

---

# 兴证证券资产管理有限公司

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划

招募说明书(更新)

(2023年第3号)

管理人：兴证证券资产管理有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司

二〇二三年十二月

## 重要提示

2020年4月13日，资产管理合同正式生效，兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划自该日起正式变更为兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划。

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

管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划财产，但不保证投资本集合计划一定盈利，也不保证份额持有人的最低收益。因集合计划价格可升可跌，亦不保证份额持有人能全数取回其原本投资。

本集合计划投资于证券市场，集合计划净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本集合计划之前，需全面认识本集合计划产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本集合计划的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受集合计划的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本集合计划可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于份额持有人连续大量赎回集合计划产生的流动性风险，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，本集合计划投资策略所特有的风险等。

本集合计划是混合型集合资产管理计划，其预期收益和风险水平高于债券型集合资产管理计划和货币型集合资产管理计划，低于股票型集合资产管理计划。本集合计划财产投资于科创板股票，会面临科创板因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。本集合计划可根据投资策略需要或市场环境变化，可选择将集合计划财产投资于北京证券交易所股票或选择不将集合计划财产投资于北京证券交易所股票，集合计划资产并非必然投资于北京证券交易所股票。投资北京证券交易所股票的风险包括但不限于中小企业经营风险、股价大幅波动风险、企

业退市风险、流动性风险、系统性风险、监管规则变化的风险、集中度风险、表决权差异化风险、上市交易差异化风险等。

投资者在投资本集合计划之前，请仔细阅读本集合计划的招募说明书和资产管理合同，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，谨慎做出投资决策。集合计划的过往业绩并不预示其未来表现。管理人管理的其他集合计划的业绩并不构成本集合计划业绩表现的保证。

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

本集合计划单一投资者持有集合计划份额数不得达到或超过集合计划份额总数的 50%，但在集合计划运作过程中因集合计划份额赎回、管理人委托的登记机构技术条件不允许等管理人无法予以控制的情形导致被动达到或超过 50%的除外。

本集合计划 A 类份额的最短持有期为 1 年，最短持有期内，投资者不能提出申请赎回所持有的该笔 A 类集合计划份额，期满后投资者可提出赎回申请。

本次招募说明书更新内容为集合计划存续期限、管理人以及托管人基本信息。本招募说明书所载内容截止至 2023 年 12 月 20 日，集合计划投资组合报告和集合计划业绩表现截止至 2023 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目 录

第一部分 绪言 .....	1
第二部分 释义 .....	2
第三部分 管理人 .....	7
第四部分 托管人 .....	16
第五部分 相关服务机构 .....	21
第六部分 集合计划的历史沿革 .....	23
第七部分 集合计划的存续 .....	24
第八部分 集合计划份额的申购与赎回 .....	25
第九部分 集合计划的投资 .....	38
第十部分 集合计划的业绩 .....	51
第十一部分 集合计划的财产 .....	54
第十二部分 集合计划资产估值 .....	55
第十三部分 集合计划费用与税收 .....	61
第十四部分 集合计划的收益与分配 .....	65
第十五部分 集合计划的会计与审计 .....	67
第十六部分 集合计划的信息披露 .....	68
第十七部分 风险揭示 .....	75
第十八部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算 .....	86
第十九部分 资产管理合同的内容摘要 .....	88
第二十部分 托管协议内容摘要 .....	113
第二十一部分 对份额持有人的服务 .....	133
第二十二部分 其他应披露事项 .....	<b>错误！未定义书签。</b>
第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式 .....	135
第二十四部分 备查文件 .....	138

## 第一部分 绪言

《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）由兴证证券资产管理有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集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》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106号，以下简称“《意见》”）、《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》和其他有关法律法规的规定以及《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）编写。

