

中信建投证券股份有限公司

中信建投悠享 12 个月持有期债券型  
集合资产管理计划招募说明书

管理人：中信建投证券股份有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司

二零二三年十月

---

---

## 重要提示

中信建投悠享 12 个月持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）由中信建投季享收益集合资产管理计划变更而来。中信建投季享收益集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，自 2013 年 5 月 16 日起开始募集，于 2013 年 5 月 22 日结束募集工作，并于 2013 年 5 月 27 日正式成立。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，中信建投季享收益集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，《中信建投悠享 12 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》自本集合计划管理人公告的生效之日起生效，原《中信建投季享收益集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会批准，但中国证监会对中信建投季享收益集合资产管理计划变更为本集合计划的批准，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。

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

投资有风险，投资者在投资本集合计划之前，请仔细阅读本集合计划的招募说明书、集合计划合同、产品资料概要等信息披露文件，全面认识本集合计划的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期收益和预期风险通常高于货币市场基金，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。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，管理人不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。投资者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，理性判断市场，承担集合计划投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于投资者连续大量赎回集合计划份额产生的流动性风险、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、本集合计划的特定风险等等。

本集合计划对每份集合计划份额设置 12 个月的最短持有期。在每份集合计划份额的最短持有期内，投资者不能就该集合计划份额提出赎回申请及转换转出申请；每份集合计划份额的最短持有期结束日的下一个工作日（含）起，集合计划份额持有人可就该份额提出赎回申请及转换转出申请。对于每份集合计划份额，最短持有期指自集合计划份额申购确认日（含）（对于申购份额而言）或集合计划份额转换转入确认日（含）（对于转换转入份额而言）起至 12 个月后对应日（不含）（如该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日）的期间。由红利再投资而来的集合计划份额不受最短持有期的限制。因此，集合计划份额持有人将面临在最短持有期内不能赎回或转换转出集合计划份额的风险。

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

本集合计划可投资于证券公司发行的短期公司债券，由于证券公司发行的短期公司债券非公开发行和交易，且限制投资者数量上限，潜在流动性风险相对较大。若发行主体信用质量恶化或投资者大量赎回需要变现资产时，受流动性所限，本集合计划可能无法卖出所持有的证券公司短期公司债券，由此可能给集合计划净值带来不利影响或损失。

本集合计划可投资于国债期货。国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价

---

---

差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

本集合计划的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本集合计划的过往业绩并不预示其未来表现，管理人管理的其他产品的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。管理人提醒投资者投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，集合计划运营状况与集合计划净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

## 目 录

重要提示 .....	2
第一部分 绪言 .....	1
第二部分 释义 .....	2
第三部分 管理人 .....	1
第四部分 托管人 .....	18
第五部分 相关服务机构 .....	22
第六部分 集合计划的历史沿革 .....	24
第七部分 集合计划的存续 .....	25
第八部分 集合计划份额的申购与赎回 .....	26
第九部分 集合计划的投资 .....	38
第十部分 集合计划的财产 .....	46
第十一部分 集合计划资产估值 .....	47
第十二部分 集合计划的收益与分配 .....	54
第十三部分 集合计划费用与税收 .....	56
第十四部分 集合计划的会计与审计 .....	59
第十五部分 集合计划的信息披露 .....	60
第十六部分 侧袋机制 .....	67
第十七部分 风险揭示 .....	70
第十八部分 集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算 .....	76
第十九部分 集合计划合同的内容摘要 .....	78
第二十部分 集合计划托管协议的内容摘要 .....	95
第二十一部分 对集合计划份额持有人的服务 .....	115
第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式 .....	116
第二十三部分 备查文件 .....	117

---

---

## 第一部分 绪言

《中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“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销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关规定以及《中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合计划合同”或“《集合计划合同》”）编写。

本招募说明书阐述了中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读招募说明书。

管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本集合计划是根据本招募说明书所载明的资料申请销售的。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。

本招募说明书依据集合计划合同编写，并经中国证监会批准。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。投资者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》、集合计划合同及其它有关规定享有权利，承担义务。

投资者欲了解集合计划份额持有人的权利和义务，应详细查阅集合计划合同。

## 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、集合资产管理计划：指中信建投证券股份有限公司设立管理的投资者人数不受200人限制的集合资产管理计划

2、集合计划或本集合计划：指中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划

3、管理人：指中信建投证券股份有限公司

4、托管人：指兴业银行股份有限公司

5、集合计划合同、《集合计划合同》：指《中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》及对集合计划合同的任何有效修订和补充

6、托管协议：指管理人与托管人就本集合计划签订之《中信建投悠享12个月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

7、招募说明书或《招募说明书》：指《中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

8、产品资料概要：指《中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新

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》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《销售办法》：指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的，并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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、合同当事人：指受集合计划合同约束，根据集合计划合同享有权利并承担义务的法律主体，包括管理人、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集合资产管理计划的自然人

19、机构投资者：指依法可以投资集合资产管理计划的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

20、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的集合资产管理计划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《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定，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集合资产管理计划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：指管理人或销售机构宣传推介集合计划，办理集合

---

计划份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

25、销售机构：指中信建投证券股份有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与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。本集合计划的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

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、管理人所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《中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》的生效日，原《中信建投季享收益集合资产管理计划集合资产管理合同》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《中信建投季享收益集合资产管理计划集合资产管理合同》生效至集合计划合同终止之间的不定期期限

33、最短持有期限：对于每份集合计划份额，指自集合计划份额申购确认日（含）（对于申购份额而言）或集合计划份额转换转入确认日（含）（对于转换转入份额而言）起至12个月后对应日（不含）（如该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日）的期间。在每份集合计划份额最短持有期限内，集合计划份额持有人不能就该集合计划份额提出赎回申请或转换转出申请

34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

35、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

- 36、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)
- 37、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
- 38、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
- 39、《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，是规范管理人所管理的并由中国证券登记结算有限责任公司办理登记业务的集合资产管理计划登记方面的业务规则
- 40、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
- 41、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和招募说明书规定的条件要求将集合计划份额兑换为现金的行为
- 42、集合资产管理计划转换：指集合计划份额持有人按照集合计划合同和管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有管理人管理的、某一集合资产管理计划的份额转换为管理人管理的其他集合资产管理计划份额的行为
- 43、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
- 44、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理集合计划申购申请的一种投资方式
- 45、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%
- 46、元：指人民币元
- 47、集合计划收益：指集合计划投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用集合计划财产带来的成本和费用的节约
- 48、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
- 49、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

50、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

51、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

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

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

54、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

55、摆动定价机制：指当开放式集合资产管理计划遭遇大额申购赎回时，通过调整集合资产管理计划份额净值的方式，将集合资产管理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资产管理计划份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

56、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，包括但不限于地震、台风、水灾、火灾、战争、社会动乱、流行病、传染病以及其他突发性公共卫生事件、政府行为、罢工、停工、通讯故障、电力故障等，以及非因管理人、托管人自身原因导致的设备故障、技术系统异常事故、法律法规调整等情形。因交易所、银行、登记结算机构的交易、结算系统出现故障导致的交易、结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致资金划付的网络中断、无法使用的情形，亦构成不可抗力事件。

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

---

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、份额类别：指本集合计划根据申购费及销售服务费收取方式等的不同，将集合计划份额分为不同的类别

60、A类份额：指在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别集合计划资产中计提销售服务费的集合计划份额。原中信建投季享收益集合资产管理计划份额转为A类份额

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

### 第三部分 管理人

#### 一、管理人概况

名称：中信建投证券股份有限公司（以下简称“中信建投证券”）

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 188 号

成立日期：2005 年 11 月 2 日

法定代表人：王常青

联系电话：4008-888-108

联系人：杨照

注册资本：7,756,694,797 元人民币

股权结构：中信建投证券股份有限公司为 A+H 上市公司。截至 2022 年 12 月 31 日，公司股权结构如下表所示：

股东名称	股份种类	股份数量（股）	占股份总数的比例
A 股公众股东	A 股	6,495,671,035	83.74%
其中：			
北京金融控股集团 有限公司	A 股	2,684,309,017	34.61%
中央汇金投资有 限责任公司	A 股	2,386,052,459	30.76%
中信证券股份有 限公司	A 股	382,849,268	4.94%
其他 A 股股东	A 股	1,042,460,291	13.44%
H 股公众股东	H 股	1,261,023,762	16.26%
合计		7,756,694,797	100%

二、主要人员情况

1、集合计划管理人董事会、监事会成员、高级管理人员

姓名	主要工作经历
王常青	<p>王常青先生，1963 年 6 月生，中信建投证券党委书记、董事长、执行董事、执行委员会主任，代总经理，代财务负责人。王先生于 2005 年 11 月加入中信建投证券，自 2007 年 2 月起担任执行董事，自 2011 年 9 月起担任党委书记，自 2011 年 9 月起担任董事长、执行委员会主任，自 2012 年 7 月起兼任中信建投国际董事，自 2017 年 7 月起兼任中安汇信投资管理有限公司董事长。王先生目前还担任中国证券业协会兼职副会长、中国证券业协会投资银行业专业委员会主任委员、北京证券业协会理事长、上交所第五届理事会会员理事。王先生自 1984 年 8 月至 1986 年 9 月任职北京冶炼厂，曾任铜粉分厂副厂长；自 1986 年 10 月至 1992 年 11 月任职北京市有色金属工业总公司，曾任生产计划处副处长；自 1992 年 11 月至 1993 年 10 月任职北京凯宝旅游食品公司，任董事、副总经理；自 1993 年 10 月至 1999 年 9 月任职日本大和证券集团北京代表处，曾任股票承销部负责人；自 1999 年 10 月至 2005 年 11 月任职中信证券股份有限公司（一间于香港联交所（股份代号：06030）以及于上交所（股份代号：600030）上市的公司），曾任上海投资银行部总经理、投资银行总部副总经理、投资银行业务行政负责人、董事总经理并兼任企业融资委员会副主任；自 2005 年 11 月至 2011 年 9 月曾任中信建投证券副总经理、总经理、执行委员会委员。王先生于 1984 年 7 月自东北工学院（现东北大学）取得工学学士学位，于 2002 年 1 月自中国人民大学取得经济学硕士学位。</p>
武瑞林	<p>武瑞林先生，1964 年 9 月生。武瑞林先生担任本公司副董事长，现任中央汇金投资有限责任公司派出董事。武瑞林先生曾任中国人民银行北京市分行调研信息处物价调查统计科副科长、外资管理处金融机构管理科副科长、外资管理处副处长、外汇管理处副处长（主持工作）、外汇调剂中心副主任（主持工作），国家外汇管理局信息中心综合处副处长、规划处处长，国家外汇管理局人事司（内审司）副司长，中共国家外汇管理局机关党委专职副书记兼机关纪委书记，国家外汇管理局管理检查司副司长、经常项目管理司副司长、</p>

