关公告中列明。

8、集合计划管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制。集合计划管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 六、申购费用和赎回费用

### 1、申购费率：

本集合计划 A 类计划份额不开放申购。

本集合计划 B 类计划份额不收取申购费。

### 2、赎回费率

本集合计划 A 类计划份额收取赎回费。赎回费率按集合计划份额持有期限递减。本集合计划对集合计划份额持有人持有的 B 类计划份额均设置一年的最短持有期限，在一年最短持有期限后赎回不收取赎回费用。

A 类计划份额的赎回费率如下：

持有时间 D（单位：日）	赎回费率
$D < 7$	1.5%
$7 \leq D < 30$	0.75%

$30 \leq D < 180$	0.50%
$180 \leq D < 365$	0.3%
$D \geq 365$	0

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

注：一个月以 30 日计算。A 类计划份额持有时间从登记机构确认投资人持有原华安理财 1 号稳定收益集合资产管理计划份额之日起连续计算。

3、本集合计划的申购费率、赎回费率和收费方式由集合计划管理人根据《集合计划合同》的规定确定。集合计划管理人可以根据《集合计划合同》的相关约定调整费率或收费方式，集合计划管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

4、集合计划管理人及其他集合计划销售机构可以在不违背法律法规规定及《集合计划合同》约定的情形下，对集合计划销售费用实行一定的优惠，费率优惠的相关规则和流程详见集合计划管理人或其他集合计划销售机构届时发布的相关公告或通知。

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

### 1、集合计划申购份额的计算

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

B 类份额申购份额的计算公式为：

申购份额 = 申购金额 / T 日 B 类计划份额净值

例：某投资者投资 100,000 元申购本集合计划 B 类计划份额，且该申购申请被全额确认，假定申购当日 B 类计划份额净值为 1.2000 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 100,000 / 1.2000 = 83,333.33 \text{ 份}$$

即投资者选择投资 100,000 元申购本集合计划 B 类计划份额，假定申购当日 B 类计划份额净值为 1.2000 元，可得到 83,333.33 份 B 类计划份额。

## 2、集合计划赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类集合计划份额净值并扣除相应的费用和管理人业绩报酬（若有），赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

赎回金额为赎回总额扣减赎回费用以及管理人业绩报酬(若有)，其中：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times T \text{ 日该类集合计划份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = (\text{赎回总额} - \text{管理人业绩报酬 (若有)}) \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用} - \text{管理人业绩报酬 (若有)}$$

例：某投资者赎回 10,000 份本集合计划 A 类计划份额，持有时间为 180 日，对应赎回费率为 0.3%，假设赎回申请当日 A 类计划份额净值是 1.2000 元（推广期认购且期间未分红），A 类计划份额的业绩报酬计提基准为 5.0%，则可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 10,000 \times 1.2000 = 12,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{管理人业绩报酬} = [(1.2000 - 1) / 180 \times 365 - 5.0\%] \times 20\% \times 180 / 365 \times 10,000 \times 1 = 350.68$$

$$\text{赎回费用} = (12,000.00 - 350.68) \times 0.3\% = 34.95 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 12,000.00 - 350.68 - 34.95 = 11,614.37 \text{ 元}$$

即：投资者赎回 10,000 份 A 类计划份额，持有时间为 180 日，假设赎回申请当日 A 类计划份额净值是 1.2000 元，则其可得到的赎回金额为 11,614.37 元。

## 3、集合计划份额净值的计算

本集合计划 A 类、B 类计划份额分别设置代码，分别计算和公告各类集合计划份额净值和各类集合计划份额累计净值。T 日的各类集合计划份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延

迟计算或公告。本集合计划各类份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

#### 4、申购份额、余额的处理方式

申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日该类集合计划份额净值为基准计算，上述涉及集合计划份额的计算结果均保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分舍弃，舍弃部分归入集合计划财产；上述涉及金额的计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

#### 5、赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以该类份额当日的集合计划份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

### 八、申购与赎回的登记

投资人申购集合计划成功后，集合计划登记机构在 T+1 日为投资人登记权益并办理登记手续，投资人自 T+2 日（含该日）后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。

投资人赎回集合计划成功后，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。

集合计划管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资人的合法权益，并最迟于实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体公告。

### 九、拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，集合计划管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致集合计划无法正常运转。
- 2、发生集合计划合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，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或者无法办理申购业务。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有集合计划份额持有人利益时。

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

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

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

8、集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划销售机构或登记机构因技术故障或异常情况导致集合计划销售系统、集合计划登记系统、集合计划会计系统或证券登记结算系统无法正常运行时。

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、9 项暂停申购情形之一且集合计划管理人决定暂停申购时，集合计划管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项（无利息）将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，集合计划管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### **十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理方式**

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

1、因不可抗力导致集合计划管理人不能支付赎回款项。

2、发生集合计划合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，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，可暂停接受投资人的赎回申请。



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暂停接受集合计划赎回申请或延缓支付赎回款项。

7、出现开放日当日的净赎回申请所需资金超过集合计划 7 个工作日可变现资产的可变现价值。7 个工作日可变现资产,具体包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具及同业存单,7 个工作日内到期或可支取的逆回购、银行存款,7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等,如未来法律法规另有规定,集合计划管理人可对上述 7 个工作日可变现资产的范围进行调整。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

## 十一、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。若集合计划发生巨额赎回，对于单个集合计划份额持有人当日超过上一开放日集合计划总份额 10%以上部分的赎回申请，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 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

当发生上述延期赎回并延期办理时，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（包括但不限于短信、电子邮件或由集合计划销售机构通知等方式）在 3 个交易日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。

## 十二、其他暂停申购和赎回的情形及处理方式

发生《集合计划合同》或《招募说明书》中未予载明的事项，但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停集合计划申购、赎回的，可以经届时有效的合法程序宣布暂停接受投资人的申购、赎回申请。

## 十三、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，集合计划管理人应及时向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒介上刊登暂停公告。

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

3、若暂停时间超过1日，集合计划管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

#### **十四、集合计划转换**

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

#### **十五、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回**

本集合计划实施侧袋机制的，本集合计划的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。

#### **十六、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、符合法律法规的其他非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本集合计划份额的投资人。

继承是指集合计划份额持有人死亡，其持有的集合计划份额由其合法的继承人继承；捐赠指集合计划份额持有人将其合法持有的集合计划份额捐赠给福利性质的集合计划会或社会团体；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。

### **十七、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。

### **十八、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。

### **十九、集合计划的冻结和解冻**

集合计划登记机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。集合计划份额的冻结手续、冻结方式按照登记机构的相关规定办理。集合计划份额被冻结的，被冻结部分产生的权益按照我国法律法规、监管规章及国家有权机关的要求以及登记机构业务规定来处理。

### **二十、集合计划份额的转让**

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

### **二十一、其他业务**

在相关法律法规允许的条件下，集合计划登记机构可依据其业务规则，受理

集合计划份额质押等业务，并收取一定的手续费用。

## 第九部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

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

### 二、投资范围

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券(含可分离型可转换债券)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、债券回购、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，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。

集合计划的投资组合比例为：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%；投资于可交换债券、可转换债券的比例不超过集合计划资产的 20%，投资于股票等资产的投资比例合计不超过集合计划资产的 20%；本集合计划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，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%。

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

### 三、投资策略

本集合计划在严格控制投资风险和保持资产合理流动性的前提下，通过审慎的投资管理提高固定收益类资产收益，积极运用新股申购等方式增厚产品收益。

#### （一）资产配置策略

通过自上而下对宏观经济的研究，结合自下而上的对个券分析，综合评价各类资产的风险收益水平，进行积极投资及合理的资产配置，深入挖掘固定收益类和权益类的投资价值，谋求集合资产当期收益和长期稳定增值的统一。

## （二）固定收益类资产投资策略

本集合计划将运用多种积极管理增值策略，重点投资于债券等固定收益类金融产品，在严格控制信用风险的前提下，追求较高的稳健收益。其投资策略主要有持有到期策略、利率预期策略、收益率曲线策略、类属替换策略、个券优选策略等。同时，管理人将坚持基本面分析，充分挖掘新型信用品种的投资机会。

主要投资策略有：

### 1、持有到期策略

在流动性许可的情况下，管理人对本集合计划部分固定收益类资产将采取持有到期策略，该部分债券的剩余期限与其买入时本集合计划的剩余期限相匹配，从而有效地降低再投资风险，做到收益性与流动性兼顾。

### 2、利率预期策略

管理人通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平。

首先，本集合计划主要依据如下因素预期利率变动趋势：

- a、财政、货币政策分析；
- b、GDP 增长率及其变化趋势；
- c、物价水平、货币供应量、债券供求分析等及其预期。

其次，管理人依据对利率的预期，决定债券投资组合的期限结构：

- a、如利率预期上升，降低债券组合久期，以规避债券价格下降的风险；
- b、如利率预期下降，提高债券组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益。

### 3、收益率曲线策略

管理人通过对债券市场微观因素的分析判断，形成对未来收益率曲线形状变化的预期，相应地选择子弹型、哑铃型或梯型的组合期限配置，获取收益率曲线形变带来的投资收益。主要考虑的债券市场微观因素包括：收益率曲线、历史期限结构、新债发行、回购及市场拆借利率等。

#### 4、类属替换策略

管理人研究宏观、微观经济，观察公司债、金融债、企业债等信用债券品种与同期限国债之间收益率利差状况，对公司债、金融债、企业债等信用债券品种与同期限国债之间收益率利差的扩大或收窄趋势作出判断；在预期信用利差将收窄时，主动提高信用债券类属品种的投资比例，相应降低同期限国债的投资比例；在预期信用利差将扩大时，主动降低信用债券类属品种的投资比例，相应提高同期限国债的投资比例，从而获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

#### 5、个券优选策略

在以上债券资产久期、期限和类属配置的基础上，根据债券市场收益率数据，对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

#### 6、信用债投资策略

管理人将深入挖掘信用债的投资价值，利用内部评级体系对债券发行人及其发行的债券进行信用评估，并结合外部评级机构的信用评级，分析违约风险以及合理信用利差水平，判断债券的投资价值，谨慎选择债券发行人基本面良好、债券条款优惠的信用债进行投资。

本集合计划投资于外部债项信用等级为 AA 及以上的债券（短期融资券、超短期融资券及无债项信用等级的信用债，主体信用等级应为 AA 及以上），投资不同信用等级债券投资比例具体如下：

- （1）AAA 信用债的投资比例占集合计划总资产的 30%-100%；
- （2）AA+信用债的投资比例占集合计划总资产的 0-70%；
- （3）AA 信用债投资比例占集合计划总资产的 0-20%；
- （4）本集合计划不可主动投资于信用等级低于 AA 的信用债券。

以上评级不包括中债评级和中证指数有限公司评级。

#### 7、可转债及可交换债投资策略

（1）精选个券。着重对可转换债券、可交换债券对应的基础股票进行研究，对盈利能力较强、成长前景可期的上市公司对应的可转债、可交换债进行重点关注，从债性、股性角度综合对可转债、可交换债估值进行评判，对估值合理的品种进行集中投资。

（2）条款博弈。可转债通常设置了一些特殊条款，如转股价修正条款、回



售条款和赎回条款等，本集合计划将持续关注上市公司经营状况、可转债和正股价格表现，以预测发行人对转股价的修正和转股意愿，以获取条款价值。

(3) 比例限制。本集合计划投资于可转换债券（含可分离交易可转债）及可交换债券的比例不超过集合计划资产的 20%。

### (三) 资产支持证券投资策略

通过对宏观经济形势、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，对个券进行风险分析，制定投资策略。严格控制资产支持证券的投资总量，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，获取资产支持证券的收益贡献。

### (四) 股票投资策略

#### 1、新股申购策略

进行新股申购前，管理人通过公司研究平台及股票估值体系，参考同类公司的估值水平，同时综合考虑锁定期间的投资风险以及资金成本，对新股投资的收益率进行预测。通过研究与评估，决定是否参与新股的申购与配售。如果申购收益率为负，或者收益低于资金成本，则放弃申购；否则积极参与申购。

#### 2、股票投资策略

主要选择有良好增值潜力的股票以及有良好现金流、经营业绩持续增长、估值合理的防御类股票构建股票投资组合。通过前期配置无风险或低风险资产，如：现金管理资产、银行间票据、国债、债券等获得固定收益，增厚集合计划的安全垫，当积累到一定程度的时候再逐步配置权益类资产，控制股票市场下跌风险，分享股票市场成长收益。

### (五) 国债期货投资策略

基于谨慎和风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### (六) 现金头寸管理

根据法律法规和集合计划正常运作的需要，每个交易日日终，本集合计划须保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%。管理人将根据对客户申购、赎回、份额转换等业务和相关费用提留的预测，结合投资组合流动性进行合理的现金留存，最大限度降低现金持有比例，有效控制现金留存对组合收益的影响。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，集合计划还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，本集合计划将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