本招募说明书阐述了兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本集合计划是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由兴证证券资产管理有限公司负责解释。本管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本集合计划的《资产管理合同》编写，并经中国证监会确认。《资产管理合同》是约定集合计划当事人之间权利、义务的法律文件。投资者自依《资产管理合同》取得份额，即成为份额持有人和《资产管理合同》的当事人，其持有份额的行为本身即表明其对《资产管理合同》的承认和接受，并按照《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。投资者欲了解份额持有人的权利和义务，应详细查阅《资产管理合同》。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合资产管理计划、本集合计划或集合计划：指兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划

2、管理人：指兴证证券资产管理有限公司

3、托管人：指中国工商银行股份有限公司

4、资产管理合同：指《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》及对本集合资产管理计划资产管理合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指本集合计划管理人与托管人就本集合计划签订的《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

7、集合计划产品资料概要：指《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对资产管理合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

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

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

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

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

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

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

14、《意见》：指 2018 年 4 月 27 日中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会及国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106 号）

15、《操作指引》：指中国证监会 2018 年 11 月 28 日颁布且于同日实施的《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》及颁布机关对其不时做出的修订

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、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

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

19、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于公开募集证券投资基金的自然人

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

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

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

23、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公开募集证券投资基金的其他投资人的合称

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

25、销售业务：指本集合计划管理人或销售机构宣传推介本集合计划，发售本集合计划份额，办理份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务。

26、销售机构：指兴证证券资产管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得证券投资基金销售业务资格并与管理人签订了集合资产管理计划销售服务协议，办理本集合计划销售业务的机构

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

28、登记机构：指办理登记业务的机构。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或接受管理人委托代为办理登记业务的机构

29、登记账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、管理人所管理的本集合计划份额余额及其变动情况的账户

30、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认购、申购、赎回等业务而引起的份额变动及结余情况的账户

31、资产管理合同生效日：指《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》的生效之日，《兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划资产管理合同》自同日起失效；

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

33、存续期：本集合计划自《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》变更生效日起存续期至 2024 年 12 月 31 日，期限届满后，按照中国证监会有关规定执行

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：指为投资人办理份额申购、赎回或其他业务的工作日

38、开放时间：指开放日本集合计划接受申购、赎回或其他交易的时间段

39、申购：指资产管理合同生效后，投资人根据资产管理合同和招募说明书的规定申请购买集合计划份额的行为

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

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

42、转托管：指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份额销售机构的操作

43、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理本集合计划申购申请的一种投资方式

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

45、元：指人民币元

46、集合计划收益：指本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本集合计划财产带来的成本和费用的节约

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

48、集合计划资产净值：指本集合计划资产总值减去负债后的价值

49、集合计划份额净值：指计算日本集合计划资产净值除以计算日本集合计划份额总数

50、集合计划资产估值：指计算评估本集合计划资产和负债的价值，以确定本集合计划资产净值和份额净值的过程

51、A 类份额：指依据资产管理合同，在投资者申购时收取申购费用，且设置 1 年最短持有期的份额

52、C 类份额：指在本集合计划存续期间，只开放赎回，不开放申购的份额。投资者依据原《兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合计划 C 类份额

53、最短持有期：指本集合计划对每笔有效申购的 A 类份额设置 1 年的最短持有期，最短持有期内，投资者不能提出赎回申请，期满后投资者可以申请赎回。申购份额的最短持有期的起始日为申购申请确认日，对应的最短持有期到期日为申购申请确认日 1 年后的对日的前一个工作日，若对日不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日视同为对日

54、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”，包括管理人网站、托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