	<p>二级巡视员，中国建银投资有限责任公司董事。武瑞林先生自中共中央党校取得经济管理专业硕士研究生学历，具有经济师资格。</p>
李岷	<p>李岷先生，1976 年 9 月生。李岷先生担任本公司副董事长，现任北京金融控股集团有限公司副总经理，兼任北京金融大数据有限公司董事长。李岷先生曾任中国工商银行股份有限公司个人金融业务部理财产品销售管理处副处长、私人银行部专家团队部副总经理，华夏银行股份有限公司个人业务部副总经理、资产管理部副总经理（主持工作）、资产管理部总经理、副行长，还曾兼任华夏理财有限责任公司筹备组组长、董事长。李岷先生自山西财经大学取得国际金融专业学士学位，自中国农业大学取得农业经济管理专业硕士学位，具有经济师资格。</p>
朱佳	<p>朱佳女士，1982 年 10 月生，中信建投证券非执行董事。朱女士自 2018 年 4 月起担任中信建投证券董事，自 2019 年 4 月起担任北京金控集团投资管理部总经理助理，自 2020 年 10 月起担任璟泉资本管理（北京）有限公司董事。朱女士自 2004 年 11 月至 2009 年 12 月在东亚银行（香港）北京分行任职；自 2010 年 1 月至 2019 年 4 月在北京国管中心任职。朱女士于 2004 年 11 月自英国埃克塞特大学取得金融与投资硕士学位，于 2010 年 11 月取得金融经济师职称。</p>
王华	<p>王华女士，1976 年 8 月生，中信建投证券董事。王华女士自 2001 年 7 月至今任职于中国中信集团有限公司，曾历任中国中信集团有限公司财务部税务处处长、财务部总经理助理兼税务处处长、财务部副总经理兼税务处处长，现任中国中信集团有限公司财务部副总经理，并自 2019 年 8 月至今担任中信重工机械股份有限公司（一间于上海证券交易所上市的公司）董事。王华女士于 1998 年 7 月自东北财经大学取得会计专业学士学位，于 2001 年 7 月自东北财经大学取得会计专业硕士学位。</p>
杨栋	<p>杨栋先生，1976 年 7 月生，中信建投证券董事。杨栋先生自 2010 年 12 月至今任职于中央汇金投资有限责任公司，现担任中央汇金投资有限责任公司董事总经理。杨栋先生曾任职于中国人民银行天津分行、中国人民银行金融研究所等机构；自 2010 年 12 月起任职于中央汇金投资有限责任公司，曾担任银行部高级副经理、银行机构管理一部工行股权管理处处长及股权管理一部</p>

	<p>工行股权管理处处长、高级经理等职务。杨栋先生自中国人民大学取得经济学博士学位，具有高级经济师职称。</p>
郑伟	<p>郑伟先生，1974 年 3 月生。郑先生自 2023 年 10 月起担任中信建投证券独立非执行董事，现任北京大学经济学院风险管理与保险学系教授、系主任，北京大学中国保险与社会保障研究中心主任，兼任现代财产保险（中国）有限公司独立董事、施罗德基金管理（中国）有限公司独立董事、上海南燕信息技术有限公司董事、人保再保险股份有限公司外部监事。郑先生曾任北京大学经济学院风险管理与保险学系主任助理、系副主任，曾任新华人寿保险股份有限公司独立董事、东海航运保险股份有限公司独立董事、中信银行股份有限公司外部监事。郑先生自北京大学经济学院获得经济学学士学位、硕士学位与博士学位。</p>
浦伟光	<p>浦伟光先生，1957 年生，中信建投证券独立非执行董事。浦先生自 2020 年 12 月至今担任光大证券股份有限公司独立董事及香港联交所独立董事。目前还担任中国证监会国际顾问委员会委员和香港恒生指数顾问委员会委员。浦先生曾任香港保监局执行董事，香港证监会高级总监。浦先生拥有香港中文大学工商管理学士学位和工商管理硕士学位，也是一位会计师。</p>
赖观荣	<p>赖观荣先生，1962 年生，中信建投证券独立非执行董事。赖先生自 2015 年 1 月至今担任北京中关村科学城建设股份有限公司监事会主席，自 2013 年 2 月至今担任农银人寿保险股份有限公司副董事长，自 2015 年 4 月至今担任中科实业集团(控股)有限公司董事，自 2015 年 6 月至今担任中软国际有限公司独立董事，自 2018 年 8 月至今担任深圳远致富海投资管理有限公司首席经济学家、投委会委员，自 2018 年 9 月至今担任信源企业集团有限公司独立董事。赖先生曾任闽发证券有限责任公司副总经理(主持工作)，中国人民银行福建省分行办公室副主任，福建省闽南侨乡信托投资公司总经理，华福证券有限责任公司总裁，嘉禾人寿保险股份有限公司党委书记、总裁。赖先生拥有厦门大学财政金融专业学士学位，中国人民银行研究生部货币银行学硕士学位及厦门大学经济学博士学位。</p>
吴溪	<p>吴溪先生，1977 年 11 月生，中信建投证券独立非执行董事。现任中央财经大学会计学院教授，院长，兼任信美人寿相互保险社独立董事，大家保险集</p>

	<p>团有限责任公司独立董事。吴先生自浙江财经学院(现浙江财经大学)获得会计学专业学士学位，自中央财经大学获得会计专业硕士学位与博士学位。</p>
张峥	<p>张峥先生，1972 年 8 月生，中信建投证券独立非执行董事。现任北京大学光华管理学院教授，副院长，兼任建信信托有限责任公司独立董事，哈尔滨银行股份有限公司(香港联交所上市公司)独立董事。张先生自南开大学获得应用数学专业学士学位与硕士学位，自北京大学获得金融学博士学位。</p>
闫小雷	<p>闫小雷先生，1975 年 7 月生。闫小雷先生自 2023 年 5 月起担任本公司董事，现任北京金融控股集团有限公司财务负责人、首席投资官；璟泉私募基金管理（北京）有限公司董事长、北京金控资本有限公司董事。闫小雷先生曾任北京汽车股份有限公司董事会秘书、北京汽车集团有限公司证券与金融总监。近三年来，闫小雷先生曾任北京汽车股份有限公司（香港联交所上市公司）董事、北汽蓝谷新能源科技股份有限公司（上交所上市公司）董事、渤海汽车系统股份有限公司（上交所上市公司）董事。闫小雷先生自财政部财政科学研究所（现中国财政科学研究院）取得会计专业管理学博士学位，具有正高级经济师职称，持有中国注册会计师、特许金融分析师（CFA）资格。</p>
周笑予	<p>周笑予先生，1964 年 6 月生，中信建投证券党委副书记、监事会主席。周先生于 2005 年 11 月加入中信建投证券，自 2013 年 7 月起担任党委委员并自 2021 年 3 月起担任党委副书记，自 2021 年 8 月起担任监事会主席；自 2012 年 8 月起兼任中信建投期货有限公司董事。周先生目前还担任中国证券业协会融资类业务委员会委员。周笑予先生分别自 1985 年 8 月至 1988 年 8 月以及自 1991 年 8 月至 1993 年 2 月任轻工业部广州设计院助理工程师及工程师；自 1993 年 2 月至 2005 年 11 月任职华夏证券股份有限公司，曾任深圳分公司常务副总经理、大连业务部总经理、沈阳分公司总经理、经纪业务管理总部总经理；自 2005 年 11 月至 2011 年 11 月曾任中信建投证券经纪业务管理部总经理、资金运营部行政负责人、融资融券业务部行政负责人；自 2011 年 11 月至 2021 年 7 月曾任中信建投证券党委办公室主任、人力资源部行政负责人；自 2016 年 1 月至 2021 年 7 月曾任中信建投证券执行委员会委员。周笑予先生于 1985 年 7 月自天津轻工业学院取得工学学士学位，于 1991 年 7 月自华南理工大学取得工学硕士学位。</p>

艾波	艾波女士，1971 年 2 月生，中信建投证券监事。艾女士自 2016 年 8 月起担任中信建投证券监事，自 2008 年 6 月起任职中国投资有限责任公司并自 2020 年 6 月起担任中国投资有限责任公司党委巡视办主任。艾女士自 1991 年 7 月至 2008 年 5 月任职原国家监察部办公厅机要秘书处、中央纪委监察综合室、中央纪委第二纪检监察室。艾女士于 2015 年 6 月自昆明理工大学取得管理学硕士学位，于 2014 年 6 月取得注册企业风险管理师资质。
王晓光	王晓光先生，1977 年 3 月生，中信建投证券监事。王晓光先生自 2016 年 6 月至今任职于中国投资有限责任公司，现任中国投资有限责任公司审计部审计三组组长。王晓光先生自山西大学获得会计学专业学士学位，具有高级审计师资格。
董洪福	董洪福先生，1968 年 10 月生。董洪福先生自 2023 年 5 月起担任本公司监事，现任北京金融控股集团有限公司风险管理部总经理。董洪福先生曾任中国银行北京市分行首都机场支行人事科副科长，北京京华会计师事务所审计部经理，中国人民银行营业管理部股份制商业银行监管处干部，国家外汇管理局北京外汇管理部外汇检查处干部、主任科员，中国人民银行楚雄彝族自治州中心支行副行长，中国人民银行营业管理部调查统计处副处长、金融稳定处处长、法律事务处（金融消费者权益保护处）处长。董洪福先生自中国社会科学院研究生院取得金融学专业博士学位，具有高级经济师资格。
林焯	林焯女士，1972 年 2 月生，中信建投证券党委委员、职工监事。林女士于 2005 年 11 月加入中信建投证券，自 2018 年 4 月起担任职工监事，自 2018 年 7 月起担任内核部行政负责人，自 2018 年 8 月起担任党委委员。林女士目前还担任北京市金融工会委员。林女士自 1997 年 4 月至 2005 年 11 月任职华夏证券股份有限公司，曾任投资银行部、并购业务部业务董事、总经理助理；自 2005 年 11 月至 2018 年 7 月历任投资银行部总经理助理、总监、执行总经理、董事总经理。林女士于 1994 年 7 月自中国人民大学取得经济学学士学位，于 1997 年 6 月自中国人民银行研究生部（现中国清华大学五道口金融学院）取得经济学硕士学位，于 2009 年 7 月自中国社会科学院研究生院取得经济学博士学位（在职攻读），于 2004 年获得 A 股保荐代表人资格。
赵明	赵明先生，1971 年 5 月生，中信建投证券职工监事、计划财务部行政负责人、