#### 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）本集合计划对债券的投资比例不低于集合计划资产的 80%，投资于股票等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划资产的 20%；投资可交换债券、可转换债券（含可分离交易可转债）的比例不超过集合计划资产的 20%；

（2）本集合计划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，保留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；

（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%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

（4）本集合计划管理人管理的全部公募型集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

（5）本集合计划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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

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

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

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

（9）本集合计划管理人管理的全部集合计划投资于同一原始权益人的各类

资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

(11) 本集合计划资产总值不得超过集合计划净资产的 140%；

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

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

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

(15) 本集合计划参与国债期货交易，应当遵守下列要求：

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

2) 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%；

3) 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%；

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）应当符合集合计划合同关于债券投资比例的有关约定；

(16) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（10）、（12）、（13）项外，因证券市场波动、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，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

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

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，则本集合计划投资不再受相关限制，届时无需召开集合计划份额持有人大会。

## 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，但是法律法规或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。

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他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到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。

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

## 五、业绩比较基准

基准指数 = 中证综合债券指数收益率 × 75% + 沪深 300 指数收益率 × 5% + 一年期定期存款利率（税后） × 20%

基于本集合计划的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够比较客观地反映本集合计划的风险收益特征。

中证综合债券指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，其选择是在中证全债指数样本的基础上，增加了央行票据、短期融资券以及一年期以下的国债、金融债和企业债。该指数的推出旨在更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制发布、表征 A 股市场走势的权威指数。该指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。本集合计划选择该指数收益率来衡量 A 股股票投资部分的绩效。

本集合计划新增申购份额最短持有期一年，为满足流动性需求，本集合计划在投资管理中以一年期定期存款税后收益率作为业绩比较基准因子之一，能够使投资人理性判断本产品的风险收益特征，合理地衡量比较本集合计划的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本集合计划的业绩基准的指数时，本集合计划可以在与集合计划托管人协商一致的情况下，报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开集合计划份额持有人大会。如果本集合计划业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时，集合计划管理人可以按相关监管部门要求履行相关手续后，依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数，而无需召开集合计划份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本集合计划为债券型集合资产管理计划，属于中低风险/收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金、股票型集合资

产管理计划、混合型基金、混合型集合资产管理计划。

## 七、集合计划管理人代表集合计划行使权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于集合计划财产的安全与增值；

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

## 八、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重大赎回申请时，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集合计划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“侧袋机制”部分的规定。

## 九、投资组合报告

### 1、期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	42,137,028.00	9.13
	其中：股票	42,137,028.00	9.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	406,637,236.67	88.14
	其中：债券	406,637,236.67	88.14
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付 金合计	12,427,032.38	2.69
8	其他资产	136,846.97	0.03
9	合计	461,338,144.02	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	22,767,168.00	6.14
D	电力、热力、燃气及 水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,643,910.00	0.71
G	交通运输、仓储和邮 政业	2,000,560.00	0.54
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信 息技术服务业	8,683,420.00	2.34
J	金融业	3,652,000.00	0.99
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务 业	-	-
N	水利、环境和公共设 施管理业	1,737,500.00	0.47
O	居民服务、修理和其 他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	652,470.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	42,137,028.00	11.37

### 3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601728	中国电信	600,000	3,798,000.00	1.03
2	600552	凯盛科技	220,000	2,574,000.00	0.69
3	600050	中国联通	400,000	2,168,000.00	0.59
4	002556	辉隆股份	235,000	1,995,150.00	0.54
5	600528	中铁工业	200,000	1,900,000.00	0.51
6	603617	君禾股份	220,000	1,883,200.00	0.51
7	300692	中环环保	250,000	1,737,500.00	0.47
8	002926	华西证券	200,000	1,646,000.00	0.44
9	000063	中兴通讯	50,000	1,628,000.00	0.44
10	601901	方正证券	200,000	1,394,000.00	0.38

### 4、期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	20,343,948.21	5.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	273,590,933.59	73.84
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	111,926,656.65	30.21
7	可转债（可交换债）	775,698.22	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-



10	合计	406,637,236.67	109.75
----	----	----------------	--------

#### 5、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	163423	20天风01	250,000	25,672,979.45	6.93
2	184542	22昭阳债	200,000	20,217,104.11	5.46
3	102002239	20大足城乡MTN001	200,000	20,175,589.04	5.45
4	184586	22珞璜债	200,000	20,007,068.49	5.40
5	184578	22潜江01	200,000	19,902,789.04	5.37

#### 6、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资 明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末无股指期货投资。

#### 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期末未持有国债期货。

#### 11、投资组合报告附注

11.1 天风证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现

本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### 11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库

#### 11.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	45,543.92
2	应收证券清算款	15,291.87
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	76,011.18
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	136,846.97

#### 11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123146	中环转2	775,698.22	0.21

#### 11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 第十部分 集合计划的业绩

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，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

本集合计划资产管理合同生效日为2021年12月3日，集合计划业绩截止日为2023年3月31日。

本报告期集合计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较如下：

华安证券睿赢一年持有A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.16%	0.12%	1.01%	0.04%	2.15%	0.08%
过去六个月	2.12%	0.12%	1.16%	0.06%	0.96%	0.06%
过去一年	5.13%	0.11%	2.78%	0.06%	2.35%	0.05%
自基金合同生效起至今	6.25%	0.10%	3.20%	0.07%	3.05%	0.03%

华安证券睿赢一年持有B净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.06%	0.12%	1.01%	0.04%	2.05%	0.08%
过去六个月	1.94%	0.11%	1.16%	0.06%	0.78%	0.05%
过去一年	4.70%	0.10%	2.78%	0.06%	1.92%	0.04%
自基金合同生效起至今	5.31%	0.10%	3.20%	0.07%	2.11%	0.03%

## 第十一部分 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。除依法律法规和《集合计划合同》的规定处分外，集合计划财产不得被处分。

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

## 第十二部分 集合计划资产估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

集合计划所拥有的股票、债券和银行存款本息、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。

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

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

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

应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，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) 交易所市场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。交易所市场挂牌的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

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

##### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监

管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（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、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。

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

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

7、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

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

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

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

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

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

外予以公布。

## 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，该类别集合计划资产净值除以当日该类别集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。集合计划管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

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

2、集合计划管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但集合计划管理人根据法律法规或本集合计划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。当集合计划份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为集合计划份额净值错误。

本集合计划合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

本集合计划运作过程中，如果由于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。对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差



错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 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；错误偏差达到集合计划份额净值的 0.5% 时，集合计划管理人应当公告，并报中国证监会备案。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## **七、暂停估值的情形**

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

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

4、中国证监会和集合计划合同认定的其他情形。

## **八、集合计划净值的确认**

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

## **九、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资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。

## **十、特殊情况的处理**

1、集合计划管理人或集合计划托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，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免除赔偿责任。但集合计划管理人、集合计划托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 第十三部分 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，本集合计划每年收益分配次数最多为 12 次，每份集合计划份额每次集合计划收益分配比例不得低于集合计划收益分配基准日每份集合计划份额可供分配利润的 10%，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。若投资者选择现金红利转换为相应类别集合计划份额进行再投资的，再投资份额以红利再投日为登记日，且需满足相应类别持有期的规定。

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

4、由于本集合计划 A 类、B 类计划份额的费用收取方式存在不同，各集合计划份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权。

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，集合计划管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计划收益分配原则，此项调整不需要召开集合计划份额持有人

大会，但应于变更实施日前在指定媒介和集合计划管理人网站公告。

#### **四、收益分配方案**

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

#### **五、收益分配方案的确定、公告与实施**

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

#### **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人自行承担。当投资人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同一类别的集合计划份额。红利再投资的计算方法，依照登记机构相关业务规则执行。

#### **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。

## 第十四部分 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、集合计划合同生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 5、集合计划合同生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、审计费、诉讼费和仲裁费；
- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券/期货等交易费用；
- 8、集合计划的银行汇划费用；
- 9、集合计划相关账户的开户及维护费用；
- 10、按照国家有关规定和集合计划合同约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、集合计划管理人的管理费

本集合计划 A 类份额按前一日该类集合计划资产净值的 0.3%年费率计提，B 类份额的管理费按前一日该类集合计划资产净值的 0.7%年费率计提。

A 类管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.3\%\div 365$$

B 类管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.7\%\div 365$$

H 为各类份额每日应计提的集合计划管理费

E 为各类份额前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由集合计划管理人向集合计划托管人发送集合计划管理费划款指令，集合计划托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给集合计划管理人。若遇法定节假日、公休日等，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 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.1\%\div 365$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

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

3、业绩报酬：在本集合计划委托人赎回确认日和计划终止日，管理人将根据委托人的期间年化收益率，对 A 类计划份额期间年化收益率超过 5.0%以上部分按照 20%、B 类计划份额期间年化收益率超过 5.0%以上部分按照 20%的比例收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）。

### （1）业绩报酬计提原则

a.按委托人每笔申购份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

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

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

### （2）业绩报酬计提方法

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

a.期间年化收益率计算

$$\text{期间年化收益率 } R = [ (P1-P0) / P0x ] \times (365 \div T)$$

P1=委托人本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值

P0 =委托人上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值

P0x=委托人上一个业绩报酬计提基准日的份额净值

T=委托人上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数

b.管理人以超额比例的方式提取业绩报酬

管理人根据期间年化收益率对 A 类计划份额期间年化收益率超过 5.0%以上部分按照 20%、B 类计划份额期间年化收益率超过 5.0%以上部分按照 20%的比例收取管理人业绩报酬。具体计算方式如下：

A 类计划份额：

年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式
$R \leq 5.0\%$	0	$E = 0$
$R > 5.0\%$	20%	$E = N \times P0x \times (R - 5.0\%) \times 20\% \times (T \div 365)$

B 类计划份额：

期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式
$R \leq 5.0\%$	0	$E = 0$
$R > 5.0\%$	20%	$E = N \times P0x \times (R - 5.0\%) \times 20\% \times (T \div 365)$

E= 该笔申购对应的管理人业绩报酬

N= 委托人该笔申购在上一个业绩报酬计提日的份额数

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

$$\Sigma E = E1 + E2 + E3 + \dots + En$$

其中的 n 为所对应的申购笔数。

上述“一、集合计划费用的种类中第 4-10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由集合计划托管人从集合计划财产中支付。

### 三、不列入集合计划费用的项目



下列费用不列入集合计划费用：

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

2、集合计划管理人和集合计划托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；

3、《集合计划合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目。

#### **四、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。

#### **五、集合计划税收**

本集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。集合计划财产投资的相关税收，由集合计划持有人承担，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。

本集合计划支付给管理人、托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

## 第十五部分 集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

- 1、集合计划管理人为本集合计划的会计责任方；
- 2、集合计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；集合计划首次募集的会计年度按如下原则：如果《集合计划合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、集合计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本集合计划独立建账、独立核算；
- 6、集合计划管理人及集合计划托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制集合计划会计报表；
- 7、集合计划托管人每月与集合计划管理人就集合计划的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、集合计划的年度审计

- 1、集合计划管理人聘请与集合计划管理人、集合计划托管人相互独立的具有证券从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本集合计划的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得集合计划管理人同意。
- 3、集合计划管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报集合计划托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告并报中国证监会备案。

## 第十六部分 集合计划的信息披露

一、本集合计划的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《集合计划合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本集合计划从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

本集合计划信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的集合计划信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证集合计划投资人能够按照《集合计划合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

指定网站包括管理人网站、托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。指定网站应当无偿向投资者提供信息披露服务。

**三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：**

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他集合计划管理人、集合计划托管人或者集合计划销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、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两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的集合计划信息

公开披露的集合计划信息包括：

（一）集合计划招募说明书、集合计划合同、集合计划托管协议、集合计划产品资料概要

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

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

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

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。

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

## （二）《集合计划合同》生效公告

管理人应当在指定媒介上登载《集合计划合同》生效公告。

## （三）集合计划净值信息

《集合计划合同》生效后，在开始办理集合计划份额申购或者赎回前，集合计划管理人应当至少每周在指定网站披露一次集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

在开始办理集合计划份额申购或者赎回后，集合计划管理人应当不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、销售机构网站或者营业网点披露开放日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，在指定网站披露半年度和年度最后一日的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

## （四）集合计划份额申购、赎回价格

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

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

集合计划管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成集合计划年度报告，并将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载于网站上，并将年度报告摘要登载在指定报刊上。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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

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

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

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本集合计划的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。