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

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

57、不可抗力：指资产管理合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件。

## 第三部分 管理人

### 一、管理人概况

名称：兴证证券资产管理有限公司

住所：福建省福州市平潭综合实验区管委会现场指挥部办公大楼一楼

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 9 楼

成立时间：2014 年 6 月 9 日

法定代表人：孙国雄

批准设立机关及批准设立文号：证监许可[2014]145 号

注册资本：8 亿元

电话：021-38565866

传真：021-68581323

客服电话：95562-3

网址：<http://www.ixzzcgl.com/>

联系人：高丹丹

### 二、主要人员情况

#### （一）董事会成员

孙国雄，兴证证券资产管理有限公司董事长、党委书记、法定代表人。研究生学历，硕士学位。1993 年参加工作，历任福建证券交易中心登记托管部经理，兴业证券经纪业务部总经理、执行总经理，福州五一南路证券营业部总经理，兴业证券战略规划与培训小组总经理，兴业证券研究发展中心总经理，兴业证券总裁助理、投资银行总部执行董事总经理，兴业证券人力资源部（党委组织部）总经理，兴证财富管理学院院长，兴业证券纪检监察室主任，兴业证券公司办公室（党委宣传部）主任，兴业证券纪委副书记、党委办公室主任、党群工作部部长、集团办公室主任、党委宣传部部长、兴证党校副校长等职务。

徐翔，兴证证券资产管理有限公司董事、总裁。研究生学历，硕士学位。2000 年参加工作，历任上海世基投资顾问有限公司研发部分析师，国家开发银行总行资金局交易中心交易员，德意志银行（中国）有限公司环球市场部交易员，澳新银行（中国）有限公司全球金融市场部交易总监，德意志银行（中国）有限公司环球市场部交易主管，永赢基金管理有限公司总经理助理、副总经理。

熊博，兴证证券资产管理有限公司董事、兴业证券销售交易业务总部总经理。研究生学历，博士学位。2000年参加工作，历任陕西巨丰投资咨询有限公司研发部副经理，兴业证券西安营业部客户服务部副经理、业务拓展部经理，兴业证券经纪业务总部营销策划岗，兴业证券西安营业部副总经理、总经理，兴业证券私人客户总部副总经理，兴业证券零售客户部副总经理、总经理，兴业证券私人财富管理总部常务副总经理，鑫鼎盛期货有限公司董事长，兴业证券私人财富管理业务委员会委员、财富管理部总经理、经纪业务总部副总经理，兴业证券北京分公司总经理。

郑弘，兴证证券资产管理有限公司董事、兴业证券股份有限公司计划财务部总经理。本科学历，学士学位。1994年参加工作，1997年进入兴业证券股份有限公司工作，历任台江证券营业部财务岗，计划财务部财务管理部经理，计划财务部副总监，计划财务部副总经理，计划财务部总经理兼会计核算部总经理。

王涵，兴证证券资产管理有限公司董事、兴业证券股份有限公司首席经济学家，经济与金融研究院副院长、首席宏观分析师。研究生学历，博士学位。2007年参加工作，历任德国耶拿大学博士后研究员，莫尼塔投资发展有限公司经济学家，兴业证券股份有限公司研究所首席宏观分析师，研究所副总经理，经济与金融研究院副院长，首席经济学家。

## （二）监事会成员

蔡晓斌，兴证证券资产管理有限公司监事会主席、兴业证券股份有限公司风险管理部总经理。研究生学历，博士学位。2005年参加工作，历任美国费城 Exelon Corporation 高级风控研究员，美国纽约 Del Mar Asset Management 高级量化投资研究员、风控经理，美国纽约美联储央行监管部高级银行监控专员，兴业证券股份有限公司合规与风险管理部副总经理、风险管理部总经理兼投融资业务审批部总经理。

颜建锭，兴证证券资产管理有限公司监事、兴业证券股份有限公司合规管理部副总经理。本科学历，硕士学位。2000年参加工作，历任兴业证券福州五四北路营业部电脑部副经理，北京赵登禹路营业部电脑部经理，风险管理部稽核审计岗，风险管理部负责人，合规与风险管理部经理，合规二部经理，合规与风险管理部总经理助理，经纪业务合规与反洗钱处总监，兴业证券股份有限公司合规

管理部副总经理兼经纪业务合规与反洗钱处总监。

宋琳，兴证证券资产管理有限公司监事、兴证证券资产管理有限公司合规风控部总经理。研究生学历，硕士学位。2009年参加工作，历任兴业证券股份有限公司客户资产管理部风险管理专员，上海资产管理分公司风险控制部总监，兴证证券资产管理有限公司合规风控部总经理。