	<p>资金运营部行政负责人。赵先生自 2018 年 7 月起担任公司计划财务部、资金运营部行政负责人，自 2019 年 4 月起担任职工监事。赵先生自 1993 年 7 月至 1998 年 8 月任职于广东省惠州市大亚湾公安局；自 2001 年 7 月至 2003 年 3 月任职于华夏证券股份有限公司投资银行部；自 2003 年 4 月至 2005 年 5 月任上海电气集团财务有限责任公司投资银行部经理；自 2005 年 6 月至 2005 年 10 月任华夏证券股份有限公司投资银行部高级业务董事；自 2005 年 11 月至 2010 年 10 月在中信建投证券投资银行部历任高级业务董事、总监、执行总经理；自 2011 年 5 月至 2013 年 10 月历任上海和鹰机电科技股份有限公司副董事长、总经理；自 2013 年 11 月至 2017 年 7 月在中信建投证券资本市场部、投资银行部历任执行总经理、董事总经理；自 2017 年 9 月至 2020 年 12 月任中安汇信投资管理有限公司总经理。赵先生于 1993 年 6 月自中国人民公安大学取得法学学士学位，于 2001 年 6 月自西南政法大学取得法学硕士学位，于 2011 年 10 月自中欧国际工商学院取得工商管理硕士学位，于 1995 年获得律师资格，于 2003 年获得注册会计师资格。</p>
周志钢	<p>周志钢先生，1964 年 5 月生，中信建投证券党委委员、执行委员会委员。周先生于 2005 年 11 月加入中信建投证券，自 2005 年 12 月起担任党委委员，自 2009 年 2 月起担任执行委员会委员，自 2006 年 8 月起兼任中信建投期货董事。周先生目前还担任中国证券业协会合规管理委员会委员。周先生自 1988 年 9 月至 1992 年 5 月任职华东计算技术研究所，曾任应用软件室主任助理；自 1992 年 5 月至 1996 年 5 月任职上海万国证券公司，曾任计算机中心副主任、研究发展中心副主任、主任；自 1996 年 5 月至 2005 年 11 月任职华夏证券股份有限公司，曾任总工程师、电子商务部总经理；自 2005 年 11 月至 2014 年 4 月曾任中信建投证券副总经理、经纪业务管理委员会主任委员（兼任）；自 2016 年 4 月至 2019 年 4 月担任中信建投证券首席风险官；自 2016 年 4 月至 2019 年 5 月担任中信建投证券合规总监。周先生于 1985 年 7 月自复旦大学取得理学学士学位，于 1988 年 7 月自复旦大学取得理学硕士学位，于 2001 年 4 月自中欧国际工商学院取得工商管理硕士学位，于 1999 年 9 月获得高级工程师资质。</p>
蒋月勤	<p>蒋月勤先生，1966 年 12 月生，中信建投证券党委委员、执行委员会委员。</p>

	<p>蒋先生于 2007 年 1 月加入中信建投证券，自 2007 年 12 月起担任党委委员，自 2009 年 5 月起担任执行委员会委员。蒋先生目前还担任中国证券投资基金业协会副会长、中国证券业协会资产管理业务委员会委员。蒋先生自 1992 年 5 月至 1993 年 3 月任深圳蛇口新欣软件公司程序员；自 1993 年 3 月至 2001 年 12 月任职中信证券股份有限公司，曾任深圳分公司副总经理、公司交易部总经理、首席交易员；自 2001 年至 2006 年担任长盛基金管理有限公司总经理；自 2007 年 1 月至 2016 年 1 月曾任中信建投证券总经理助理、机构业务部行政负责人（兼任）、资产管理部行政负责人（兼任）；自 2013 年 9 月至 2021 年 2 月曾任中信建投基金董事长（兼任）。蒋先生于 1989 年 7 月自中国电子科技大学取得工学学士学位，于 1992 年 3 月自中国电子科技大学取得工学硕士学位。</p>
<p>李铁生</p>	<p>李铁生先生，1971 年 7 月生，中信建投证券执行委员会委员。李先生于 2013 年 6 月加入中信建投证券，自 2013 年 6 月起担任执行委员会委员，自 2017 年 11 月起兼任中信建投投资董事。李先生自 1993 年 8 月至 2000 年 3 月任职中国人保信托投资公司，曾任证券部、期货部业务经理、深圳市中保信财务顾问有限公司副总经理、总经理；自 2000 年 3 月至 2013 年 7 月任职招商银行股份有限公司，曾任香港江南财务有限公司副总经理、长城证券有限责任公司副总裁、新江南投资有限公司总经理、北京分行党委委员、北京分行副行长。李先生于 1993 年 7 月自北京理工大学取得工学学士学位，于 1997 年 10 月自中国人民大学完成研究生课程学习并结业。</p>
<p>王广学</p>	<p>王广学先生，1972 年 6 月生，中信建投证券执行委员会委员、董事会秘书、公司办公室行政负责人。王先生于 2005 年 11 月加入中信建投证券，自 2011 年 11 月起担任公司办公室行政负责人，自 2014 年 1 月起担任执行委员会委员、董事会秘书，自 2019 年 6 月起担任中信建投期货董事长。王先生自 1992 年 8 月至 1995 年 9 月任江苏省溧阳市计划委员会（现溧阳市发展和改革委员会）外经科科员；自 1998 年 7 月至 2005 年 11 月任职华夏证券股份有限公司，曾任投资银行部业务经理、高级业务董事、总经理助理；自 2005 年 11 月至 2011 年 11 月曾任中信建投证券投资银行部总经理助理、副总经理。王先生于 1992 年 7 月自青岛海洋大学（中国海洋大学）取得理学学士学位，于 1998</p>

	<p>年 6 月自复旦大学取得经济学硕士学位,于 2002 年 7 月自复旦大学取得经济学博士学位(在职攻读),于 2004 年 4 月获得 A 股保荐代表人资格。王先生于 2020 年 10 月取得高级经济师职称。</p>
<p>张昕帆</p>	<p>张昕帆先生,1968 年 12 月生,中信建投证券执行委员会委员、经纪业务管理委员会主任、机构业务委员会联席主任。张先生于 2005 年 11 月加入中信建投证券,自 2014 年 1 月起担任执行委员会委员,自 2014 年 4 月起担任经纪业务管理委员会主任,自 2018 年 9 月起担任机构业务委员会联席主任,自 2014 年 6 月起兼任中信建投国际董事。张先生自 1991 年 8 月至 1994 年 10 月任工商银行,曾任大连分行信贷员、证券营业部主任;自 1994 年 11 月至 2005 年 11 月任职华夏证券股份有限公司,曾任大连证券营业部经理、沈阳分公司副总经理、公司经纪业务管理总部副总经理;自 2005 年 11 月至 2016 年 9 月曾任中信建投证券经纪业务管理部副总经理、北京东直门南大街证券营业部经理、经管委财富管理部行政负责人、经纪业务管理委员会副主任委员。张先生于 1991 年 7 月自东北财经大学取得经济学学士学位,于 2001 年 4 月自北京大学光华管理学院取得高层管理工商管理硕士学位。张先生于 1999 年 8 月取得高级经济师职称。</p>
<p>刘乃生</p>	<p>刘乃生先生,1971 年 2 月生,中信建投证券执行委员会委员、投资银行业务管理委员会主任。刘先生于 2006 年 3 月加入中信建投证券,自 2014 年 1 月起担任执行委员会委员,自 2021 年 1 月起担任投资银行业务管理委员会主任。刘先生自 2017 年 8 月起担任上交所第四届、第五届上市委员会委员;自 2016 年 7 月至 2019 年 6 月担任中国证监会第六届上市公司并购重组审核委员会委员。刘先生自 1995 年 7 月至 1997 年 10 月任职中国新兴(集团)总公司,自 1997 年 10 月至 2002 年 10 月任职中国科技国际信托投资有限责任公司,自 2002 年 10 月至 2006 年 3 月于中国科技证券有限责任公司从事投资银行工作;自 2006 年 3 月至 2011 年 4 月担任中信建投证券投资银行部副总经理;自 2011 年 4 月至 2019 年 1 月担任中信建投证券投资银行部行政负责人;自 2018 年 9 月至 2021 年 1 月担任中信建投证券投资银行业务委员会主任。刘先生于 1995 年 7 月自北京机械工业学院(现北京信息科技大学)取得工学学士学位,于 2007 年 7 月自清华大学经济管理学院取得工商管理硕士学位,于 2005 年</p>

	<p>2 月获得 A 股保荐代表人资格，于 2013 年 5 月获得《证券时报》颁发的“2012 年年度最佳投资银行家”，于 2015 年 3 月获得《新财富》颁发的“2014 年年度最佳投资银行家”。</p>
黄凌	<p>黄凌先生，1976 年 10 月生，中信建投证券执行委员会委员、机构业务委员会主任、投资银行业务管理委员会联席主任。黄先生于 2005 年 11 月加入中信建投证券，自 2014 年 1 月起担任执行委员会委员，自 2018 年 9 月起担任机构业务委员会主任，自 2021 年 1 月起担任投资银行业务管理委员会联席主任，自 2021 年 2 月起担任中信建投基金董事长。黄先生自 2000 年 7 月至 2005 年 11 月任职华夏证券股份有限公司，曾任综合管理部高级业务董事；自 2005 年 11 月至 2008 年 5 月曾任中信建投证券债券业务部高级业务董事、总经理助理；自 2008 年 5 月至 2019 年 1 月担任中信建投证券债券承销部行政负责人；自 2018 年 9 月至 2021 年 1 月担任中信建投证券投资银行业务委员会联席主任。黄先生于 1998 年 6 月自中国金融学院国际金融专业取得经济学学士学位，于 2000 年 10 月自中国人民银行研究生部（现清华大学五道口金融学院）金融学专业取得经济学硕士学位，于 2005 年 6 月自湖南大学金融学专业取得经济学博士学位。黄先生于 2007 年 11 月取得高级经济师职称。</p>
丁建强	<p>丁建强先生，1973 年 5 月生，中信建投证券执行委员会委员、合规总监、法律合规部行政负责人。丁先生于 2005 年 11 月加入中信建投证券，自 2007 年 1 月起担任法律合规部行政负责人，自 2019 年 4 月起担任执行委员会委员，自 2019 年 5 月起担任合规总监。丁先生自 2002 年 9 月至 2005 年 12 月担任华夏证券股份有限公司法律事务部总经理助理；自 2005 年 12 月至 2007 年 1 月担任中信建投证券法律合规部总经理助理；自 2018 年 8 月至 2019 年 4 月担任中信建投证券首席律师。丁先生于 1993 年 9 月至 1997 年 7 月自中国政法大学取得法学学士学位，于 1997 年 10 月获得律师资格。</p>
肖钢	<p>肖钢先生，1969 年 6 月生，中信建投证券执行委员会委员、首席信息官、信息技术部行政负责人。肖先生于 2005 年 11 月加入中信建投证券，自 2012 年 8 月起担任信息技术部行政负责人，自 2019 年 4 月起担任执行委员会委员、首席信息官。肖先生目前还担任中国证券业协会信息技术委员会委员、证券期货业金融科技研究发展中心（深圳）专家。肖先生自 1992 年 7 月至 1994</p>