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

#### （六）临时报告

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

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

- 1、集合计划份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《集合计划合同》终止、集合计划清算；
- 3、转换集合计划运作方式、集合计划合并；
- 4、更换集合计划管理人、集合计划托管人、份额登记机构，集合计划改聘会计师事务所；
- 5、集合计划管理人委托相关服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托相关服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；
- 6、集合计划管理人、托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、集合计划管理人变更持有百分之十以上股权的股东、集合计划管理人的实际控制人变更；
- 8、集合计划管理人董事长、总经理及其他高级管理人员、集合计划经理和集合计划托管人集合计划托管部门负责人发生变动；
- 8、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基金托管部门负责人发生变动；
- 9、集合计划管理人的董事在最近 12 个月变更超过百分之五十，管理人、托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月变动超过百分之三十；
- 10、涉及集合计划财务、集合计划管理业务、集合计划托管业务的诉讼或仲裁；

11、集合计划管理或其高级管理人员、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基金托管部门负责人因集合计划托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

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

13、集合计划收益分配事项；

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

15、集合计划份额净值估值错误达集合计划份额净值百分之零点五；

16、本集合计划开始办理申购、赎回；

17、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；

18、本集合计划连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

19、本集合计划暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

20、发生涉及集合计划申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

21、集合计划管理人采用摆动定价机制进行估值；

22、集合计划信息披露义务人认为可能对集合计划份额持有人权益或集合计划份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （七）澄清公告

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

#### （八）集合计划份额持有人大会决议

集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （九）清算报告

集合计划合同终止的，管理人应当依法组织集合计划财产清算小组对集合计

划财产进行清算并作出清算报告。集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （十）投资资产支持证券的信息披露

集合计划管理人应在年报及中期报告中披露集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市场占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

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

#### （十一）投资国债期货的信息披露

集合计划管理人应当在集合计划季度报告、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。

#### （十二）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、集合计划合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。

#### （十三）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，指定专人负责管理信息披露事务。

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

集合计划托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和集合计划合同的约定，对集合计划管理人编制的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购赎回价格、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公开披露的相关集合计划信息进行复核、审查，并向集合计划管理人出具书面或者电子确认。

集合计划管理人、集合计划托管人应当在指定媒介中选择一家披露本集合计



划信息。管理人、托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的集合计划信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整和及时。

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信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

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

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

## **七、信息披露文件的存放与查阅**

招募说明书公布后，应当分别置备于集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划销售机构的住所，供公众查阅、复制。

集合计划定期报告公布后，应当分别置备于集合计划管理人和集合计划托管人的住所，以供公众查阅、复制。

## 第十七部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件和程序

当集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申购时，根据最大限度保护集合计划持有人利益的原则，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集合计划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后及时发布临时公告，并及时聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、实施侧袋机制期间集合计划份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，本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，确认集合计划份额持有人的相应侧袋账户份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申购，仅办理主袋账户份额的赎回申请并支付赎回款项。

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集合计划合同和招募说明书约定的政策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。本招募说明书“集合计划份额的申购、赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。

3、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。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的 10% 认定。

### 三、实施侧袋机制期间的集合计划投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“集合计划的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。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应当以主袋账户资产为基准。

集合计划管理人原则上应当在侧袋机制启动后 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、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款项。

终止侧袋机制后，集合计划管理人及时聘请符合《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。

#### **五、侧袋机制的信息披露**

##### **1、临时公告**

由启用侧袋机制、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”部分规定集合计划净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的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。

##### **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特定资产处置进展情况，披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，需同时注明不作为特定资产最终变现价格的承诺。

## 第十八部分 风险揭示

### 一、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致集合计划收益水平变化，产生风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险；

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。集合计划投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险；

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。集合计划投资于国债和股票，其收益水平会受到利率变化的影响；

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果集合计划所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使集合计划投资收益下降。虽然集合计划可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避；

5、购买力风险。集合计划的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使集合计划的实际收益下降。

6、信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

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

8、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，集合计划从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率。

## 二、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，造成管理风险。

## 三、流动性风险

流动性风险是指因证券市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地变现的风险。流动性风险还包括集合计划出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付所引致的风险。

### 1、集合计划申购、赎回安排

本集合计划的申购、赎回安排详见本招募说明书“集合计划份额的申购、赎回”章节。

### 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

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

### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

### 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

计划托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，集合计划管理人将严格依照法律法规及资产管理合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

#### 5、实施侧袋机制对投资者的影响

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，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以主袋账户资产为基准，不反映侧袋账户特定资产的真实价值及变化情况。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，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同确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

#### 四、其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 2、因业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险、如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- 4、对主要业务人员如集合计划经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；

6、不可抗力可能导致集合计划资产的损失，影响集合计划收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

## 五、本集合计划特有的风险

1、本合同签署后，对于法律法规规定和集合合同约定可不经份额持有人大会决议通过的事项，由管理人和托管人同意后变更并公告，并根据信息披露要求进行备案等操作。投资者可能面临由于上述原因发生合同变更的风险。

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

3、本集合计划 A 类计划份额只开放赎回，不开放申购。

本集合计划 B 类计划份额每个开放日开放申购，但本集合计划对集合计划份额持有人持有的 B 类计划份额均设置一年的最短持有期限。在最短持有期限内，B 类计划份额不能赎回；在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），B 类计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。

4、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集合计划份额。红利再投资的计算方法，依照相关规则执行。

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

本集合计划法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本集合计划的长期风险收益特征。销售机构(包括集合计划管理人直销机构和代销机构)根据相关法律法规对本集合计划进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机

构的风险等级评价与法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本集合计划时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。



## 第十九部分 集合计划合同的变更、终止和集合计划财产的清算

### 一、《集合计划合同》的变更

1、变更集合计划合同涉及法律法规规定或本集合计划合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的，应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和集合计划合同约定可不经集合计划份额持有人大会决议通过的事项，由集合计划管理人和集合计划托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《集合计划合同》变更的集合计划份额持有人大会决议自完成备案手续后方可执行，自决议生效后两日天在指定媒介公告。

### 二、《集合计划合同》的终止事由

有下列情形之一的，《集合计划合同》应当终止：

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

### 三、集合计划财产的清算

1、集合计划财产清算小组：自出现《集合计划合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，集合计划管理人组织集合计划财产清算小组并进行集合计划清算。

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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、集合计划财产清算程序：

- (1) 集合计划合同终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管集合计划；
- (2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

#### **四、清算费用**

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

#### **五、集合计划财产清算剩余资产的分配**

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

#### **六、集合计划财产清算的公告**

清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告。清算小组应将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### **七、集合计划财产清算账册及文件的保存**

集合计划财产清算账册及有关文件由集合计划托管人保存15年以上。

## 第二十部分 集合计划合同的内容摘要

### 一、集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划份额持有人的权利、义务

#### (一) 集合计划管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集资金；

(2) 自集合计划合同生效之日起，根据法律法规和集合计划合同独立运用并管理集合计划财产；

(3) 依照集合计划合同收取集合计划管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售集合计划份额；

(5) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；

(6) 依据集合计划合同及有关法律的规定监督集合计划托管人，如认为集合计划托管人违反了集合计划合同及国家有关法律的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护集合计划投资人的利益；

(7) 在集合计划托管人更换时，提名新的集合计划托管人；

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

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任集合计划登记机构办理集合计划登记业务并获得集合计划合同规定的费用；

(10) 依据集合计划合同及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；

(11) 在集合计划合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使权利，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) 在遵守届时有效的法律法规和监管规定，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，为支付本集合计划应付的赎回、交易清算等款项，集合计

划管理人有权代表集合计划份额持有人在必要限度内以集合计划资产作为质押进行融资；

(15) 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；

(16) 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；

(17) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关集合计划认购、申购、赎回、转换、非交易过户和定期定额投资等业务规则，在法律法规和本集合计划合同规定的范围内决定和调整集合计划的除管理费率、托管费率之外的集合计划相关费率结构和收费方式；

(18) 委托第三方机构办理本集合计划的交易、清算、估值、结算等业务；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他权利。

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

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

(2) 办理集合计划备案手续；

(3) 自集合计划合同生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划财产；

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

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

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

(7) 依法接受集合计划托管人的监督；

(8) 采取适当合理的措施使计算集合计划份额认购、申购、赎回和注销价格的方

法符合集合计划合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告集合计划资产净值，确定集合计划份额申购、赎回的价格；

（9）进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

（10）编制季度、中期和年度集合计划报告；

（11）严格按照《基金法》、集合计划合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

（12）保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、集合计划合同及其他有关法律法规或监管机构另有规定或要求外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但向监管机构、司法机关或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

（13）按集合计划合同的约定确定集合计划收益分配方案，及时向集合计划份额持有人分配集合计划收益；

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

（21）监督集合计划托管人按法律法规和集合计划合同规定履行自己的义务，集合计划托管人违反集合计划合同造成集合计划财产损失时，集合计划管理人应为集合

计划份额持有人利益向集合计划托管人追偿；

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

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

(24) 集合计划管理人在募集期间未能达到集合计划的备案条件，集合计划合同不能生效，集合计划管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在集合计划募集期结束后 30 日内退还集合计划认购人；

(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集合计划合同约定的其他义务。

(二) 集合计划托管人的权利与义务

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

(1) 自集合计划合同生效之日起，依法律法规和集合计划合同的规定安全保管集合计划财产；

(2) 依集合计划合同约定获得集合计划托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(3) 监督集合计划管理人对本集合计划的投资运作，如发现集合计划管理人有违反集合计划合同及国家法律法规行为，对集合计划财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护集合计划投资人的利益；

(4) 根据相关市场规则，为集合计划开设证券/期货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集合计划合同约定的其他权利。

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

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；
- (2) 设立专门的集合计划托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉集合计划托管业务的专职人员，负责集合计划财产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保集合计划财产的安全，保证其托管的集合计划财产与集合计划托管人自有财产以及不同的集合计划财产相互独立；对所托管的不同的集合计划分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同集合计划之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据《基金法》、集合计划合同及其他有关规定外，不得利用集合计划财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管集合计划财产；
- (5) 保管由集合计划管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设集合计划财产的资金账户和证券/期货账户等投资所需账户，按照集合计划合同的约定，根据集合计划管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守集合计划商业秘密，除《基金法》、集合计划合同其他有关法律法规或监管机构另有规定或要求外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但向监管机构、司法机关或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；
- (8) 复核、审查集合计划管理人计算的集合计划资产净值、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、中期和年度集合计划报告出具意见，说明集合计划管理人在各重要方面的运作是否严格按照集合计划合同的规定进行；如果集合计划管理人有未执行集合计划合同规定的行为，还应当说明集合计划托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (12) 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) 依据《基金法》、集合计划合同及其他有关规定，召集集合计划份额持有人大会或配合集合计划管理人、集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和集合计划合同的规定监督集合计划管理人的投资运作；

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

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

(19) 因违反集合计划合同导致集合计划财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督集合计划管理人按法律法规和集合计划合同规定履行自己的义务，集合计划管理人因违反集合计划合同造成集合计划财产损失时，应为集合计划份额持有人利益向集合计划管理人追偿；

(21) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他义务。

(三) 集合计划份额持有人

集合计划投资人持有本集合计划份额的行为即视为对集合计划合同的承认和接受，集合计划投资人自依据集合计划合同取得集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人，直至其不再持有本集合计划的集合计划份额。集合计划份额持有人作为集合计划合同当事人并不以在集合计划合同上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份集合计划份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享集合计划财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余集合计划财产；

(3) 依法申请赎回或转让其持有的集合计划份额；



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

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

(6) 查阅或者复制公开披露的集合计划信息资料；

(7) 监督集合计划管理人的投资运作；

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

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守《集合计划合同》、招募说明书等信息披露文件；

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

(3) 关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳集合计划认购、申购款项及法律法规和集合计划合同所规定的费用；

(5) 在其持有的集合计划份额范围内，承担集合计划亏损或者集合计划合同终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损集合计划及其他集合计划合同当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他义务。

## **二、集合计划份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则**

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

本集合计划份额持有人大会不设日常机构。

(一) 召开事由

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

(1) 终止集合计划合同（因不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的除外）；

(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独资或控股设立的子公司除外）；

(3) 更换集合计划托管人；

(4) 转换集合计划运作方式；

(5) 变更集合计划类别；

(6) 本集合计划与其他集合计划的合并；

(7) 变更集合计划份额持有人大会程序；

(8) 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；

(9) 单独或合计持有本集合计划总份额 10%以上（含 10%）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；

(10) 调整集合计划管理人、集合计划托管人的报酬标准；

(11) 变更集合计划投资目标、范围或策略；

(12) 对集合计划合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、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和其他应由集合计划承担的费用；

(2) 调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率或在对现有集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下变更收费方式；

(3) 在不违反法律法规、集合计划合同的规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，调整有关集合计划认购、申购、赎回、转换、非交易过户、