### （三）公司高级管理人员

徐翔，兴证证券资产管理有限公司董事、总裁，研究生学历，硕士学位。2000年参加工作，历任上海世基投资顾问有限公司研发部分析师，国家开发银行总行资金局交易中心交易员，德意志银行（中国）有限公司环球市场部交易员，澳新银行（中国）有限公司全球金融市场部交易总监，德意志银行（中国）有限公司环球市场部交易主管，永赢基金管理有限公司总经理助理、副总经理。

郭贤琚，兴证证券资产管理有限公司副总裁、党委委员、纪委书记、公募业务部总经理。研究生学历，硕士学位。2000年进入金融行业，历任兴业证券网上业务部、经纪业务部营销岗，兴全基金筹备组成员，国海富兰克林基金人力资源及行政管理部总经理，兴证全球基金综合管理部总监、董秘，兴证全球基金市场部总监，兴证全球基金上海分公司总经理。

付志坚，兴证证券资产管理有限公司总裁助理、首席风险官、合规总监、党委委员。研究生学历，硕士学位。2002年参加工作，历任兴业证券股份有限公司计划财务部财务分析师，兴业证券股份有限公司营销管理总部运营管理部经理，第一创业证券股份有限公司经纪业务总部运营负责人，第一创业证券股份有限公司杭州营业部总经理，兴业证券股份有限公司资产管理分公司副总监，兴证证券资产管理有限公司董事副总经理，兴证证券资产管理有限公司总裁助理，兼任综合管理部总经理、党委办公室主任、纪检监察室主任。

### （四）本集合计划投资经理

#### 1、现任投资经理

匡伟，兴证证券资产管理有限公司权益研究部副总经理、公募业务部公募权益投资处公募投资经理，权益投资副总监。北京理工大学硕士。2008年7月进入金融行业，曾任天相投资顾问有限公司医药分析师，万家基金管理有限公司医药分析师。2014年10月加入兴证证券资产管理有限公司，历任研究部研究员、

权益投资部投资经理、权益投资部总经理助理、公募投资部总经理助理、公募投资部副总经理。2021年12月1日至2022年9月30日任兴证资管金麒麟兴享优选一年持有期混合型集合资产管理计划的投资经理，2021年12月13日至2022年9月30日任兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划的投资经理，2020年4月13日起任兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划的投资经理，2021年8月2日起任兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划的投资经理。

游臻，兴证证券资产管理有限公司公募业务部公募固收投资处公募投资经理。新加坡管理大学应用金融理学硕士。2012年9月进入金融行业，任兴业证券股份有限公司资产管理分公司交易员。2014年12月加入兴证证券资产管理有限公司，历任交易运营部交易员、固定收益部投资经理、公募投资部公募投资经理。2021年7月29日起任兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划的投资经理，2021年8月2日起任兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划的投资经理，2021年12月1日起任兴证资管金麒麟兴享优选一年持有期混合型集合资产管理计划的投资经理，2021年12月13日起任兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划的投资经理，2022年9月16日起任兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合型集合资产管理计划的投资经理，2022年10月11日起任兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划的投资经理。

## 2、过往投资经理

李健，任职期间：2020年4月13日至2020年4月30日。

### （五）投资决策委员会成员

主任委员：郭贤珺，兴证证券资产管理有限公司副总裁、党委委员、纪委书记、公募业务部总经理。

委员：郑方镛，兴证证券资产管理有限公司总裁助理、权益研究部总经理、公募业务部公募权益投资处总经理、公募业务部公募固收投资处总经理、权益投资总监、公募投资经理。

王德伦，兴证证券资产管理有限公司总裁助理、首席经济学家、固收研究部总经理、公募业务部公募组合投资处总经理、资产配置总监、公募投资经理。

匡伟，兴证证券资产管理有限公司权益研究部副总经理、公募业务部公募投资经理、权益投资副总监。

(六) 上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、管理人的职责

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

(二) 办理集合计划备案手续；

(三) 对所管理的不同集合计划财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

(四) 计算并公告集合计划资产净值，确定集合计划份额申购、赎回价格；

(五) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(六) 编制季度、半年度和年度集合计划报告；

(七) 按照《资产管理合同》的约定确定集合计划收益分配方案，及时向份额持有人分配收益；

(八) 办理与集合计划财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(九) 召集集合计划份额持有人大会；