	<p>年 2 月任职北京康泰克电子技术有限公司；自 1994 年 3 月至 2005 年 12 月担任华夏证券股份有限公司电脑中心资深工程师；自 2005 年 12 月至 2007 年 1 月担任中信建投证券信息技术部资深工程师；自 2007 年 1 月至 2012 年 8 月担任中信建投证券信息技术部副总经理。肖先生于 1992 年 7 月自北京联合大学取得计算机应用专业学士学位，于 1994 年 8 月获得工程师职业资质。</p>
<p>彭文德</p>	<p>彭文德先生，1966 年 6 月生，中信建投证券执行委员会委员，公司首席风险官。彭先生于 2005 年 11 月加入中信建投证券，自 2019 年 5 月起担任中信建投国际董事、总经理、执委会主任，自 2019 年 7 月起担任中信建投证券执行委员会委员。彭先生自 1988 年 7 月至 1990 年 9 月担任鑫达实业有限公司工程部主管；自 1993 年 3 月至 2005 年 12 月任职华夏证券股份有限公司，曾担任广州分公司副总经理、北京三里河证券营业部总经理、重庆分公司总经理；自 2005 年 12 月至 2006 年 12 月担任中信建投证券西南管理总部总经理；自 2006 年 12 月至 2019 年 6 月担任中信建投期货董事长。彭先生于 1984 年 9 月至 1988 年 7 月于华中理工大学取得机械专业工学学士学位，于 1990 年 9 月至 1993 年 3 月于华南理工大学取得管理工程学硕士学位，于 1998 年 9 月至 2001 年 12 月在职取得中山大学企业管理专业博士研究生学位。彭先生于 1998 年 7 月取得中级经济师职称。</p>

## 2、本集合计划的投资经理

欧阳政，中央财经大学金融学硕士，特许金融分析师（CFA）。拥有 12 年固定收益投研经历，其中 3 年研究经验，9 年投资经验，2014 年加入中信建投证券股份有限公司，现任资产管理部公募投资部联席负责人，管理多只固定收益类产品。

## 3、投资决策委员会成员

公募资产管理业务投资决策委员会是公募资产管理业务的决策机构，公募资产管理业务投资决策委员会的成员包括：主任委员蒋月勤先生，委员蒋胜先生、李腾飞先生、吴笑冬先生、曹露丹女士。

## 4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、管理人的职责

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

2、办理集合计划备案手续；

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

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

5、建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的集合计划财产和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、依法接受托管人的监督；

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

9、进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

12、保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《集合计划合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；

13、按《集合计划合同》的约定确定集合计划收益分配方案，及时向集合计划份额持有人分配集合计划收益；

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

24、执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

25、建立并保存集合计划份额持有人名册；

26、法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他义务。

#### 四、管理人承诺

1、管理人将根据集合计划合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、理念、策略及限制等全权处理本集合计划的投资。

2、管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止以下行为发生：

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资；

- (2) 不公平地对待管理人管理的不同集合资产管理计划财产；
- (3) 利用集合计划财产或者职务之便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) 侵占、挪用集合计划财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

### 3、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) 不违反现行有效的有关法律法规、规章、集合计划合同和中国证监会的有关规定，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，或利用该信息从事或明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (4) 不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；
- (5) 不从事损害集合计划资产和集合计划份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 五、管理人的内部控制制度

### 1、内部控制原则

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

(4) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公募大集合产品资产、私募产品资产、自有资产以及投顾产品资产其他资产的运作应当分离。公司的风险管理部、法律合规部与稽核审计部具有并保持高度的独立性和权威性。

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

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

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

(8) 防火墙原则：公司公募、私募资产管理业务和公司自有资金投资业务严格隔离。对因业务需要知悉内幕信息和穿越防火墙的人员，应制定严格的批准程序和监督处罚措施。

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

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

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

## 2、内部控制的组织体系

公司执行委员会是资产管理业务的最高管理机构。公司执行委员会下设风险管理委员会与公募资产管理业务投资决策委员会（以下简称“公募投决会”）。公司风险管理委员会负责公募业务风险管理总体目标和政策。公募投决会具体负责

公募资产管理业务的投资决策。资产管理部是公募资产管理业务的具体执行部门。

公司风险管理部负责制定公募资产管理业务相关风险管理政策，审核资产管理业务相关制度流程，参与新业务与新产品的审核；对公募资产管理业务风险进行监测、评估、专项分析；履行定期不定期独立风险报告职能；对资产管理部的风险管理制度的执行情况、风险控制效果进行监测、评估、检查。

公司法律合规部定期、不定期对资产管理业务管理、运作的合法、合规性进行全面检查；对公募资产管理业务制度、流程以及新产品、新业务、高风险类项目进行合规审查与审核；对资产管理合同和投资合同等附属合同条款进行事前审核；对公募资产管理业务跨部门利益冲突进行管理。

公司稽核审计部对公募资产管理业务风险控制的健全性与有效性进行评估；对资产管理部以及大集合产品经营效益的真实性和准确性进行审计；按照监管要求，对公募大集合产品出具定期或不定期稽核审计报告。

为开展大集合资产管理业务，资产管理部设市场营销团队、投资团队和中台业务团队。按照分工合理、权责明确、互相制衡、有效监督的原则对资产管理业务风险进行内部控制：

(1) 资产管理部市场营销团队和投资团队为内部控制的第一道防线，应该诚实守信、勤勉尽责开展公募资产管理业务。

(2) 资产管理部中台业务团队作为内部控制的中台部门，对公募资产管理业务的开展进行全流程的管理和控制，及时发现、制止和纠正大集合产品投资运作中的问题。

(3) 公司法律合规部、风险管理部和稽核审计部为公司内部控制部门，是公募资产管理业务的合规管理、风险管理、内部控制与监督机构，通过介入主要业务环节，把控关键风险节点，实现公司层面对公募资产管理业务风险的整体管控。

### 3、内部控制制度概述

公司的内部控制制度由基本管理制度及部门业务规章两部分组成。

基本管理制度包括：公司风险管理制度、公司合规管理制度、稽核审计制度，从公司层面全面建立、健全风险管理制度体系和风险管理要求。

部门业务规章包括：风险管理和内部控制制度、流动性风险制度、信息披露

---

---

制度、关联交易制度、利益冲突管理制度等，部门业务规章对资产管理业务进行具体规范。

---

---

## 第四部分 托管人

### （一）托管人情况

名称：兴业银行股份有限公司（简称“兴业银行”）

住所：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市浦东新区银城路 167 号

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

联系人：林诗琪

联系电话：021-52629999

### （二）发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 207.74 亿元。

开业三十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2022 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 9.27 万亿元，实现营业收入 2223.74 亿元，同比增长 0.51%，全年实现归属于母公司股东的净利润 913.77 亿元。

### （三）托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、养老金管理中心等处室，共有员工 100

余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

#### （四）基金托管业务经营情况

兴业银行于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2023 年 3 月 31 日，兴业银行股份有限公司共托管证券投资基金 647 只，托管基金的基金资产净值合计 22201.71 亿元，基金份额合计 21435.58 亿份。

#### （五）托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

##### 2、内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部控制组织架构由总行内部控制委员会、总行风险管理部门、总行审计部、总行资产托管部、总行运营管理部及分行托管运营机构共同组成。各级内部控制组织依照兴业银行相关制度对兴业银行托管业务风险管理和内部控制实施管理。

##### 3、内部控制原则

（1）全面性原则：内部控制贯穿资产托管业务的全过程，覆盖各项业务和产品，以及从事资产托管业务的各机构和从业人员；

（2）重要性原则：内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要业务事项和高风险领域；

（3）独立性原则：开展托管业务的部门和岗位的设置应权责分明、相对独立、相互制衡；

（4）审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险，保证托管资产的安全与完整为出发点，“内控优先”，“制度优先”，审慎发展资产托管业务；

（5）制衡性原则：内部控制应当在治理结构、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

(6) 适应性原则：内部控制体系应同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

(7) 成本效益原则：内部控制应当权衡实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

#### 4、内部控制制度及措施

(1) 制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2) 建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3) 风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

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

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

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

#### (六) 托管人对管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

托管人负有对管理人的投资运作行使监督权的职责。根据《基金法》、《运作办法》、资产管理合同及其他有关规定，托管人对集合计划的投资对象和范围、投资组合比例、投资限制、费用的计提和支付方式、集合计划会计核算、集合计划资产估值和集合计划净值的计算、收益分配、申购赎回以及其他有关集合计划投资和运作的事项，对管理人进行业务监督、核查。

托管人发现管理人有违反《基金法》、《运作办法》、资产管理合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对托管人发出回函。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内

---

---

纠正的，托管人应报告中国证监会。托管人发现管理人有重大违规行为，立即报告中国证监会，同时，通知管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

托管人发现管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并及时向中国证监会报告。

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

---

---

## 第五部分 相关服务机构

### 一、集合计划销售机构

#### 1、中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街 188 号

设立日期：2005 年 11 月 2 日

注册资本：7,756,694,797 元人民币

法定代表人：王常青

联系电话：4008-888-108

联系人：张晔

#### 2、其他销售机构：

管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本集合计划，管理人新增或变更本集合计划的销售机构时，将按照《信息披露办法》进行公告或在管理人网站列示。

### 二、集合计划登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：于文强

电话：4008058058

联系人：赵亦清

### 三、出具法律意见的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

---

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

#### 四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

主要经营场所：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 10 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：010-6533 2249

联系人：陈进展

经办注册会计师：陈进展、王思晓

---

---

## 第六部分 集合计划的历史沿革

中信建投悠享 12 个月持有期债券型集合资产管理计划由中信建投季享收益集合资产管理计划变更而来。

中信建投季享收益集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，自 2013 年 5 月 16 日起开始募集，于 2013 年 5 月 22 日结束募集工作，并于 2013 年 5 月 27 日正式成立。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，中信建投季享收益集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，《中信建投悠享 12 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》自本集合计划管理人公告的生效之日起生效，原《中信建投季享收益集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

---

---

## 第七部分 集合计划的存续

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

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与赎回

### 一、申购和赎回场所

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

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理集合计划份额的申购和赎回，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，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或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，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

管理人可根据实际情况依法决定本集合计划开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

在每份集合计划份额的最短持有期结束日的下一个工作日（含）起，集合计划份额持有人方可就该集合计划份额提出赎回申请及转换转出申请。**如果投资人多次申购/转换转入本集合计划，则其持有的每一份集合计划份额的赎回/转换转出开放的时间可能不同。**

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

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

### 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在管理人规定的时间以内撤销；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人持有集合计划份额登记日期的先后次序进行顺序赎回；

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

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

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

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

##### 2、申购和赎回的款项支付

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

集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后划出。在发生巨额赎回或集合计划合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照集合计划合同有关条款处理。