转托管等业务的规则；

(4) 在不违反法律法规、集合计划合同的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，增加、减少或调整集合计划份额类别设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整；

(5) 因相应的法律法规发生变动而应当对集合计划合同进行修改；

(6) 对集合计划合同的修改对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及集合计划合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(7) 当法律法规或中国证监会的相关规定变更时，本集合计划在履行相关程序后可对资产配置比例进行适当调整；

(8) 集合计划管理人更换为本集合计划管理人独资或控股设立的子公司；

(9) 按照法律法规和集合计划合同规定不需召开集合计划份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或集合计划合同另有约定外，集合计划份额持有人大会由集合计划管理人召集；

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

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

（三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

（5）会务常设联系人姓名及联系电话；

（6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

（7）召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次集合计划份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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和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投资人持有集合计划份额的凭证及投资人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《集合计划合同》和会议通知的规定，并且持有集合计划份额的凭证与集合计划管理人持有的登记资料相符；

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

2、通讯开会。通讯开会系指集合计划份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按集合计划合同约定通知集合计划托管人（如果集合计划托管人为召集人，则为集合计划管理人）到指定地点对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表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，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）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决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表决意见或授权他人代表出具表决意见；

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

3、在不与法律法规冲突的前提下，集合计划份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，集合计划份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

4、在不与法律法规冲突的前提下，集合计划份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

## (五) 议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系集合计划份额持有人利益的重大事项，如集合计划合同的重大修改、决定终止集合计划合同、更换集合计划管理人、更换集合计划托管人、与其他集合计划合并、法律法规及集合计划合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交集

合计划份额持有人大会讨论的其他事项。

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为集合计划管理人授权出席会议的代表，在集合计划管理人授权代表未能主持大会的情况下，由集合计划托管人授权其出席会议的代表主持；如果集合计划管理人授权代表和集合计划托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的集合计划份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名集合计划份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人。集合计划管理人和集合计划托管人拒不出席或主持集合计划份额持有人大会，不影响集合计划份额持有人大会作出的决议的效力。

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

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表

决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。转换集合计划运作方式、与其他集合计划合并、更换集合计划管理人或者集合计划托管人、终止集合计划合同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人身份文件的表决视为有效出席的投资人，表面符合会议通知规定的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，但应当计入出具表决意见的集合计划份额持有人所代表的集合计划份额总数。

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

在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的集合计划份额持有人大会通知为准。

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

（4）计票过程应由公证机关予以公证，集合计划管理人或集合计划托管人拒不出



席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在集合计划托管人授权代表（若由集合计划托管人召集，则为集合计划管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。集合计划管理人或集合计划托管人拒派代表对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依照《信息披露办法》有关规定在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告集合计划份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

### （九）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的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，集合计划管理人与集合计划托管人根据新颁布的法律法规或监管规则协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

### 三、集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算

#### （一）《集合计划合同》的变更

1、变更集合计划合同涉及法律法规规定或本集合计划合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的，应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和集合计划合同约定可不经集合计划份额持有人大会决议通过的事项，由集合计划管理人和集合计划托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《集合计划合同》变更的集合计划份额持有人大会决议自完成备案手续后方可执行，自决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

#### （二）《集合计划合同》的终止事由

有下列情形之一的，《集合计划合同》应当终止：

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

### （三）集合计划财产的清算

1、集合计划财产清算小组：自出现《集合计划合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，集合计划管理人组织集合计划财产清算小组并进行集合计划清算。

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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

（2）对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对集合计划财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对集合计划剩余财产进行分配。

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

### （四）清算费用

清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理

费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。

#### （五）集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）集合计划财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告。清算小组应将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （七）集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由集合计划托管人保存 15 年以上。

### 四、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因集合计划合同而产生的或与集合计划合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照上海国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

集合计划合同受中国法律管辖。

### 五、集合计划合同的效力

集合计划合同是约定集合计划合同当事人之间、集合计划与集合计划合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、集合计划合同经集合计划管理人、集合计划托管人双方加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章并自集合计划管理人公告生效之日起生

效。

2、集合计划合同的有效期限自其生效之日起至集合计划财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

3、集合计划合同自生效之日起对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在内的集合计划合同各方当事人具有同等的法律约束力。

4、集合计划合同正本一式六份，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。

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

## 第二十一部分 集合计划托管协议的内容摘要

### 一、集合计划托管协议当事人

#### (一) 管理人

名称：华安证券股份有限公司

住所：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

邮政编码：230000

法定代表人：章宏韬

成立日期：2001-01-08

批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行银复【1991】9 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：3,621,000,000 元

存续期间：持续经营

#### (二) 托管人

名称：上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：郑杨

成立日期：1992 年 10 月 19 日

批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1992]350 号

基金托管业务批准文号：证监基金字〔2003〕105 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：293.52 亿元人民币

存续期间：持续经营

### 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《集合计划合同》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：

本集合计划投资于具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、央行票据、金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、可转换债券(含可分离型可转换债券)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、债券回购、国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，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。

集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%，投资于可交换债券、可转换债券的比例不超过集合计划资产的20%，投资于股票等资产的比例合计不超过集合计划资产的20%，本集合计划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，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在1年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%。

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。

《集合计划合同》已明确约定集合计划投资风格或证券选择标准的，集合计划管理人应按照集合计划托管人要求的格式提供投资品种，以便集合计划托管人运用相关技术系统，对集合计划实际投资是否符合《集合计划合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本集合计划不得投资于相关法律、法规、部门规章及《集合计划合同》禁止投资的投资工具。

2.集合计划托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定对下述集合计划投融资比例进行监督：

（1）按法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，本集合计划的投资资产配置

比例为：

本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的 80%，投资于可交换债券、可转换债券的比例不超过集合计划资产的 20%，投资于股票等资产的比例合计不超过集合计划资产的 20%，本集合计划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，持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%。

因集合计划规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，集合计划管理人应在合理的期限内调整集合计划的投资组合，以符合上述比例限定。法律法规另有规定时，从其规定。

如法律法规或监管机构以后允许本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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

根据法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，本集合计划投资组合遵循以下投资限制：

1) 本集合计划对债券的投资比例不低于集合计划资产的 80%，投资于股票等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划资产的 20%；投资可交换债券、可转换债券（含可分离交易可转债）的比例不超过集合计划资产的 20%；

2) 本集合计划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，保留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

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%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

4) 本集合计划管理人管理的全部公募型集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

5) 本集合计划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%；在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购



到期后不得展期；

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

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

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

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

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

11) 本集合计划资产总值不得超过集合计划净资产的 140%；

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

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

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

15) 本集合计划参与国债期货交易，应当遵守下列要求：

a、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%；

b、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%；

c、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%；

d、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）应当符合集合计划合同关于债券投资比例的有关约定；

16) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他投资限制。

(3) 法律法规允许的集合计划投资比例调整期限

除上述第 2)、10)、12)、13) 项外，由于证券、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原因导致的投资组合不符合上述约定的比例，不在限制之内，但集合计划管理人应在 10 个交易日内进行调整，以达到规定的投资比例限制要求，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门对上述投资限制、投资禁止等作出强制性调整的，本集合计划应当按照法律法规或监管部门的规定执行；如法律法规或监管部门修改或调整上述投资限制、投资禁止性规定，且该等调整或修改属于非强制性的，集合计划管理人有权在履行适当程序后按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，并应向投资者履行信息披露义务。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。

集合计划管理人应在出现可预见资产规模大幅变动的情况下，至少提前 2 个工作日正式向集合计划托管人发函说明集合计划可能的变动规模和公司应对措施，便于集合计划托管人实施交易监督。

(4) 本集合计划可以按照国家的有关规定进行融资融券。

(5) 相关法律、法规或部门规章规定的其他比例限制。

集合计划托管人对集合计划投资的监督和检查自本托管协议生效之日起开始。

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

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，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其计划管理人、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。

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

4.集合计划托管人依据有关法律法规的规定和《集合计划合同》的约定对于集合计划关联投资限制进行监督。

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他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，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。相关交易必须按相关规定进行，并履行信息披露义务。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。

如法律、法规或《集合计划合同》有关于集合计划从事关联交易的规定，集合计划管理人和集合计划托管人事先相互提供与本机构有控股关系的股东、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清单,加盖公章并书面提交。集合计

划管理人有责任确保关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给集合计划托管人。名单变更后集合计划管理人应及时发送集合计划托管人，经集合计划托管人确认后，新的关联交易名单开始生效。集合计划托管人仅按集合计划管理人提供的集合计划关联方名单为限，进行监督。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关联交易，并造成集合计划资产损失的，由集合计划管理人承担责任。

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

集合计划管理人应注意控制交易对手的资信风险，由于交易对手的资信风险引起的损失，集合计划管理人应当负责向相关责任人追偿。

6.集合计划托管人依据有关法律法规的规定和《集合计划合同》的约定，对集合计划银行存款业务进行监督。

集合计划管理人应当加强对集合计划投资银行存款风险的评估与研究，严格测算与控制投资银行存款的风险敞口，针对不同类型存款银行建立相关投资限制制度。对于集合计划投资的银行存款，由于存款银行发生信用风险事件而造成损失时，先由集合计划管理人负责赔偿，之后有权要求相关责任人进行赔偿。如果集合计划托管人在运作过程中遵循有关法律法规的规定和《集合计划合同》的约定监督流程，则对于由于存款银行信用风险引起的损失，不承担赔偿责任。

#### 7.集合计划托管人对集合计划投资流通受限证券的监督

如下所指“流通受限证券”与本协议以及集合计划合同所指“流动性受限资产”定义存在不同。就流动性受限资产定义，请参照集合计划合同的“第二部分：释义”部分。

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

(1) 本集合计划投资的流通受限证券须为经中国证监会批准的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押

券等流通受限证券。本集合计划不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

(2) 集合计划管理人投资非公开发行股票，应制订流动性风险处置预案并经其董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的集合计划投资比例限制失调、集合计划流动性困难以及相关损失等问题的应对解决措施，以及有关异常情况的处置。集合计划管理人应在首次投资流通受限证券前向集合计划托管人提供集合计划投资非公开发行股票的相关流动性风险处置预案。

集合计划管理人对本集合计划投资流通受限证券的流动性风险负责，对相关风险需采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决集合计划运作的流动性问题。对本集合计划因投资流通受限证券导致的流动性风险，集合计划托管人不承担任何责任。如因集合计划管理人原因导致本集合计划出现损失的，集合计划托管人不承担任何责任。

(3) 集合计划管理人应在集合计划投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会指定媒体披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占集合计划资产净值的比例、锁定期等信息。

有关集合计划投资的流通受限证券应保证登记存管在相关集合计划名下，集合计划管理人负责相关工作的落实和协调，并保证集合计划托管人能够正常查询。如因流通受限证券的登记存管不能保证集合计划托管人正常履行资产保管责任，有关此项集合计划资产存管的责任不由托管人承担。

如集合计划管理人未遵守相关制度、流动性风险处置方案以及投资额度和比例限制要求，导致集合计划出现风险使乙方承担连带赔偿责任的，若集合计划托管人此前已切实履行监督职责的，集合计划管理人应赔偿集合计划托管人由此遭受的损失。

(4) 本集合计划投资非公开发行股票，集合计划管理人应至少于执行投资指令之前两个工作日将有关资料书面提交集合计划托管人，并保证向集合计划托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整，集合计划管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于：

- 1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。
- 2) 有关非公开发行股票的发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
- 3) 集合计划拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。
- 4) 该集合计划投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制

5) 集合计划托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定,对集合计划管理人是否遵守法律法规进行监督,并审核集合计划管理人提供的有关书面信息。集合计划托管人认为上述资料可能导致集合计划出现风险的,有权要求集合计划管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明,并保留查看集合计划管理人风险管理部门就集合计划投资流通受限证券出具的风险评估报告等资料的权利。否则,集合计划托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成集合计划财产损失的,集合计划托管人不承担任何责任,并有权报告中国证监会。

如集合计划管理人和集合计划托管人无法就上述问题达成一致,应及时上报中国证监会请求解决。集合计划托管人履行了本协议规定的监督职责后,不承担任何责任。

(5)相关法律法规对集合计划投资流通受限证券有新规定的,从其规定。

8. 集合计划托管人对集合计划投资中期票据的监督责任仅限于依据本协议相关规定对投资比例和投资限制进行事后监督;除此外,无其它监督责任。如发现异常情况,应及时以书面形式通知集合计划管理人。集合计划管理人应积极配合和协助集合计划托管人进行监督和核查。集合计划因投资中期票据导致的信用风险、流动性风险,集合计划托管人不承担任何责任。如因集合计划管理人原因导致集合计划出现损失的,集合计划托管人不承担任何责任。

集合计划管理人管理的集合计划在投资中期票据前,集合计划管理人须根据法律、法规、监管部门的规定,制定严格的关于投资中期票据的风险控制制度和流动性风险处置预案,管理人在此承诺将严格执行该风险控制制度和流动性风险处置预案。

(二)集合计划托管人应根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定,对集合计划资产净值计算、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》、《集合计划合同》、集合计划托管协议等有关规定时,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。

集合计划管理人应积极配合和协助集合计划托管人依照法律法规、《集合计划合同》和本托管协议对集合计划业务的监督和核查，对集合计划托管人发出的书面提示，必须在规定时间内答复集合计划托管人并改正，或就集合计划托管人的疑义进行解释或举证，对集合计划托管人按照法律法规、《集合计划合同》和本托管协议的要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的，集合计划管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

若集合计划托管人发现集合计划管理人发出但未执行的投资指令或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《集合计划合同》约定的，应当立即通知集合计划管理人，并报告中国证监会。集合计划管理人的上述违规失信行为给集合计划财产或集合计划份额持有人造成的损失，由集合计划管理人承担。

对于必须于估值完成后方可获知的监控指标或依据交易程序已经成交的投资指令，集合计划托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反《集合计划合同》约定的，应当立即通知集合计划管理人，并报告中国证监会。

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。

### **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是否安全保管集合计划财产、是否分别开设集合计划财产的资金账户和证券账户及投资所需其他账、是否复核集合计划管理人计算的集合计划资产净值和集合计划份额净值、是否根据集合计划管理人指令办理清算交收、进行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、无故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》、《集合计划合同》、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。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的，集合计划管理人应报告中国证监会。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业监督管理机构，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.集合计划托管人应按本协议规定安全保管托管财产。未经集合计划管理人的指令，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何财产（集合计划托管人主动扣收的汇划费除外）。集合计划托管人不对处于自身实际控制之外的账户及财产承担责任。
- 3.集合计划托管人按照规定为托管的集合计划财产开设资金账户和证券账户及投资所需其他账户。
- 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.对于因集合计划认（申）购、集合计划投资过程中产生的应收财产，应由集合计划管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知集合计划托管人，到账日集合计划财



产没有到达集合计划托管人处的，集合计划托管人应及时通知集合计划管理人采取措施进行催收。由此给集合计划造成损失的，集合计划管理人应负责向有关当事人追偿集合计划的损失，集合计划托管人对集合计划管理人的追偿行为应予以必要的协助与配合，但对集合计划财产的损失不承担责任。

## （二）募集资金的验证

华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划由华安理财 1 号稳定收益集合资产管理计划变更而来。原集合计划为非限定性集合资产管理计划，于 2011 年 8 月 26 日取得中国证监会《关于核准华安证券有限责任公司设立华安理财避险增利集合资产管理计划的批复》（证监许可【2011】1360 号），自 2012 年 2 月 24 日起开始募集并于 2012 年 3 月 30 日结束募集，于 2012 年 4 月 9 日经天职国际会计师事务所验资确认，2012 年 4 月 11 日发布公告正式成立。

根据中国证监会 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》的规定，原集合计划已完成产品的规范工作并向中国证监会申请合同变更。

## （三）集合计划资产托管专户的开立和管理

集合计划托管人以集合计划的名义在其营业机构开设资产托管专户，并根据集合计划管理人合法合规的有效指令办理资金收付。集合计划管理人应根据法律法规及托管行的相关要求，提供开户所需的资料并提供其他必要协助。本集合计划的资产托管专户的预留印鉴的印章由集合计划托管人刻制、保管和使用。

本集合计划的一切货币收支活动，均需通过集合计划托管人或集合计划的资产托管专户进行。集合计划的资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。除因本集合计划业务需要，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其他任何银行账户；亦不得使用以集合计划名义开立的银行账户进行本集合计划业务以外的活动。

资产托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《人民币利率管理规定》、《利率管理暂行规定》、《支付结算办法》以及银行业监督管理机构的其他有关规定。

## （四）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公司上海分公司/深圳分公司开立专门的证券账户。

集合计划证券账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。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本集合计划的任何证券账户；亦不得使用本集合计划的任何证券账户进行本集合计划业务以外的活动。

集合计划证券账户的开立和原始开户材料的保管由集合计划托管人负责，账户资产的管理和运用由集合计划管理人负责。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/深圳分公司开立结算备付金账户，集合计划托管人代表所托管的集合计划完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，集合计划管理人应予以积极协助。结算备付金、证券结算保证金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定和集合计划托管人为履行结算参与人的义务所制定的业务规则执行。

#### （五）银行间市场债券托管和资金结算专户的开立和管理及市场准入备案

《集合计划合同》生效后，在符合监管机构要求的情况下，集合计划管理人负责以集合计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表集合计划进行交易；集合计划托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以本集合计划的名义分别在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户和资金结算账户，并代表集合计划进行银行间市场债券交易的结算。集合计划托管人协助集合计划管理人完成银行间债券市场准入备案。

#### （六）其他账户的开设和管理

1、因业务发展而需要开立的其它账户，可以根据《集合计划合同》或有关法律法规的规定，经集合计划管理人和集合计划托管人协商一致后，由集合计划托管人负责为集合计划开立。新账户按有关规则使用并管理。

2、法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）集合计划投资银行存款账户的开立和管理

集合计划投资银行定期存款，集合计划管理人与集合计划托管人应比照相关规定，就本集合计划投资银行存款业务签订书面协议。

集合计划投资银行定期存款应由集合计划管理人与存款银行总行或其授权分行签订总体合作协议，并将资金存放于存款银行总行或其授权分行指定的分支机构。

存款账户必须以集合计划名义开立，账户名称为集合计划名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴及集合计划管理人公章。

本集合计划投资银行存款时，集合计划管理人应当与存款银行签订具体存款协议，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、账户管理等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

集合计划所投资定期存款存续期间，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对的真实、准确。

（八）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、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库。实物证券的购买和转让，由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实际有效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或保管的实物证券、银行定期存款存单对应的财产不承担保管责任。

（九）与集合计划财产有关的重大合同的保管

由集合计划管理人代表集合计划签署的与集合计划有关的重大合同的原件分别应由集合计划托管人、集合计划管理人保管。除本协议另有规定外，集合计划管理人在代表集合计划签署与集合计划有关的重大合同时，应保证集合计划一方持有两份以上的正本，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5个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达集合计划托管人处。合同原件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15年以上。

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与合同原件核对一致的并加盖集合计划管理人公章的合同传真件或复印件，未经双方协商一

致，合同原件不得转移。

## 五、指令的发送、确认和执行

集合计划管理人在运用集合计划财产时向集合计划托管人发送资金划拨及其他款项付款指令，集合计划托管人执行集合计划管理人合法合规且符合本协议相关约定的指令、办理集合计划名下的资金往来等有关事项。

### （一）集合计划管理人对发送指令人员的书面授权

集合计划管理人应向集合计划托管人提供预留印鉴和被授权人签字样本，事先书面通知（以下简称“授权通知”）集合计划托管人有权发送指令的人员名单，注明相应的交易权限，并规定集合计划管理人向集合计划托管人发送指令时集合计划托管人确认有权发送人员身份的方法。集合计划管理人的划款指令授权通知书由集合计划管理人的法定代表人或其授权代理人签署并加盖公章，若由授权代理人签署的，还应附上法定代表人的授权书。集合计划托管人在收到授权通知当日回函或回电向集合计划管理人确认。划款指令授权书无论产品成立时或后续更新，必须提前至少一个交易日，发送扫描件或其他集合计划托管人和集合计划管理人书面确认的方式向集合计划托管人发出加盖集合计划管理人公章，并由法定代表人或其授权代理人签字的被授权人变更通知，同时电话通知集合计划托管人。变更通知应载明生效时间，并提供新的被授权人的签字样本，集合计划托管人收到变更通知当日通过电话向集合计划管理人确认。授权变更于变更通知载明的生效时间起生效。若变更通知载明的生效时间早于集合计划托管人收到变更通知时间，则授权变更于集合计划托管人收到变更通知时生效。集合计划管理人在此后三日内将划款指令授权书变更通知的正本送交集合计划托管人划款指令授权书原件未按时送达托管人的，托管人不得拒绝执行划款指令。集合计划管理人和集合计划托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。，但法律法规或有权机关另有要求的除外。

### （二）指令的内容

1、指令是指集合计划管理人在运用集合计划财产时向集合计划托管人发送的付款指令（含赎回、分红付款、回购到期付款指令等）以及其它资金划拨的指令等，证券交易所证券投资基金的资金结算不需要集合计划管理人发送指令，集合计划托管人根据相关登记结算公司向集合计划托管人发送的结算数据进行资金结算。

2、集合计划管理人发给集合计划托管人的指令应写明付款账号、付款户名、开户行、收款账号、收款户名、开户行、款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户等，加盖预留印鉴并有被授权人签章。

### （三）指令的发送、确认和执行的程序和程序

指令由“授权通知”确定的有权发送人（下称“被授权人”）代表集合计划管理人用传真的方式或其他集合计划托管人和集合计划管理人书面确认过的方式向集合计划托管人发送。集合计划管理人有义务在发送指令后及时与集合计划托管人进行确认，因集合计划管理人未能及时与集合计划托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，集合计划托管人不承担任何责任。托管人若收到未确认的划款指令应当及时与管理人沟通。集合计划托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。对于被授权人发出的指令，集合计划管理人不得否认其效力。集合计划管理人应按照《基金法》、有关法律法规和《集合计划合同》的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，被授权人应按照其授权权限发送划款指令。集合计划管理人在发送指令时，应为集合计划托管人留出执行指令所必需的时间。由一般划款指令（不含非担保交收指令、新股、新债、增发等申购指令）应在 15 点（指令截至时间）前提交托管人，如集合计划管理人要求当天某一时点到账，则指令需提前 2 个工作小时（工作时间 9 点至 11 点 30 分，13 点至 17 点）提交托管人。具体指令的时间不受前述的时间点限制，以管理人的具体指令为准。

新股、新债、增发等申购指令，集合计划管理人须在申购前 1 个工作日向集合计划托管人发送指令，如需在申购当日下达指令，集合计划管理人应为集合计划托管人留出执行指令所必需的时间，指令最迟不得晚于上午 11:00 点（指令截至时间）提交集合计划托管人。

如划款指令中给予集合计划托管人的划拨时间小于 2 个工作小时或晚于前述指令截至时间的，集合计划托管人应尽力在指定时间内完成资金划拨，但不承担因时间不足导致执行失败的责任。

集合计划管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由集合计划管理人承担。集合计划管理人应在交易结束后将同业市场债券交易成交单加盖预留印鉴后及时传真或者邮件给集合计划托管人并

电话通知集合计划托管人。

指令到达集合计划托管人后,集合计划托管人应指定专人及时对指令的要素是否齐全、印鉴与被授权人是否与预留的授权文件内容相符进行检查,如发现问题或有疑问应及时通知集合计划管理人,并有权立即将指令退还给集合计划管理人,要求其重新下达有效指令。

集合计划管理人向集合计划托管人下达指令时,应确保相关托管账户有足够的资金余额,对集合计划管理人在没有充足资金的情况下向集合计划托管人发出的指令,集合计划托管人有权不予执行,并立即通知集合计划管理人,集合计划托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的任何责任。

集合计划管理人应将同业市场国债交易通知单加盖预留印鉴后传真或者邮件给集合计划托管人。

#### (四) 集合计划管理人发送错误指令的情形和处理程序

集合计划管理人发送错误指令的情形包括但不限于指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误,指令中重要信息模糊不清或不全,指令违反法律法规和《集合计划合同》及本协议约定等。

集合计划托管人在履行监督职能时,如发现集合计划管理人的指令错误,有权拒绝执行,并及时以书面形式或者电话及邮件通知集合计划管理人改正,集合计划管理人收到通知后应及时核对,并以书面形式或者电话及邮件对集合计划托管人发出回函确认。如需撤销指令,集合计划管理人应出具书面说明,并加盖预留印鉴。

#### (五) 集合计划托管人未按照集合计划管理人指令执行的处理方法

除本协议另有约定外,集合计划托管人由于自身原因造成未按照或者未及时按照集合计划管理人发送的符合本协议约定的、按照正常交易程序已经生效的指令执行,给集合计划份额持有人造成损失的,应负责赔偿相应的直接损失。

#### (六) 更换被授权人的程序

集合计划管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权范围的,必须提前至少一个交易日,发送扫描件或其他集合计划托管人和集合计划管理人书面确认的方式向集合计划托管人发出加盖集合计划管理人公章,并由法定代表人或其授权代理人签字的被授权人变更通知,同时电话通知集合计划托管人。变更通知应载明生效时间,