##### 3、申购和赎回申请的确认

管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时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，则申购款项本金退还给投资人。

集合计划销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，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，否则，由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

管理人可以在法律法规允许的情况下，依法对上述规则进行调整。管理人必须在新规则实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 五、申购和赎回的数量限制

1、本集合计划首次申购单笔最低金额为 1 元，追加申购单笔最低金额不进行限制。在符合法律法规规定的前提下，各销售机构在此最低起点金额之上有其他规定的，需同时遵循该销售机构的相关规定。管理人可根据市场情况，调整本集合计划首次申购的最低金额和追加申购的最低金额，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

2、投资者可将其账户中持有的全部或部分份额赎回，持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 1 份，持有人全额赎回时不受此限制。持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。管理人可根据市场情况，调整本集合计划赎回份额的数量限制，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。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、管理人可以规定单个投资人累计持有的集合计划份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

4、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，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

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

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

7、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等数量限制。管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购费用

本集合计划 A 类份额收取申购费。A 类份额的申购费用由投资人承担，不列入集合计划财产。C 类份额不收取申购费用。

A 类份额的申购费率如下表所示：

申购金额（含申购费，M）	A 类份额的申购费率
M<100 万	0.5%
100 万≤M<500 万	0.3%
M≥500 万	1000 元/笔

投资者可多次申购本集合计划，A 类份额申购费率按每笔申购申请单独计算。

2、赎回费用

投资人可将其持有的全部或部分集合计划份额赎回。赎回费用由赎回集合计划份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。

A 类份额、C 类份额的赎回费率如下表所示：

赎回份额持有时间（N）	A 类/C 类份额的赎回费率
N<7 日	1.5%
N≥7 日	0%

注：N 为集合计划份额持有期限。

对持续持有期少于 7 日的投资人收取的赎回费全额计入集合计划财产。

3、管理人可以在集合计划合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

4、当本集合计划发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机

制，以确保集合计划估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

5、管理人可以在不违反法律法规规定及集合计划合同约定且对存量集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定集合计划促销计划，定期或不定期地开展集合计划促销活动。在集合计划促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，管理人可以适当调低集合计划销售费用。

## 七、申购份额、赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算

(1)当投资者选择申购本集合计划 A 类份额时，申购份额的计算方法如下：

1) 申购费用适用比例费率时：

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日集合计划 A 类份额净值

2) 申购费用适用固定金额时：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日集合计划 A 类份额净值

(2)当投资者选择申购本集合计划 C 类份额时，申购份额的计算方法如下：

申购份额=申购金额/申购当日集合计划 C 类份额净值

申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类别集合计划份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

例：某投资人投资 50,000.00 元申购本集合计划 A 类份额，对应的申购费率为 0.5%，假设申购当日 A 类份额净值为 1.0400 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=50,000.00/(1+0.5%)=49,751.24 元

申购费用=50,000.00-49,751.24=248.76 元

申购份额=49,751.24/1.0400=47,837.73 份

即：投资人投资 50,000.00 元申购本集合计划 A 类份额，对应的申购费率为 0.5%，假设申购当日 A 类份额净值为 1.0400 元，则其可得到 47,837.73 份本集合

计划 A 类份额。

例：某投资者投资 50,000 元申购本集合计划 C 类份额，假设申购当日集合计划 C 类份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 50,000 / 1.0500 = 47,619.05 \text{ 份}$$

即：投资者投资 50,000 元申购本集合计划 C 类份额，假设申购当日集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 47,619.05 份的集合计划 C 类份额。

## 2、赎回金额的计算

本集合计划的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的各类集合计划份额净值为基准进行计算。

当投资者赎回集合计划份额时，赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日该类集合计划份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回金额} - \text{赎回费用}$$

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类别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。

例：某持有人赎回 100,000 份因红利再投资形成的本集合计划 A 类份额，持有期为 5 日，对应的赎回费率为 1.5%，假设赎回当日集合计划 A 类份额净值为 1.0500 元，则可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 100,000 \times 1.0500 = 105,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 105,000.00 \times 1.5\% = 1575.00 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 105,000.00 - 1575.00 = 103,425.00 \text{ 元}$$

即：某持有人赎回 100,000 份因红利再投资形成的本集合计划 A 类份额，持有期为 5 日，假设赎回当日集合计划 A 类份额净值为 1.0500 元，则其可得到赎回金额 103,425.00 元。

例：某持有人赎回 100,000 份本集合计划 C 类份额，持有期为 395 日，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日集合计划 C 类份额净值为 1.0500 元，则可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 100,000 \times 1.0500 = 105,000.00 \text{ 元}$$

---

---

赎回费用=105,000.00×0%=0.00 元

净赎回金额=105,000.00-0.00=105,000.00 元

即：某持有人赎回 100,000 份本集合计划 C 类份额，持有期为 395 日，假设赎回当日集合计划 C 类份额净值为 1.0500 元，则其可得到赎回金额 105,000.00 元。

### 3、集合计划份额净值计算

T 日各类集合计划份额净值=T 日该类集合计划资产净值/T 日发行在外的该类集合计划份额总数。

本集合计划 A 类和 C 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。本集合计划份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。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。

### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致集合计划无法正常运作。
- 2、发生集合计划合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或休市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有集合计划份额持有人利益时。
- 5、集合计划资产规模过大，使管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对集合计划业绩产生负面影响，或发生其他损害现有集合计划份额持有人利益的情形。
- 6、当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停接受集合计划申购申请。
- 7、管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有集合计划

份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。

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

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，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，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或休市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有份额持有人利益的情形时，管理人可暂停接受份额持有人的赎回申请。

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按集合计划合同的

相关条款处理。份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(3) 在出现巨额赎回时，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 20% 以上的赎回申请，管理人可以对超过的部分全部进行延期办理，具体措施如下：延期的赎回申请将自动与下一个开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如该单个集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明

确选择，未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于此类持有人未超过上述比例的部分，管理人有权根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的方式与其他持有人的赎回申请一并办理。但是，如此类持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，并根据《信息披露办法》的规定在规定媒介上刊登公告。

#### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

3、若暂停时间超过 1 日，则管理人可以根据《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放申购或赎回日，在规定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个工作日的各类集合计划份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

#### 十二、集合资产管理计划转换

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

#### 十三、集合计划的非交易过户

集合计划的非交易过户是指登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无

论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本集合计划份额的投资者。

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

#### 十四、集合计划的转托管

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

#### 十五、定期定额投资计划

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

#### 十六、集合计划份额的冻结和解冻

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

#### 十七、集合计划份额的转让

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

十八、如相关法律法规允许管理人办理其他集合计划业务，管理人将制定和实施相应的业务规则。

#### 十九、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回

本集合计划实施侧袋机制的，本集合计划的申购和赎回安排详见招募说明书

“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

## 第九部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

在价值分析的基础上，积极寻找优质资产的投资机会，在控制投资风险的前提下努力实现合理的收益。

### 二、投资范围

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、证券公司发行的短期公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、通知存款、协议存款等）、同业存单、国债期货、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本集合计划不直接投资于股票，但可持有因可转换债券、可交换债券转股或换股所形成的股票等权益资产。因上述原因持有的股票，本集合计划将在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出。

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

集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%；本集合计划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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

如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

#### 1、资产配置策略

本集合计划通过深入研究国际和国内的宏观经济环境、利率环境、政策环境、市场估值和市场流动性等因素，形成对经济周期和证券市场趋势的基本判断，据

此确定各类资产的投资比例，并根据各类资产的收益/风险结构和市场变化，动态调整比例结构，在加强系统性风险管理的前提下，力争实现计划资产的增值保值。

## 2、债券的投资策略

### (1) 债券选择策略

本集合计划对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋水平等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券之间的利差和变化趋势，制定债券种类配置策略，确定组合在不同类型债券品种上的配置比例。

### (2) 平均久期配置

本集合计划通过对宏观经济变量（包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、外贸差额、财政收支、价格指数、汇率等）和宏观经济政策（包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等）进行分析，预测未来的利率趋势，判断债券市场对上述变量和政策的反应，并据此积极调整债券组合的平均久期，提高债券组合的总投资收益。

### (3) 收益率曲线配置策略

本集合计划还将根据具体收益率曲线特征确定合理的期限结构特征，分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化，具体包括子弹型、哑铃型和梯型策略，在长期、中期、短期债券间进行动态调整，从曲线的形变中获利。

### (4) 信用债投资策略

本集合计划投资信用状况良好的信用类债券。在此基础上，分析各品种的信用溢价，选择信用风险较低和溢价较高的品种进行投资。

本集合计划主动投资信用债的信用评级须在 AA（含 AA）以上，除短期融资券、超短期融资券以外的信用债采用债项评级，短期融资券、超短期融资券采用主体评级；若没有债项评级或者债项评级体系与前述评级要求不一致的，参照主体评级。其中，投资于信用评级为 AA 的信用债占信用债资产比例不超过 20%；投资于信用评级为 AA+ 的信用债占信用债资产比例不超过 50%；投资于信用评级为 AAA 的信用债占信用债资产比例不低于 50%。本集合计划持有信用债期间，如果其评级下降、集合计划规模变动、变现信用债支付赎回款项等使得投资比例不再符合上述约定，应在评级报告发布之日或不再符合上述约定之日起 3 个月内

调整至符合约定。可转换债券、可交换债券不受此评级和投资比例限制。

信用评级参照评级机构（不包含中债资信评级以及穆迪、标普等外资评级机构）评定的最新债券信用评级。如本集合计划投资的信用债出现同一时间多家评级机构出具的信用评级不一致，或没有对应信用评级的情况，管理人将结合内部信用评级规则进行独立判断与认定。信用债的信用评级以管理人的判断与认定结果为准。

管理人应当自集合计划合同生效日起 6 个月内使本集合计划的投资组合比例符合上述比例要求。

#### （5）资产支持证券投资策略

本集合计划将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和数量化模型，对资产支持证券进行估值。本集合计划将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### （6）国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。本集合计划将在深入研究宏观经济形势和影响利率水平各项指标的基础上，预判利率债品种的后期表现，在有效控制组合杠杆水平的基础上，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分利用国债期货保证金交易特点，灵活调整组合的国债期货仓位。本集合计划将在结合组合内各利率债持仓结构的基础上，构建并实时调整利率债的套期保值组合。

管理人将在国债期货投资过程中加强国债期货投资策略的研究，注意对国债期货风险敞口的控制与保证金的管理，针对各种不同的市场状况事先做好流动性应急处理预案，并将加强对经纪商资质及信用的审查，明确责任承担方式，对国债期货交易的市场结算风险进行控制。

#### （7）可转换债券、可交换债券投资策略

可转债的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值，本集合计划管理人将对可转债的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转债进行投资。

本集合计划管理人将对发行公司的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等，并参考同类公司的估值水平，判断可转换债券的股权投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判

断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的内嵌期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。

本集合计划可交换债的投资需对可交换债发行的目的、债券价值、期权价值等作出综合评判，选择具有较高投资价值的可交换债进行投资。

本集合计划投资于可转换债券、可交换债券的比例占资产总值的 0%-20%。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%；
- (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，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (3) 本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的 10%；
- (4) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划持有一家公司发行的证券不超过该证券的 10%；
- (5) 本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过集合计划资产净值的 10%；
- (6) 本集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产净值的 20%；
- (7) 本集合计划持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；
- (8) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；
- (9) 本集合计划应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；
- (10) 本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限

为 1 年，债券回购到期后不得展期；

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

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

(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) 本集合计划参与国债期货交易的，需遵循下列投资比例限制：本集合计划在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 15%；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%；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；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%；

(15) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(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）、（9）、（12）、（13）项情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

策略应当符合集合计划合同的约定。托管人对集合计划的投资的监督与检查自集合计划合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

## 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) 买卖其他集合资产管理计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其管理人、托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- (7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本集合计划可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定为准。经与托管人协商一致，管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对集合计划合同进行变更。

## 五、业绩比较基准

本集合计划采用“中债综合财富（总值）指数收益率\*90%+1 年期定期存款

利率（税后）\*10%”作为业绩比较基准。

本集合计划的业绩比较基准根据本集合计划的资产配置和策略特点进行设置。中债综合财富（总值）指数由中央国债登记结算有限公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。指数涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性，适合作为市场债券投资收益的衡量标准；由于本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，集合计划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%（其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等），采用 90%作为业绩比较基准中债券投资所代表的权重，10%作为现金资产所对应的权重可以较好的反映本集合计划的风险收益特征。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，或今后法律法规发生变化，或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布，本管理人可依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，在与托管人协商一致的情况下调整业绩比较基准，无需召开份额持有人大会审议。

## 六、风险收益特征

本集合计划为债券型集合资产管理计划，其预期收益和预期风险通常高于货币市场基金，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、管理人代表集合计划行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于集合计划财产的安全与增值；

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

## 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

当集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保

---

---

护集合计划份额持有人利益的原则，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，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

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

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

---

---

## 第十部分 集合计划的财产

### 一、集合计划资产总值

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

### 二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

### 三、集合计划财产的账户

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

### 四、集合计划财产的保管和处分

本集合计划财产独立于管理人、托管人和集合计划销售机构的财产，并由托管人保管。管理人、托管人、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。

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

---

---

## 第十一部分 集合计划资产估值

### 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

集合计划所拥有的债券和银行存款本息、国债期货合约、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

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

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

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

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

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

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价

（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；如成本能够近似体现公允价值，可按成本法估值，但管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整；

(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、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、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。

6、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。

7、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

8、回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

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

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

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

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

## 五、估值程序

1、各类集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，该类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制，具体可参见管理人届时的相关公告。国家法律法规另有规定的，从其规定。

管理人每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。

2、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或集合计划合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人按规定对外公布。

## 六、估值错误的处理

管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当集合计划份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为集合计划份额净值错误。

集合计划合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 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，需要修改登记机构交易数据的，由登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

(1) 集合计划份额净值计算出现错误时，管理人应当立即予以纠正，通报

托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

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

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

## 七、暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4、中国证监会和集合计划合同认定的其它情形。

## 八、集合计划净值的确认

集合计划净值信息由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人按规定对集合计划净值信息予以公布。

## 九、特殊情况的处理

(1) 管理人或托管人按集合计划合同约定的估值方法第 9 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，或由于证券/期货交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现该错误的，由此造成的集合计划资产估值错误，管理人和托管人免除赔偿责任，但管理人、托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

本集合计划实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估

---

---

值并披露主袋账户的集合计划净值信息，暂停披露侧袋账户的集合计划净值。

## 第十二部分 集合计划的收益与分配

### 一、集合计划利润的构成

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

### 二、集合计划可供分配利润

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

### 三、集合计划收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《集合计划合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；**由红利再投资而来的 A 类或 C 类份额不受最短持有期的限制；**

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

4、由于本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，而 C 类份额收取销售服务费，各类别份额对应的可供分配利润将有所不同。同一类别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。

在不违反法律法规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，集合计划管理人可对集合计划收益分配原则进行调整，无需召开集合计划份额持有人大会。

### 四、收益分配方案

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、收益分配对象、

---

---

分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

#### 六、集合计划收益分配中发生的费用

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

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

## 第十三部分 集合计划费用与税收

### 一、集合计划费用的种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、C 类份额的销售服务费；
- 4、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 5、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费等；
- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券、期货交易费用；
- 8、集合计划的银行汇划费用；
- 9、集合计划的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《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、管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.3% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 2、托管人的托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 的年费率计提。托

管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### 3、C 类份额的销售服务费

本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额销售服务费年费率为 0.3%。

本集合计划销售服务费按前一日 C 类集合计划资产净值的 0.3% 年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日的集合计划资产净值

C 类份额的销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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，由托管人从集合计划财产中支付。

### 三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

- 1、管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划财产的损失；
- 2、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；
- 3、《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，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

#### 五、集合计划税收

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

---

---

## 第十四部分 集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

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

### 二、集合计划的年度审计

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

## 第十五部分 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管理人、托管人、召集集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人及其日常机构（如有）等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

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

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

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

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

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人

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）招募说明书、《集合计划合同》、托管协议、产品资料概要

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

2、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规定网站上；招募说明书其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新招募说明书。

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

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

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

### （二）《集合计划合同》生效公告

管理人应当在规定媒介上登载《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，管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类集合计划份额净值和集合计划份额累

计净值。

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

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

#### （四）集合计划份额申购、赎回价格

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

#### （五）集合计划定期报告，包括年度报告、中期报告和季度报告

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

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

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

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

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

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

#### （六）临时报告

本集合计划发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告

书，并登载在规定报刊和规定网站上。

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

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

#### （七）澄清公告

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

#### （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规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （十）投资资产支持证券信息披露

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、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

管理人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

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

投资政策和投资目标等。

## （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“侧袋机制”部分的规定。

## （十三）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

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

管理人、托管人应当在规定报刊中选择一家报刊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、及时。

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

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

### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

### 八、暂停或延迟信息披露的情形

---

---

当出现下述情况时，管理人和托管人可暂停或延迟披露集合计划相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、集合计划投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、法律法规、《集合计划合同》或中国证监会规定的其他情况。

## 第十六部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

当集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,根据最大限度保护集合计划份额持有人利益的原则,集合计划管理人经与集合计划托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以依照法律法规及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,并在五个工作日内聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、实施侧袋机制期间集合计划份额的申购与赎回

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

2、实施侧袋机制期间,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的约定办理主袋账户份额的赎回,并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

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

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

集合计划管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投

资操作。

#### 四、实施侧袋机制期间的集合计划估值

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

#### 五、实施侧袋账户期间的集合计划费用

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

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

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

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

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

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

#### 七、侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

在启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项后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”部分规定的集合计划净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。实施侧袋机制期间本集合计划暂停披露侧袋账户份额净值和累

---

---

计净值。

### 3、定期报告

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

八、本部分关于侧袋机制的相关规定，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，集合计划管理人经与集合计划托管人协商一致并履行适当程序后，在对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

---

---

## 第十七部分 风险揭示

### 一、投资本集合计划的风险

#### 1、市场风险

本集合计划主要投资于证券市场，而证券市场价格因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致集合计划收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

（1）政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响集合计划收益而产生风险。

（2）经济周期风险。证券市场是国民经济的晴雨表，随着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，集合计划投资的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。利率直接影响着证券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。集合计划投资于证券，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

（4）再投资风险。固定收益证券偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率，由此本集合计划面临再投资风险。

（5）信用风险。固定收益证券发行人不能按期还本付息或回购交易中交易对手在回购到期履行交割责任时，不能偿还全部或部分证券或价款，都可能使本集合计划面临信用风险。

（6）上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果集合计划所投资的上市公司经营不善，其证券价格可能下跌，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，但不能完全避免。

（7）购买力风险。集合计划份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降，从而使集合计划的实际收益下降。

(8) 债券回购风险。债券回购为提升整体集合计划组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成集合计划净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对集合计划组合收益进行放大的同时，也对集合计划组合的波动性（标准差）进行了放大，即集合计划组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对集合计划净值造成损失的可能性也就越大。

## 2、管理风险

在集合计划管理运作过程中，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以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响集合计划收益水平。

管理人和托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响集合计划收益水平。

## 3、流动性风险

集合计划的流动性风险主要表现在两方面：一是管理人建仓时或为实现投资收益而进行组合调整时，可能会由于特定投资标的流动性相对不足而无法按预期的价格将证券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，当个券或个股的流动性较差时，管理人被迫在不适当的价格大量抛售证券。两者均可能使集合计划净值受到不利影响。

### (1) 集合计划申购、赎回安排

本集合计划的申购、赎回安排详见集合计划合同“集合计划份额的申购与赎回”章节及本招募说明书“集合计划份额的申购与赎回”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金融工具，包括债券（含国债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、证

券公司发行的短期公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、通知存款、协议存款等)、同业存单、国债期货、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。上述投资标的一般情况下具有良好的流动性,但在特殊情况下,也存在部分品种交投不活跃、成交量不足的情形,此时如果集合计划赎回量较大,可能会影响集合计划的流动性。

### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当本集合计划发生巨额赎回时,管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回;此外,如出现连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回,可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项;当本集合计划发生巨额赎回且单个集合计划份额持有人的赎回申请超过上一开放日集合计划总份额一定比例的,管理人有权先行对该单个集合计划份额持有人超出该比例的赎回申请实施延期办理。具体情形、程序见招募说明书“集合计划份额的申购与赎回”之“巨额赎回的情形及处理方式”。

发生上述情形时,投资人面临无法全部赎回或无法及时获得赎回资金的风险。在本集合计划暂停或延期办理投资者赎回申请的情况下,投资者未能赎回的集合计划份额还将面临净值波动的风险。

本集合计划巨额赎回安排详见集合计划合同“集合计划份额的申购与赎回”章节及本招募说明书“集合计划份额的申购与赎回”章节。

### (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,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集合计划合同的规定,谨慎选取暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、延期办理巨额赎回申请、暂停集合计划估值、摆动定价、侧袋机制等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用,管理人将依照严格审批、审慎决策的原则,及时有效地对风险进行监测和评估,使用前经过内部审批程序并与托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时,投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响,管理人将严格依照法律法规及集合计划合同的

约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

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

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

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

启用侧袋机制后，集合计划管理人计算各项投资运作指标和集合计划业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的集合计划净资产减少按投资损失处理，因此本集合计划披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

#### 4、本集合计划特有风险

(1) 本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%。本集合计划需要承担由于市场利率波动造成的利率风险以及如企业债、公司债等信用品种的发债主体信用恶化造成的信用风险；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险。