并提供新的被授权人的签字样本。集合计划托管人收到变更通知当日将通过电话向集合计划管理人确认。授权变更于变更通知载明的生效时间起生效。若变更通知载明的生效时间早于集合计划托管人收到变更通知时间，则授权变更于集合计划托管人收到变更通知时生效。被授权人变更通知生效前，集合计划托管人仍应按原约定执行指令，集合计划管理人不得否认其效力。集合计划管理人在此后三日内将被授权人变更通知的正本送交集合计划托管人。如果集合计划管理人授权人员名单、权限有变化时，未能按本协议约定及时通知集合计划托管人并预留新的印鉴和签章样本而导致集合计划份额持有人受损的，集合计划托管人不承担任何形式的责任。集合计划托管人更换接受集合计划管理人指令的人员，应提前通过邮件、传真或录音电话等方式通知集合计划管理人。

#### （七）其它事项

集合计划管理人承担下达违法、违规或违反《集合计划合同》和本协议约定的指令所导致的责任。集合计划托管人对执行集合计划管理人的按照正常交易程序已经生效的指令对集合计划财产造成的损失不承担赔偿责任。

### 六、交易及清算交收安排

#### （一）选择代理证券、期货买卖的证券、期货经营机构的标准和程序

集合计划管理人负责选择代理本集合计划证券买卖的证券经营机构。

集合计划管理人负责根据相关标准以及内部管理制度对有关证券经营机构进行考察后确定代理本集合计划证券、期货买卖证券经营机构，并承担相应责任。集合计划管理人和被选择的证券经营机构签订交易单元使用协议，由集合计划管理人通知集合计划托管人，并在法定信息披露公告中披露有关内容。

集合计划管理人应及时将集合计划专用交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知集合计划托管人，并将被选中证券经营机构提供的《交易单元租用协议》及时送达集合计划托管人，确保集合计划托管人申请接收结算数据。

集合计划管理人负责选择代理本集合计划期货交易的期货经纪机构，并与其签订期货经纪合同，其他事宜根据法律法规、《集合计划合同》的相关规定执行，若无明确规定的，可参照有关证券买卖、证券经纪机构选择的规则执行。

#### （二）集合计划投资证券后的清算交收安排

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

2、本集合计划投资于场内交易的投资品种前，集合计划管理人和集合计划托管人应当另行签署托管银行证券资金结算协议。

3、本集合计划投资于非担保交收的投资品种时，集合计划管理人应遵守集合计划托管人提前以告客户书形式提供的书面通知。

#### 4、银行间债券券款对付结算

集合计划管理人应及时将银行间上清所、中债登划款指令和成交通知单按相关规定提交集合计划托管人，集合计划管理人应为集合计划托管人留出执行指令所必需的时间。

投资管理人应根据中债登、上清所提供的查询功能，实时跟踪交易结算情况、证券与资金到账与余额变动情况，便于监控结算过程，做好资金与交易匹配的前端控制。

5、定期投资集合计划管理人与存款行签订的存款协议条款格式应在定期存款起息日的前一个工作日发送给托管人，集合计划管理人应将定期存款的划款指令及存款协议盖章版（传真件或扫描件）按法律法规、集合计划合同及托管协议的规定提交集合计划托管人，指令发出后，集合计划管理人应及时以电话方式向集合计划托管人确认。对于集合计划管理人依约定程序发出的指令，集合计划管理人不得否认其效力。

集合计划管理人在发送投资指令时，应为集合计划托管人执行投资指令留出执行指令所必需的时间。投资指令传输不及时、未能留出足够的划款时间，导致资金未能及时到账所造成的损失由集合计划管理人承担。

存款银行无法在存入当日 17 点前向托管人送达存款证实书的，投资管理人应敦促存款银行将存款证实扫描件发送至托管人。存款证实书送达托管人后，托管人负责保管存款证实书原件。托管人仅对存款证实书进行形式审核，形式审核内容为账户名称、起息日、到期日、金额、利率。托管人不对存款证实书真实性承担审核职责。

投资管理人与存款银行签订的存款协议，应包括：

（1）存款银行为托管资产办理定期存款业务的存款账户开立、资金存入和支取提供必要的支持和高效的结算服务；

（2）存款银行为托管资产所投资的定期存款的存款证明文件提供上门服务，即：



定期存款资金到账当日，存款银行派授权代理人将“存款证实书”（以下简称“证实书”）妥善送至托管人处。“证实书”移交给托管人之前，因“证实书”丢失、损毁而造成的一切损失由存款银行承担。

（3）定期存款到期日当日或提前支取日当日，存款银行应派授权代理人前往托管人处提取“证实书”。“证实书”移交给存款行授权代理人之后，因“证实书”丢失、损毁而造成的一切损失由存款银行承担。

存款银行应至少提前一个工作日向托管人提供对前述授权代理人办理相关事务的书面授权书。授权代理人提供上门服务时，应出示有效身份证或工作证。

（4）存款银行应保证及时支付存款本金和利息，于支取当日将本息划付至企业年金开立在托管人（上海浦东发展银行）处的托管账户，并列明账户的开户行、账号、户名、大额支付号。存款银行应确认，定期存款的本息只能划入开立在托管人的相应托管账户或经托管人确认的指定账户。上述指定收款账户信息如需变更，必须经托管人书面同意。

（5）存款银行应为定期存款业务提供定期对账服务。首次对账应不晚于存款资金存入后的一个自然月。除首次对账外，对账频率不少于每半年一次。存款银行应配合托管人对“证实书”的书面征询。

（6）在存款存续期内，“证实书”的预留印鉴发生变更的，存款银行应配合办理变更手续。

6、本集合计划拟投资于期货市场前，集合计划管理人、期货经纪机构及集合计划托管人应当另行签署股指期货投资托管协议。

### （三）可用资金余额的确认

集合计划托管人应于每个工作日上午 9:30 前将托管账户的可用资金余额以双方认可的方式提供给集合计划管理人。

### （四）交易记录、资金、证券账目的核对

#### 1、交易记录的核对

集合计划管理人和集合计划托管人按日进行交易记录的核对。每日对外披露净值之前，必须保证当天所有实际交易记录与集合计划会计账簿上的交易记录一致。

#### 2、资金账目的核对

资金账目包括集合计划的银行存款等会计资料。资金账目由集合计划托管人每日进行账实核对，集合计划管理人复核托管人提供的可用头寸表核对资金余额。银行存款账户每日核对，做到账账相符、账实相符。

### 3、证券账目的核对

证券账目是指以集合计划名义开立的证券交易账户和实物托管账户中的证券种类、数量和金额。集合计划管理人和集合计划托管人每月核对证券账目余额。证券交易所证券账目每交易日结束后核对一次，银行间市场证券账目每月末核对一次，确保账实相符。

#### （五）集合计划申购、赎回、转换业务处理的基本规定

1、本集合计划自《集合计划合同》生效后不超过3个月的时间起开始办理申购与赎回，具体办理时间以公告为准。集合计划份额申购、赎回的确认、清算由集合计划管理人或其委托的注册登记机构负责。

2、集合计划管理人应在每个开放日按本协议第七条相关规定向集合计划托管人发送集合计划管理人确认的申购、赎回和转换开放式集合计划的有关数据，并对上述数据的真实、准确、完整性负责。集合计划托管人应及时查收申购及转入资金的到账情况并根据集合计划管理人指令及时划付赎回及转出款项。集合计划管理人应保证本集合计划（或本集合计划管理人委托）的注册登记机构每个工作日15:00前向集合计划托管人发送前一开放日的上述有关数据，并保证相关数据的准确、完整。

3、集合计划管理人通过与集合计划托管人建立的共同约定的数据传送系统发送申购赎回等有关数据，如因各种原因，该系统无法正常发送，双方可协商解决处理方式。由此引起集合计划或本协议一方损失的，由系统无法正常传送数据的一方承担赔偿责任，但不可抗力导致的情形除外；若由双方共同引起，根据各自过错程度承担相应责任。集合计划管理人向集合计划托管人发送的数据，双方各自按有关规定保存。

4、集合计划管理人应保证其发送的注册登记数据的接口规范与集合计划托管人的接口规范保持一致。

#### 5、集合计划注册登记清算专用账户的开立和管理

为满足申购、赎回等资金汇划的需要，集合计划管理人应开立用于集合计划申购、赎回等资金清算的集合计划注册登记清算专用账户。

6、对于集合计划申购过程中产生的应收资产，应由集合计划管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知集合计划托管人，到账日集合计划资产没有到达集合计划托管人处的，集合计划托管人应及时通知集合计划管理人采取措施进行催收，由此给集合计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿集合计划的损失，集合计划托管人不承担任何责任。

#### 7、赎回资金的支付

集合计划托管人在根据集合计划管理人指令支付赎回款时，如托管专户中本集合计划有足够的资金，集合计划托管人应按《集合计划合同》和本协议的规定支付；如托管专户中本集合计划有足额的资金且集合计划托管人有足够合理的时间进行划款，而集合计划托管人未及时执行合法合规的指令的，责任由集合计划托管人承担，但不可抗力导致的情形除外。因托管专户中本集合计划没有足够的资金，导致集合计划托管人不能按时支付，如是集合计划管理人的原因造成，责任由集合计划管理人承担，集合计划托管人不承担垫款义务；如是除集合计划管理人、集合计划托管人外的第三方原因造成的，责任由第三方承担，集合计划托管人不承担垫款义务，若给集合计划份额持有人造成损失的，集合计划托管人负有配合集合计划管理人向第三方追偿的义务。

#### 8、资金支付执行和责任界定

除申购款项到达集合计划托管人处的集合计划账户需双方按约定方式对账外，净额划出、赎回资金支付时，应按照本协议相关规定执行。若本协议没有规定的按双方协商一致内容执行。

集合计划管理人和集合计划托管人应采取所有必要措施确保申购和赎回等资金在本协议相关规定的时间内划到指定账户。但由于集合计划管理人和集合计划托管人之外的第三方原因、不可抗力原因导致资金不能按时到账的，集合计划管理人和集合计划托管人不承担由此产生的责任。如因此给集合计划造成损失的，集合计划管理人应负责向第三方追偿，集合计划托管人有义务协助追偿。

#### 9、暂停赎回和巨额赎回处理

集合计划管理人应严格按照相关法律法规以及《集合计划合同》的规定，对暂停赎回的情形进行相应处理，并在发生暂停赎回的当日及时以双方认可的形式通知集合计划托管人。集合计划管理人应严格按照相关法律法规以及《集合计划合同》的规定，

对巨额赎回的情形进行相应处理，并在决定部分延期赎回的当日及时以双方认可的形式通知集合计划托管人。

#### （六）申购赎回资金结算

1、T+1 日前（含 T+1 日，T 日为申请日），集合计划管理人负责根据 T 日投资人申购、赎回集合计划的确认数据汇总传输给集合计划托管人。集合计划管理人和集合计划托管人据此进行申购的集合计划会计处理。

T 日申购、赎回申请对应的款项分别在 T+2 日、T+3 日进行交收。集合计划托管账户与“集合计划清算账户”间的资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每日按照托管账户应收资金与应付资金的差额来确定当日托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。

当存在托管账户净应付额时，如集合计划银行账户有足够的资金，集合计划托管人应按时拨付；因集合计划银行账户没有足够的资金，导致集合计划托管人不能按时拨付，集合计划托管人应及时通知集合计划管理人，如系集合计划管理人的原因造成，责任由集合计划管理人承担，集合计划托管人不承担垫款义务。

#### （七）集合计划转换

集合计划管理人与集合计划托管人按照相关法律法规、《集合计划合同》、以及本协议的规定办理集合计划转换。

#### （八）集合计划出现超买或超卖的责任认定及处理程序

集合计划托管人在履行监督职能时，如果发现集合计划投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒集合计划管理人，由集合计划管理人负责解决，由此给集合计划及集合计划托管人造成的损失由集合计划管理人承担。如果非因集合计划托管人原因发生超买行为，集合计划管理人必须于 T+1 日上午 12 时之前划拨资金，用以完成清算交收。

### 七、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负债后的价值。集合计划份额净值是指计算日集合计划资产净值除以该计算日集合计划份额总份额后的数值。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。

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,仍无法达成一致意见的,按照集合计划管理人对集合计划资产净值的计算结果对外予以公布。每个交易日,集合计划管理人应对集合计划资产估值。但集合计划管理人根据法律法规或集合计划合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合《集合计划合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。集合计划管理人应于每个交易日交易结束后计算当日的集合计划份额净值和集合计划资产净值并以双方认可的方式与集合计划托管人核对。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,由集合计划管理人约定对外公布。

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。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资产净值的计算结果对外予以公布。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。

## (二) 集合计划资产估值

估值原则应符合《集合计划合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定的约定。

当相关法律法规或《集合计划合同》规定的估值方法不能客观反映集合计划财产公允价值时,集合计划管理人可根据具体情况,并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。

## (三) 估值错误处理

1.当集合计划份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时,视为集合计划份额净值错误;集合计划份额净值出现错误时,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;错误偏差达到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;

错误偏差达到集合计划份额净值的 0.5%时，集合计划管理人应当公告；当发生净值计算错误时，由集合计划管理人负责处理，由此给集合计划份额持有人和集合计划造成损失的，托管人给予协助，应由集合计划管理人先行赔付，集合计划管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿，集合计划托管人不承担任何责任。

2.当因集合计划管理人和集合计划托管人原因致使集合计划份额净值计算差错给集合计划和集合计划份额持有人造成损失需要进行赔偿时，集合计划管理人和集合计划托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

(1) 本集合计划的集合计划会计责任方由集合计划管理人担任，与本集合计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按集合计划管理人的建议执行，由此给集合计划份额持有人和集合计划财产造成的直接损失，由集合计划管理人负责赔付。(2) 若集合计划管理人计算的集合计划份额净值已由集合计划托管人复核确认后公告，而且集合计划托管人未对计算过程提出疑义或要求集合计划管理人书面说明的，在集合计划份额净值出错且造成集合计划份额持有人直接损失的，应根据法律法规的规定对集合计划份额持有人或集合计划支付赔偿金，对于向集合计划份额持有人或集合计划支付的赔偿金额，集合计划管理人与集合计划托管人按照各自收取的管理费和托管费的比例承担相应的责任。(3) 如集合计划管理人和集合计划托管人对集合计划份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布集合计划份额净值的情形，以集合计划管理人的计算结果对外公布，由此给集合计划份额持有人和集合计划造成的直接损失，由集合计划管理人负责赔付。(4) 由于集合计划管理人提供的信息错误（包括但不限于集合计划申购或赎回金额等），导致集合计划份额净值计算错误而引起的集合计划份额持有人和集合计划财产的损失，由集合计划管理人负责赔付。

3.由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误、有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，致使集合计划管理人和集合计划托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是仍未能发现该错误而造成的集合计划份额净值计算错误，集合计划管理人、集合计划托管人免除赔偿责任。但集合计划管理人、集合计划托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

4.集合计划管理人和集合计划托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾

差，以集合计划管理人计算结果为准。

5.前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护集合计划份额持有人利益的原则进行协商。

6.中国证监会和《集合计划合同》认定的其他情形。

#### （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《集合计划合同》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资产净值的计算和公告的，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。

管理人在每个季度结束之日起 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。

集合计划管理人在 5 个工作日内完成月度报告，在月度报告完成当日，对报告加盖公章后，以加密传真方式将有关报告提供集合计划托管人复核；集合计划托管人在 3 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面通知集合计划管理人。集合计划管理人在 7 个工作日内完成季度报告，在季度报告完成当日，将有关报告提供集合计划托管人复核，集合计划托管人在收到后 7 个工作日内进行复核，并将复核结果书面通知集合计划管理人。集合计划管理人在 30 日内完成中期报告，在中期完成当日，将有关报告提供集合计划托管人复核，集合计划托管人在收到后 30 日内进行复核，并将复核结果书面通知集合计划管理人。集合计划管理人在 45 日内完成年度报告，在年度报告完成当日，将有关报告提供集合计划托管人复核，集合计划托管人在收到后 45 日内复核，

并将复核结果书面通知集合计划管理人。

集合计划托管人在复核过程中，发现相关各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，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。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印鉴或者出具加盖托管业务部门业务章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果集合计划管理人与集合计划托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，集合计划管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，集合计划托管人有权就相关情况报证监会备案。

集合计划托管人在对财务会计报告、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。

## **八、集合计划收益分配**

### **（一）集合计划收益分配的原则**

集合计划收益分配是指将该集合计划可供分配利润按收益分配方案确定的分配金额和比例根据持有该集合计划份额的数量按比例向该集合计划份额持有人进行分配。

收益分配应该符合《集合计划合同》关于收益分配原则的规定。

### **（二）集合计划收益分配方案的制定和实施程序**

集合计划收益分配方案由集合计划管理人根据《集合计划合同》的相关规定制定。

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。复核通过后集合计划管理人应当将收益分配方案报中国证监会和集合计划管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案，并及时公告；如果集合计划管理人与集合计划托管人不能于收益分配日之前就收益分配方案达成一致，集合计划托管人有义务将收益分配方案及相关情况的说明提交中国证监会备案并书面通知集合计划管理人，在上述文件提交完毕之日起集合计划管理人有权对外公告其拟订的收益分配方案，且集合计划托管人有义务协助集合计划管理人实施该收益分配方案，但有证据证明该方案违反法律法规及《集合计划合同》的除外。

## **九、信息披露**

### **（一）保密义务**

除按照《基金法》、《信息披露办法》、《集合计划合同》及中国证监会关于集合



计划信息披露的有关规定进行披露以外，集合计划管理人和集合计划托管人对集合计划运作中产生的信息以及从对方获得的业务信息应恪守保密的义务。集合计划管理人与集合计划托管人对集合计划的任何信息，除法律法规规定之外，不得在其公开披露之前，先行对任何第三方披露。但是，如下情况不应视为集合计划管理人或集合计划托管人违反保密义务：

1.非因集合计划管理人和集合计划托管人的原因导致保密信息被披露、泄露或公开；

2.集合计划管理人和集合计划托管人为遵守和服从法院判决、仲裁裁决或中国证监会等监管机构的命令、决定所做出的信息披露或公开。

## （二）信息披露的内容

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

本集合计划的信息披露主要包括集合计划招募说明书、《集合计划合同》、集合计划托管协议、集合计划产品资料概要、集合计划份额发售公告、《集合计划合同》生效公告、定期报告、临时公告、集合计划资产净值和集合计划份额净值等其他必要的公告文件，由集合计划管理人拟定并负责公布。

集合计划管理人与集合计划托管人应严格遵守《集合计划合同》所规定的信息披露要求。集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划业绩表现数据、集合计划定期报告和定期更新的招募说明书、集合计划产品资料概要、清算报告等公开披露的相关集合计划信息按有关规定需经集合计划托管人复核的，须由集合计划托管人进行复核、审查，并向集合计划管理人出具书面或者电子确认。相关信息经集合计划托管人复核无误后方可公布。其他不需经集合计划托管人复核的信息披露内容，应及时告知集合计划托管人。

年度报告中的财务报告部分，需经有证券业务从业资格的会计师事务所审计后，方可披露。

集合计划管理人应当在中国证监会规定的时间内，将应予披露的集合计划信息通过中国证监会指定的全国性报刊及指定的互联网网站等媒介披露。根据法律法规应由集

合计划托管人公开披露的信息，集合计划托管人将通过指定的全国报刊及指定的互联网网站公开披露。

指定网站包括管理人网站、托管人网站、中国证监会基金电子披露网站。指定网站应当无偿向投资者提供信息披露服务。

### （三）集合计划管理人和集合计划托管人在信息披露中的职责和信息披露程序

#### 1、职责

集合计划托管人和集合计划管理人在信息披露过程中应以保护集合计划份额持有人利益为宗旨，诚实信用，严守秘密。集合计划管理人负责办理应由集合计划管理人负责的与集合计划有关的信息披露事宜，对于本条第（二）款规定的应由集合计划托管人复核的事项，应提前通知集合计划托管人，集合计划托管人应在接到通知后的规定时间内予以书面答复。

#### 2、程序

按有关规定须经集合计划托管人复核的信息披露文件，由集合计划管理人起草，并经集合计划托管人复核后由集合计划管理人公告。

发生《集合计划合同》中规定需要披露的事项时，按《集合计划合同》规定公告。

#### 3、信息文本的存放

予以披露的信息文本，存放在集合计划管理人、集合计划托管人的住所、集合计划上市交易的证券交易所，集合计划份额持有人和公众投资者可以免费查阅。在支付工本费后可以获得上述文件的复制件或复印件。

集合计划管理人和集合计划托管人应保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

#### 4、暂停或延迟披露集合计划相关信息的情形

（1）集合计划投资涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因停市时；

（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）中国证监会和《集合计划合同》认定的其他情形。集合计划管理人和集合计划托管人应根据相关法律法规、《集合计划合同》的规定各自承担相应的信息披露职责。集合计划管理人和集合计划托管人负有积极配合、互相督促、彼此监督、保证其履行按照法定方式和时限披露的义务。

根据《信息披露办法》的要求，本集合计划信息披露的文件包括集合计划招募说明书、《集合计划合同》、集合计划托管协议、集合计划份额发售公告、《集合计划合同》生效公告、定期报告、临时报告、集合计划资产净值和集合计划份额净值等其他必要的公告文件，由集合计划管理人拟定并负责公布。

集合计划托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和《集合计划合同》的约定，对集合计划管理人编制的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划业绩表现数据、集合计划定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关集合计划信息进行复核、审查，并向集合计划管理人出具书面文件或者盖章确认。

集合计划年报中的财务报告部分，经有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露。

集合计划管理人应当在中国证监会规定的时间内，将应予披露的集合计划信息通过中国证监会指定的全国性报刊和集合计划管理人的互联网网站等媒介披露。根据法律法规应由集合计划托管人公开披露的信息，集合计划托管人将通过指定报刊或集合计划托管人的互联网网站公开披露。

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

#### （四）暂停或延迟信息披露的情形

- 1.集合计划投资所涉及的证券交易所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.法律法规、中国证监会或《集合计划合同》认定的其他情形。

### 十、集合计划费用

集合计划费用按照《集合计划合同》的约定计提和支付。

### 十一、集合计划份额持有人名册的保管

集合计划管理人妥善保管的集合计划份额持有人名册，包括《集合计划合同》生效日、《集合计划合同》终止日、集合计划份额持有人大会权利登记日、每年6月30日、12月31日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集合计划注册登记机构根据集合计划管理人的指令编制和保管，集合计划管理人应按照目前相关规则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。保管期限为 15 年，法律法规或监管部门另有规定的除外。

在集合计划托管人编制中期报告和年度报告前，集合计划管理人应将每年 6 月 30 日、12 月 31 日的集合计划持有人名册送交集合计划托管人，文件方式可以采用电子或文档的形式并且保证其的真实、准确、完整。集合计划托管人应妥善保管，不得将持有人名册用于集合计划托管业务以外的其他用途。

## **十二、集合计划有关文件和档案的保存**

### **（一）档案保存**

集合计划管理人和集合计划托管人应按各自职责完整保存本集合计划的集合计划账册、原始凭证、记账凭证、交易记录、公告、重要合同等相关资料，承担保密义务并按规定的期限保管。集合计划管理人应保存集合计划财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，集合计划托管人应保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料。保存期限不少于 15 年，法律法规或监管部门另有规定的除外。

### **（二）合同档案的建立**

1、集合计划管理人或集合计划托管人在签署与本集合计划有关的合同文本后，应及时按相关法律法规及本协议的规定将合同正本或副本提交对方。

2、集合计划管理人和集合计划托管人应按各自职责保管就集合计划资产对外签署的全部合同的正本。

### **（三）变更与协助**

若集合计划管理人和集合计划托管人发生变更，未变更的一方有义务协助变更后的接任人接收相应文件。

## **十三、集合计划管理人和集合计划托管人的更换**

### **（一）集合计划管理人的更换**

#### **1.集合计划管理人的更换条件**

有下列情形之一的，集合计划管理人职责终止：

- (1) 被依法取消集合计划管理资格；
- (2) 被集合计划份额持有人大会解任；
- (3) 依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- (4) 法律法规和《集合计划合同》规定的其它情形。

## 2. 更换集合计划管理人的程序

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

(2) 决议：集合计划份额持有人大会在集合计划管理人职责终止后 6 个月内对被提名的集合计划管理人形成决议，该决议需经参加大会的集合计划份额持有人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）表决通过；

(3) 临时集合计划管理人：新任集合计划管理人产生之前，由中国证监会指定临时集合计划管理人；

(4) 备案：集合计划份额持有人大会更换计划管理人的决议须报中国证监会备案；

(5) 公告：集合计划管理人更换后，由集合计划托管人在中国证监会核准后 2 日内在至少一家指定媒体公告。新任集合计划管理人与原任集合计划管理人进行资产管理的交接手续，并与集合计划托管人核对资产总值。如果集合计划托管人和集合计划管理人同时更换，由新任的集合计划管理人和新任的集合计划托管人在中国证监会批准后 2 日内在至少一家指定媒体公告；集合计划管理人应妥善保管集合计划管理业务资料，及时向临时集合计划管理人或新任集合计划管理人办理集合计划管理业务的移交手续，临时集合计划管理人或新任集合计划管理人应及时接收；