(2) 本集合计划对每份集合计划份额设置 12 个月的最短持有期。在每份集合计划份额的最短持有期内，投资者不能就该集合计划份额提出赎回申请及转换转出申请；每份集合计划份额的最短持有期结束日的下一个工作日（含）起，集合计划份额持有人可就该份额提出赎回申请及转换转出申请。对于每份

集合计划份额，最短持有期指自集合计划份额申购确认日（含）（对于申购份额而言）或集合计划份额转换转入确认日（含）（对于转换转入份额而言）起至 12 个月后对应日（不含）（如该对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日）的期间。由红利再投资而来的集合计划份额不受最短持有期的限制。因此，集合计划份额持有人将面临在最短持有期内不能赎回或转换转出集合计划份额的风险。

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

（4）本集合计划可投资于证券公司发行的短期公司债券，由于证券公司发行的短期公司债券非公开发行和交易，且限制投资者数量上限，潜在流动性风险相对较大。若发行主体信用质量恶化或投资者大量赎回需要变现资产时，受流动性所限，本集合计划可能无法卖出所持有的证券公司短期公司债券，由此可能给集合计划净值带来不利影响或损失。

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

#### （6）流通受限证券的风险

本集合计划可投流通受限证券，因此本集合计划可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

## 5、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在集合计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致集合计划份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自集合计划管理人、登记机构、销售机构、证券/期货交易所、证券/期货登记结算机构等等。

## 6、合规性风险

合规性风险指集合计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者集合计划投资违反法规及集合计划合同有关规定的风险。

## 7、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) 因集合计划业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面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、欺诈等行为产生的风险；

(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) 因战争、自然灾害等不可抗力导致的管理人、集合计划其他销售机构等机构无法正常工作，从而影响集合计划的申购、赎回按正常时限完成的风险。

## 二、声明

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

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

## 第十八部分 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，由管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

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

### 二、《集合计划合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《集合计划合同》应当终止：

- 1、集合计划份额持有人大会决定终止的；
- 2、管理人、托管人职责终止，在 6 个月内没有新管理人、新托管人承接的；
- 3、《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，管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

(2)对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、集合计划财产清算的公告

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

#### 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

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

## 第十九部分 集合计划合同的内容摘要

### 一、集合计划份额持有人、管理人和托管人的权利、义务

#### (一) 管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

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

(7) 在托管人更换时，提名新的托管人；

(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、赎回、转换申请；

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

(13) 在法律法规允许的前提下，为集合计划的利益依法为集合计划进行融资；

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

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

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

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

(2) 办理集合计划备案手续；

(3) 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) 依法接受托管人的监督；

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

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《集合计划合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公

开披露前应予保密，不向他人泄露；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

(17) 确保需要向集合计划投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《集合计划合同》规定的时间和方式，随时查阅到与集合计划有关的公开资料，并在支付合理成本的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) 监督托管人按法律法规和《集合计划合同》规定履行自己的义务，托管人违反《集合计划合同》造成集合计划财产损失时，管理人应为集合计划份额持有人利益向托管人追偿；

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

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

(24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他义务。

(二) 托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

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

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

(5) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

(6) 在管理人更换时，提名新的管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《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，托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

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

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

(6) 按规定开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照

---

《集合计划合同》的约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(7) 保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《集合计划合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 从集合计划管理人或委托登记机构处接收并保存集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；

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

(15) 依据《基金法》、《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》的规定监督管理人的投资运作；

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

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

(19) 因违反《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) 按规定监督管理人按法律法规和《集合计划合同》规定履行自己的义务，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，集合计划份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享集合计划财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余集合计划财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的集合计划份额；
- (4) 按照规定要求召开集合计划份额持有人大会或者召集集合计划份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席集合计划份额持有人大会，对集合计划份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的集合计划信息资料；
- (7) 监督管理人的投资运作；
- (8) 对管理人、托管人、集合计划服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《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。在本集合计划存续期内，根据本集合计划的运作需要，份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

### (一) 召开事由

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

- (1) 终止《集合计划合同》；
- (2) 更换管理人（集合计划管理人更换为本集合计划管理人设立的子公司除外）；
- (3) 更换托管人；
- (4) 转换集合计划运作方式；
- (5) 调整管理人、托管人的报酬标准或提高销售服务费；
- (6) 变更集合计划类别；
- (7) 本集合计划与其他集合资产管理计划的合并；
- (8) 变更集合计划投资目标、范围或策略；
- (9) 变更集合计划份额持有人大会程序；
- (10) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本集合计划总份额10%以上（含10%）的集合计划份额持有人（以管理人或托管人收到提议当日的集合计划份额计算，下同）就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会；
- (12) 对本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、在法律法规规定和《集合计划合同》约定的范围内且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由管理人和托管人协商一致后修改，不需召开集合计划份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加或调整的集合计划费用的收取；
- (2) 调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费或变更收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《集合计划合同》进行修改；
- (4) 对《集合计划合同》的修改对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《集合计划合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 调整有关集合计划申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务规则；
- (6) 集合计划推出新业务或服务；
- (7) 管理人获得公募基金管理业务资格且对本合同无实质性修改的前提下将本集合计划变更注册为公募基金；
- (8) 集合计划管理人更换为本集合计划管理人独资设立的具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司；
- (9) 停止现有集合计划份额类别的销售、增加新的集合计划份额类别或调整份额类别设置；
- (10) 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管理人召集。

2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集。

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

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

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

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

### （三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次集合计划份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其

联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

#### （四）集合计划份额持有人出席会议的方式

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

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

（1）亲自出席会议者持有集合计划份额的凭证、受托出席会议者出具的集合计划份额持有人持有集合计划份额的凭证及集合计划份额持有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管理人持有的登记资料相符；

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的集合计划份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人, 同时提交的持有集合计划份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的集合计划份额持有人持有集合计划份额的凭证及集合计划份额持有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亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以现场方式与非现场方式相结合的方式召开, 会议程序比照现场开会和通讯开会的程序进行。集合计划份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决, 具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。

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

(五) 议事内容与程序

## 1、议事内容及提案权

议事内容为关系集合计划份额持有人利益的重大事项，如《集合计划合同》的重大修改、决定终止《集合计划合同》、更换管理人、更换托管人、与其他集合资产管理计划合并、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。大会主持人为管理人授权出席会议的代表，在管理人授权代表未能主持大会的情况下，由托管人授权其出席会议的代表主持；如果管理人授权代表和托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的集合计划份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名集合计划份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人。管理人和托管人拒不出席或主持集合计划份额持有人大会，不影响集合计划份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### （2）通讯开会

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

### （六）表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持

表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

清点结果。

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

## 2、通讯开会

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

## (八) 生效与公告

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

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

## (九) 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。

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

侧袋机制实施期间，关于集合计划份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分相关约定。

（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，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

### 三、集合计划合同解除和终止的事由、程序以及集合计划财产清算方式

#### （一）《集合计划合同》的变更

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

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

(二) 《集合计划合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《集合计划合同》应当终止：

- 1、集合计划份额持有人大会决定终止的；
- 2、管理人、托管人职责终止，在6个月内没有新管理人、新托管人承接的；
- 3、《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，管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、集合计划财产清算程序：

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

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

5、集合计划财产清算的期限为6个月，但因本集合计划所持证券的流动性受

到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

#### （四）清算费用

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

#### （五）集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）集合计划财产清算的公告

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

#### （七）集合计划财产清算账册及文件的保存

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

### 四、争议解决方式

各方当事人同意，因《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，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，管理人和托管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（为本合同之目的，不含港澳台立法）管辖。

### 五、集合计划合同存放地和投资者取得集合计划合同的方式

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

---

---

## 第二十部分 集合计划托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 管理人

名称：中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

成立时间：2005年11月2日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会、证监机构字【2005】112号

组织形式：股份有限公司

注册资本：775,669.4797万人民币

存续期间：持续经营

联系电话：4008-888-108

#### (二) 托管人

名称：兴业银行股份有限公司

住所：福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦

法定代表人：吕家进

电话：021-52629999

传真：021-62535823

联系人：林诗琪

成立时间：1988年8月22日

组织形式：股份有限公司

注册资本：2,077,419.0751万人民币

批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347号

存续期间：持续经营

### 二、托管人对管理人的业务监督和核查

#### (一) 托管人对管理人的投资行为行使监督权

1、托管人根据有关法律法规的规定和《集合计划合同》、本协议的约定，对下述集合计划投资范围、投资对象进行监督。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国

债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、可交换债券、证券公司发行的短期公司债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、通知存款、协议存款等)、同业存单、国债期货、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本集合计划不直接投资于股票,但可持有因可转换债券、可交换债券转股或换股所形成的股票等权益资产。因上述原因持有的股票,本集合计划将在其可交易之日起的30个交易日内卖出。

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

2、托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》、本协议的约定对下述集合计划投资比例、投资限制进行监督:

(1) 本集合计划的投资组合比例监督:

本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的80%;本集合计划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,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;国债期货的投资比例遵循国家相关法律法规。

如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。

(2) 本集合计划的投资限制监督:

1) 本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的80%;

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,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

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

4) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划持有一家公司发行的证

券不超过该证券的 10%；

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

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

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

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

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

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

11) 本集合计划管理人管理的全部开放式集合资产管理计划持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的15%；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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的30%；

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

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) 本集合计划参与国债期货交易的，需遵循下列投资比例限制：本集合计划在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的15%；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%；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；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%；

15) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的140%；

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)、9)、12)、13)项情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。

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

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他集合资产管理计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

(5) 向其管理人、托管人出资；

(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其

他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本集合计划可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定为准。经与托管人协商一致，管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对集合计划合同进行变更。

#### 4、托管人依据以下约定对管理人参与银行间债券市场投资进行监督

管理人参与银行间债券市场交易，应按照审慎的风险控制原则评估交易对手资信风险，并自主选择交易对手。

管理人在银行间债券市场进行现券买卖和回购交易时，以DVP(券款兑付)的交易结算方式进行交易。

集合计划管理人应在集合计划投资运作之前向集合计划托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本集合计划适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。集合计划托管人在收到名单后2个工作日内以双方认可的方式确认收到该名单。集合计划管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。集合计划托管人监督集合计划管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易，如集合计划管理人在集合计划投资运作之前未向集合计划托管人提供银行间债券市场交易对手名单的，视为集合计划管理人认可全市场交易对手。集合计划管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，集合计划托管人在收到新名单后2个工作日内以书面或其他双方认可的方式确认收到该名单。新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如集合计划管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向集合计划托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与集合计划托管人协商解决。