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

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

3. 原任集合计划管理人职责终止后，新任集合计划管理人或临时集合计划管理人接受集合计划管理业务前，原任集合计划管理人和集合计划托管人需采取审慎措施确保

集合计划财产的安全，不对集合计划份额持有人的利益造成损失，并有义务协助新任集合计划管理人或临时集合计划管理人尽快恢复集合计划财产的投资运作。

## （二）集合计划托管人的更换

### 1.集合计划托管人的更换条件

有下列情形之一的，集合计划托管人职责终止：

- (1) 被依法取消集合计划托管人资格；
- (2) 被集合计划份额持有人大会解任；
- (3) 依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- (4) 法律法规和《集合计划合同》规定的其它情形。

### 2.更换集合计划托管人的程序

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

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

（3）临时集合计划托管人：新任集合计划托管人产生之前，由中国证监会指定临时集合计划托管人；

（4）核准：集合计划份额持有人大会更换计划托管人的决议须报中国证监会备案；

（5）公告：集合计划托管人更换后，由集合计划管理人在中国证监会核准后 2 日内在至少一家指定媒体公告。新任集合计划托管人与原集合计划托管人进行资产托管的交接手续，并与集合计划管理人核对资产总值。如果集合计划托管人和集合计划管理人同时更换，由新任的集合计划管理人和新任的集合计划托管人在中国证监会批准后 2 日内在至少一家指定媒体公告；

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

3.原集合计划托管人职责终止后，新任集合计划托管人或临时集合计划托管人接受集合计划财产和集合计划托管业务前，原集合计划托管人和集合计划管理人需采取审慎措施确保集合计划财产的安全，不对集合计划份额持有人的利益造成损失，并有义

务协助新任集合计划托管人或临时集合计划托管人尽快交接集合计划资产。

(三) 集合计划管理人和集合计划托管人的同时更换程序

同时更换集合计划管理人和集合计划托管人,分别按照上述集合计划管理人和集合计划托管人更换程序进行。

#### 十四、禁止行为

托管协议当事人禁止从事的行为,包括但不限于:

(一) 集合计划管理人、集合计划托管人将其固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资。

(二) 集合计划管理人、集合计划托管人不公平地对待其管理或托管的不同集合计划财产。

(三) 集合计划管理人、集合计划托管人利用集合计划财产为集合计划份额持有人以外的第三人牟取利益。

(四) 集合计划管理人、集合计划托管人向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失。

(五) 集合计划管理人、集合计划托管人对他人泄漏集合计划经营过程中任何尚未按法律法规规定的方式公开披露的信息。

(六) 集合计划管理人在没有充足资金的情况下向集合计划托管人发出投资指令和赎回、分红资金的划拨指令,或违规向集合计划托管人发出指令。

(七) 集合计划托管人对集合计划管理人的符合本协议约定的有效指令拖延或拒绝执行。

(八) 集合计划管理人、集合计划托管人在行政上、财务上不独立,其高级集合计划管理人员相互兼职。

(九) 集合计划托管人私自动用或处分集合计划资产,根据集合计划管理人的合法指令、集合计划合同或托管协议的规定进行处分的除外。

(十) 集合计划管理人、集合计划托管人不得利用集合计划财产用于下列投资或者活动:(1) 承销证券;(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;(3) 从事承担无限责任的投资;(4) 买卖其他集合计划份额,但是法律法规或中国证监会另有规定的除外;(5) 向其计划管理人、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。

计划管理人运用集合计划财产买卖计划管理人、计划托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合中国证监会的规定，并履行信息披露义务。

（十一）法律法规和集合计划合同禁止的其他行为，以及依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止集合计划管理人、集合计划托管人从事的其他行为。

（十二）法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本集合计划，集合计划管理人有权在履行适当程序后按照法律法规或监管部门调整或修改后的规定执行，并应向投资者履行信息披露义务。

## 十五、集合计划托管协议的变更、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《集合计划合同》的规定有任何冲突，并需经集合计划管理人、集合计划托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代理人签字（或盖章）确认。集合计划托管协议的变更报中国证监会备案。

#### 2. 集合计划托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

（1）《集合计划合同》终止；

（2）集合计划托管人解散、依法被撤销、破产或有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、破产或有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《集合计划合同》规定的终止事项。

### （二）集合计划财产的清算



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

2.在集合计划财产清算小组接管集合计划财产之前，集合计划管理人和集合计划托管人应按照《集合计划合同》和本托管协议的规定继续履行保护集合计划财产安全的职责。

3.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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

4.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。

5.集合计划财产清算程序：

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

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报告中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配；

6.清算费用

清算费用是指集合计划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清算小组优先从集合计划财产中支付。

7.集合计划财产按下列顺序清偿：

(1)支付清算费用；

(2)交纳所欠税款；

(3)清偿集合计划债务；

(4)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。

集合计划财产未按前款(1)–(3)项规定清偿前，不分配给集合计划份额持有人。

### (三) 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。

### (四) 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由集合计划托管人保存15年以上，法律法规或监管部门另有规定的除外。

## 十六、违约责任

(一) 如果由于集合计划管理人或集合计划托管人的过错，不履行本协议或者违反本协议约定的，有过错的一方应当承担违约责任，给另一方当事人造成损失的，应就直接损失进行赔偿。如果由于双方的过错，不履行本协议或者违反本协议约定的，应根据实际情况，由双方分别承担各自应负的违约责任，给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况，当事人免责：

1.集合计划管理人及集合计划托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

2.在没有欺诈或过失的情况下，集合计划管理人由于按照本《集合计划合同》规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等；

3. 发生自然灾害等不可抗力情形；

4.计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击、法律法规变化、注册与过户登记人非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等、证券交易所及登记结算公司发送的数据错误及其它集合计划管理人及集合计划托管人不可控制的因素导致业务出现差错，集合计划管理人和集合计划托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成集合计划

财产或投资人损失，集合计划管理人和集合计划托管人免除赔偿责任。但是集合计划管理人和集合计划托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(三) 在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护集合计划份额持有人利益的前提下，《集合计划合同》能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

### **十七、适用法律及争议解决方式**

(一) 本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律），并从其解释。

(二) 相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海市，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

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

### **十八、集合计划托管协议的效力和文本**

(一) 本协议经集合计划管理人、集合计划托管人双方法定代表人或授权代理人签字（或盖章）并加盖公章（或合同专用章）后成立。本协议以中国证监会注册的文本为正式文本。

(二) 本协议自《集合计划合同》生效之日起生效，有效期自其生效之日起至该集合计划财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

(三) 本协议自生效之日起对各当事人具有同等的法律约束力。

(四) 本协议一式陆份，除上报有关监管机构贰份外，集合计划管理人和集合计划托管人分别持贰份，每份具有同等的法律效力。

### **十九、其他事项**

(一) 双方在此确认，双方均已充分了解和知悉各方反对其员工利用职务之便谋取

任何形式利益之立场，并承诺将本着廉洁公平原则避免此类情形，不向对方的员工私自提供任何形式的回扣、礼金、有价证券、贵重物品、各种奖励、私人费用补偿、私人旅游、高消费娱乐等不当利益。

（二）本协议未尽事宜，当事人依据《集合计划合同》以及有关法律、法规和规定协商办理。

（三）双方约定的其他事项

本协议存续期内，集合计划管理人应依据法律法规履行相应反洗钱义务，并主动配合托管账户开立结算银行根据监管部门有关反洗钱要求开展客户身份识别工作，提供真实、准确、完整的客户资料，遵守各方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，任何一方有权按照中国人民银行反洗钱监管规定采取必要管控措施。

## 第二十二部分 集合计划份额持有人服务

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

### 一、资料寄送

投资人更改个人信息资料，请利用以下方式进行修改：到原开立集合计划账户的销售网点，登录集合计划管理人网站进行或投资者本人致电客服中心。在从销售机构获取准确的客户地址和邮编的前提下，集合计划管理人将负责寄送集合计划投资人对账单：

集合计划管理人每年（1月份）向所有的集合计划份额持有人以书面或电子文件形式寄送一次对账单。对账单在每年（12月份）结束后的7个工作日内寄出。

### 二、定期定额投资计划

本集合计划可通过销售机构为投资人提供定期定额投资的服务，即投资人可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购集合计划份额。定期定额投资不受最低申购金额限制，具体实施时间和业务规则将在本集合计划开放申购赎回后公告。

### 三、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，在条件成熟的情况下提供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服务。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。

### 四、客户服务中心电话服务

投资人可在交易日的9:00--20:00拨打集合计划管理人客服热线95318（国内免长途话费），通过该热线获得投资咨询、业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

### 五、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过集合计划管理人客户服务中心人工热线、在线客服、微客服、书信、电子邮件、短信、传真及各销售机构网点柜台等不同的渠道对集合计划管理人和

销售网点所提供的服务进行投诉或提出建议。

六、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系本集合计划管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十三部分 其他应披露事项

本集合计划的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并至少在一种指定媒介上公告。

公告事项	披露日期
关于增加珠海盈米基金销售有限公司为华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划代销机构的公告	2023/6/9
华安证券股份有限公司高级管理人员变更公告	2023/5/5
华安证券睿赢一年持有 2023 年一季度报告	2023/4/23
华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划 2022 年年度报告	2023/3/31
华安证券股份有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为华安证券旗下集合资产管理计划销售机构的公告	2023/3/13
华安证券睿赢一年持有 2022 年四季度报告	2023/1/28
华安证券股份有限公司关于增加上海攀赢基金销售有限公司为华安证券旗下集合资产管理计划销售机构的公告	2022/12/15
华安证券股份有限公司关于增加上海万得基金销售有限公司为华安证券旗下集合资产管理计划销售机构的公告	2022/11/30
华安证券股份有限公司关于增加泛华普益基金销售有限公司为华安证券旗下集合资产管理计划销售机构的公告	2022/10/31
华安证券股份有限公司关于增加京东肯特瑞基金销售有限公司为华安证券旗下集合资产管理计划销售机构的公告	2022/10/31
华安证券股份有限公司关于增加上海联泰基金销售有限公司为华安证券旗下集合资产管理计划销售机构的公告	2022/10/27
华安证券股份有限公司关于增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为华安证券旗下集合资产管理计划销售机构的公告	2022/10/26
华安证券睿赢一年持有 2022 年三季度报告	2022/10/26
关于增加北京汇成基金销售有限公司为华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划代销机构的公告	2022/9/1
华安证券睿赢一年持有 2022 年中期报告	2022/8/31
华安证券股份有限公司关于增加泰信财富基金销售有限公司为华安证券旗下集合资产管理计划销售机构的公告	2022/8/26
华安证券股份有限公司关于增加北京雪球基金销售有限公司为旗下集合资产管理计划代销机构的公告	2022/8/17
华安证券睿赢一年持有 2022 年二季度报告	2022/7/20
关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划代销机构的公告	2022/7/6
华安证券股份有限公司关于旗下部分大集合产品投资资产支持证券方案的公告	2022/6/17
华安证券股份有限公司关于增加大连网金基金销售有限公司为华安证券旗下集合资产管理计划销售机构的公告	2022/6/9

关于增加上海云湾基金销售有限公司为华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划代销机构的公告	2022/5/31
关于增加南京苏宁基金销售有限公司为华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划代销机构的公告	2022/5/31
关于增加上海利得基金销售有限公司为华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划代销机构的公告	2022/5/30
华安证券股份有限公司关于增加财咨道信息技术有限公司为华安证券旗下集合资产管理计划销售机构的公告	2022/5/23
华安证券睿赢一年持有 2022 年一季度报告	2022/4/22
华安证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	2022/4/2
华安证券股份有限公司关于增加北京度小满基金销售有限公司为华安证券旗下集合资产管理计划销售机构的公告	2022/2/9
华安证券股份有限公司关于旗下参公运作集合资产管理计划执行新金融工具相关会计准则的公告	2022/1/4
华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	2021/12/6
华安理财 1 号稳定收益集合资产管理计划变更生效暨华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划合同生效的公告	2021/12/3
华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书	2021/11/30
华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议	2021/11/30
华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划基金合同	2021/11/30
华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	2021/11/30



## 第二十四部分 招募说明书存放及其查阅方式

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。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

## 第二十五部分 备查文件

备查文件等文本存放在集合计划管理人、集合计划托管人的住所，投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，资产管理合同条款及内容应以资产管理合同正本为准。

- （一）《华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划集合计划合同》
- （二）《华安证券睿赢一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议》
- （三）法律意见书
- （四）集合计划管理人业务资格批件、营业执照
- （五）集合计划托管人业务资格批件、营业执照
- （六）中国证监会要求的其他文件

华安证券股份有限公司

2023年7月7日