集合计划管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷，集合计划托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在集合计划托管人与集合计划管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，集合计划管理人有权向相关交易对手追偿，集合计划托管人应予以必要的协助与配合。集合计划托管人根据银行间债券市场成交单对本集合计划银行间债券交易的交易对手及其结算方式进行监督。如集合计划托管人事后发现集合计划管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，集合计划托管人应及时书面或以双方认可的其他方式提醒集合计划管理人，经提醒后仍未改正时造成集合计划财产损失的，集合计划托管人不承担由此造成的相应损失和责任。如果集合计划托管人未能切实履行监督职责，导致集合计划出现风险或造成集合计划资产损失的，集合计划托管人应承担相应责任。

#### 5、关于银行存款投资

本集合计划投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。管理人应基于审慎原则评估存款银行信用风险并据此选择存款银行。

集合计划管理人、集合计划托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保集合计划银行存款业务账目及核算的真实、准确。集合计划管理人应当按照有关法规规定，与集合计划托管人、存款机构签订相关书面协议。集合计划托管人应根据有关相关法规及协议对集合计划银行存款业务进行监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

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

集合计划投资银行存款的，集合计划管理人应根据法律法规的规定及集合计划合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给集合计划托管人，集合计划托管人应据以对集合计划投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。如集合计划管理人在集合计划投资运作之前未向集合计划托管人

提供存款银行名单的，视为集合计划管理人认可所有银行。

(二) 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) 托管人发现管理人的投资指令或实际投资运作及其他运作违反《基金法》、《集合计划合同》、托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应在下一个工作日及时核对，并以书面形式向托管人发出回函，进行解释或举证。

在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。托管人有义务要求管理人赔偿因其违反《集合计划合同》而致使份额持有人遭受的损失。

对于依据交易程序尚未成交的且托管人在交易前能够监控的投资指令，托管人发现该投资指令违反相关法律法规规定或者违反本协议约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并向中国证监会报告。

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，托管人发现该投资指令违反法律法规或者违反本协议约定的，应当立即通知管理人，并报告中国证监会。

管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复托管人并改正，就托管人的疑义进行解释或举证，对托管人按照法规要求需向中国证监会报送监督报告的，管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

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

### 三、管理人对托管人的业务核查

管理人对托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于托管人

安全保管集合计划财产、开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、复核管理人计算的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督集合计划投资运作等行为。

管理人发现托管人擅自挪用集合计划财产、未对集合计划财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行管理人资金划拨指令、泄露集合计划投资信息等违反《基金法》、《集合计划合同》、本托管协议及其他有关规定时，管理人应及时以书面形式通知托管人限期纠正，托管人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向管理人发出回函。在限期内，管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正，并予协助配合。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正或未在合理期限内确认的，管理人应报告中国证监会。管理人有义务要求托管人赔偿集合计划因此所遭受的损失。

管理人发现托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和中国银保监会，同时通知托管人限期纠正。

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

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

#### 四、集合计划财产的保管

##### （一）集合计划财产保管的原则

- 1、集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。
- 2、托管人应安全保管集合计划财产。未经管理人的有效指令，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何财产。
- 3、托管人按照规定开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。
- 4、托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，与托管人的其他业务和其他集合资产管理计划、其他基金的托管业务实行严格的分账管理，确保集合计划财产的完整与独立。
- 5、对于因集合计划份额申购、集合计划投资过程中产生的应收财产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日集合计划财产没有到

达托管人处的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收。由此给集合计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿集合计划的损失，托管人应对管理人的追偿行为给予必要的协助与配合。

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

7、除依据法律法规和《集合计划合同》的规定外，托管人不得委托第三人托管集合计划资产。

## （二）集合计划的银行账户的开立和管理

托管人负责为集合计划在其营业机构开设资产托管专户，保管集合计划的银行存款。该账户的开设和管理由托管人承担。本集合计划的一切货币收支活动，均需通过集合计划的资产托管专户进行。

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。托管人和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；亦不得使用集合计划的任何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》以及中国银保监会的其他规定。

当本协议项下托管账户被有权机关查询、冻结或扣划款项时，托管人按照有权机关要求依法予以执行。相关手续办理完毕后，托管人可以根据业务需要通知管理人，但法律法规或监管要求另有规定的除外。

## （三）集合计划证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

托管人负责根据相关法律法规在中国证券登记结算有限公司开设证券账户。

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

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

## （四）债券托管账户的开立和管理

1、《集合计划合同》生效后，管理人负责以集合计划的名义申请并取得进入

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

2、管理人负责为集合计划对外签订全国银行间债券市场回购主协议，正本由管理人保管。

#### （五）其他账户的开设和管理

在本托管协议订立日之后，本集合计划被允许从事符合法律法规规定和《集合计划合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《集合计划合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### （六）集合计划财产投资的有关银行存款证实书、实物证券等有价凭证的保管

集合计划财产投资的有关实物证券由托管人存放于托管人的保管库。属于托管人实际有效控制下的实物证券在托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由托管人承担。

#### （七）与集合计划财产有关的重大合同的保管

由管理人代表集合计划签署的与集合计划有关的重大合同的原件分别应由托管人、管理人保管。除本协议另有规定外，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尽量保证集合计划一方持有两份以上的正本，以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件。管理人在合同签署后30个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达托管人处。合同原件应存放于管理人和托管人各自文件保管部门20年以上，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

#### （八）特别约定

本协议属于对中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划的规范，本协议生效后，针对以中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划的名义已经开立的账户，包括但不限于托管账户、证券账户、银行间账户、开放式集合计划账户、存款账户等，管理人与托管人应互相配合，共同完成账户名称及开

户资料的变更。

## 五、集合计划资产净值计算和会计核算

### （一）集合计划资产净值的计算

#### 1、集合计划资产净值的计算、复核的时间和程序

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。各类集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，该类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制，具体可参见管理人届时的相关公告。国家法律法规另有规定的，从其规定。

管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或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。集合计划净值信息由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值并以双方认可的方式发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后以双方认可的方式发送给管理人，由管理人按规定对集合计划净值信息予以公布。

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

### （二）集合计划资产估值方法

#### 1、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。

#### 2、估值对象

本集合计划所拥有的债券和银行存款本息、国债期货合约、应收款项、其它投资等资产及负债。

#### 3、估值方法

(1) 证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市的有价证券（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（集合计划合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

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

4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；如成本能够近似体现公允价值，可按成本法估值，但管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整；

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、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首

次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 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。

(6) 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。

(7) 银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

(8) 回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

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

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

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

如管理人或托管人发现集合计划估值违反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。

(三) 估值差错处理

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 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，需要修改登记机构交易数据的，由登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。

#### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业另有通行做法，协议双方人应本着平等和保护份额持有人利益的原则进行协商。

#### 5、特殊情况的处理

(1) 管理人或托管人按估值方法第(9)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，或由于证券/期货交易所、登记结算公司等机构发送的数据错误等原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现该错误的，由此造成的集合计划资产估值错误，管理人和托管人免除赔偿责任，但管理人、托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### 6、暂停估值的情形

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

(2) 因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

(4) 中国证监会和集合计划合同认定的其它情形。

#### （四）集合计划账册的建立

管理人和托管人在《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，管理人和托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到集合计划资产净值的计算和公告的，以管理人的账册为准。

#### （五）集合计划定期报告的编制和复核

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

《集合计划合同》生效后，集合计划招募说明书、产品资料概要的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新集合计划招募说明书、产品资料概要并登载在规定网站上；集合计划招募说明书其他信息发生变更的，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、产品资料概要。管理人在季度结束之日起15个工作日内完成集合计划季度报告编制并公告；在上半年结束之日起两个月内完成集合计划中期报告编制并公告；在每年结束之日起三个月内完成集合计划年度报告编制并公告。《集合计划合同》生效不足2个月的，管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

管理人在月度报表完成当日，以双方认可的方式将有关报表提供托管人复核；托管人在收到后立即进行复核，并将复核结果以双方认可的方式通知管理人。管理人在季度报告完成当日，将有关报告以双方认可的方式提供托管人复核，托管人在收到后5个工作日内进行复核，并将复核结果以双方认可的方式通知管理人。管理人在中期报告完成当日，将有关报告以双方认可的方式提供托管人复核，托管人在收到后10日内进行复核，并将复核结果以双方认可的方式通知管理人。管理人在年度报告完成当日，将有关报告以双方认可的方式提供托管人复核，托管人在收到后15日内复核，并将复核结果以双方认可的方式通知管理人。

托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，管理人和托管人应

共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。如果管理人与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，管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，托管人有权就相关情况报证监会备案。

托管人在对季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，应根据相关法律法规进行书面或电子确认，以备有权机构对相关文件审核时提示。

#### （六）实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

### 六、集合计划份额持有人名册的保管

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

集合计划份额持有人名册由集合计划的登记机构根据管理人的指令编制和保管，管理人和托管人应按照相关规则分别保管集合计划份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。集合计划份额登记机构对集合计划份额持有人名册的保存期限自集合计划账户销户之日起不得少于20年，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

管理人应当及时向托管人提交下列日期的集合计划份额持有人名册：《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益登记日、每年6月30日、每年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。其中每年12月31日的集合计划份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；

《集合计划合同》生效日、《集合计划合同》终止日等涉及到集合计划重要事项日期的集合计划份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

托管人以电子版形式妥善保管集合计划份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为20年以上。托管人不得将所保管的集合计划份额持有人名册用于集合计划托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

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

### 七、争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对双方当事人均有约束力，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

争议处理期间，协议双方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》和本协议规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律（为本协议之目的，不含港澳台地区法律）管辖。

## 八、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》的约定有任何冲突。托管协议的变更报中国证监会备案。

#### 2、托管协议终止的情形

发生以下情况，经履行相关程序后，本托管协议终止：

- （1）《集合计划合同》终止；
- （2）托管人解散、依法被撤销、破产或有其他托管人接管集合计划资产；
- （3）管理人解散、依法被撤销、破产或有其他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》、本协议规定的终止事项。

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

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

事活动。

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

#### 6、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。

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

规定报刊上。

（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托管人保存，保存时间不低于法律法规规定的最低期限。

---

---

## 第二十一部分 对集合计划份额持有人的服务

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

### 一、公开信息披露服务

包括公开披露集合计划管理人信息、披露集合计划基本信息、其他需要公开披露的信息。

### 二、集合计划转换

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

### 三、定期定额投资

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

### 四、资讯服务

管理人利用自己的网站、APP为集合计划投资者提供网上资讯服务。

### 五、管理人联系方式

中信建投证券股份有限公司客服电话：【4008-888-108】

网址：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

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。

---

---

## 第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在管理人和销售机构的办公场所和营业场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。投资者也可在管理人指定的网站上进行查阅。

---

---

## 第二十三部分 备查文件

(一) 中国证监会准予中信建投季享收益集合资产管理计划变更为中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划的文件

(二) 中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同

(三) 中信建投悠享12个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议

(四) 法律意见书

(五) 管理人业务资格批件、营业执照

(六) 托管人业务资格批件、营业执照

(七) 中国证监会要求的其他文件

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