(十) 保存集合计划财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

(十一) 以管理人名义，代表份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(十二) 中国证监会规定的其他职责。

### 四、管理人的承诺

(一) 本管理人承诺严格遵守现行有效的相关法律、法规、规章、《资产管理合同》和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反现行有效的有关法律、法规、规章、《资产管理合同》和中国证监会有关规定的行为发生。

(二) 本管理人承诺严格遵守《证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

- 1、将管理人固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资；
- 2、不公平地对待管理人管理的不同集合计划财产；
- 3、利用集合计划财产为份额持有人以外的第三人谋取利益；

- 4、向份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- 5、法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

（三）本管理人承诺加强员工管理和培训，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下活动：

- 1、越权或违规经营；
- 2、违反《资产管理合同》或《托管协议》；
- 3、故意损害份额持有人或其他集合计划相关机构的合法利益；
- 4、在向中国证监会报送的资料中弄虚作假；
- 5、拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- 6、玩忽职守、滥用职权；

7、违反现行有效的有关法律、法规、规章、《资产管理合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密，尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息；

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

- 9、贬损同行，以抬高自己；
- 10、以不正当手段谋求业务发展；
- 11、有悖社会公德，损害证券投资基金从业人员形象；
- 12、在公开信息披露和广告中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- 13、其他法律、行政法规以及中国证监会禁止的行为。

#### （四）投资经理承诺

1、依照有关法律、法规和《资产管理合同》的规定，本着谨慎的原则为份额持有人谋取最大利益；

2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；

3、不违反现行有效的有关法律、法规、规章、《资产管理合同》和中国证监会的有关规定，泄漏在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密、尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息；

4、不从事损害集合计划财产和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



（一）公司内部控制的总体目标：

建立强有力的内部控制体系和风险管理核心竞争力，确保风险可测、可控、可承受，促进公司业务长远健康发展和战略目标的实现。

（二）内部控制制度概述

内部控制制度是指公司为实现内部控制目标而建立的一系列组织机制、管理方法、操作规程与控制措施的总称。内部控制制度由基本制度、管理办法、操作规程等组成。

基本制度和管理办法包括内部控制制度、全面风险管理制度、合规管理制度、投资管理制度、监察稽核制度、集合资产管理业务会计制度、信息披露制度、信息技术管理制度、档案管理制度和紧急应变制度等。

操作规程是在基本制度和管理办法的基础上，对各部门、各业务、各流程的主要职责、岗位设置、岗位责任、操作流程等的具体说明和要求。

（三）公司完善内部控制制度应当遵循以下原则：

- 1、合法合规性原则。公司内控制度符合国家法律、法规、规章和各项规定。
- 2、全面性原则。内部控制制度涵盖公司经营管理的各个环节，不得留有制度上的空白或漏洞。
- 3、审慎性原则。制定内部控制制度以审慎经营、防范和化解风险为出发点。
- 4、适时性原则。随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化及时的修改或完善内部控制制度。
- 5、明晰性原则。各项控制制度以防范和化解风险为出发点，明确各项业务流程、职责权限以及风险预防和控制措施等，避免矛盾和冲突。

（四）公司主要内部控制制度

1、投资管理制度

公司健全投资决策授权管理制度，明确界定投资权限和投资额度管理，严格遵守投资限制，防止越权决策。公司建立科学的标的备选池、交易管理、投资业绩评价制度，建立和维护备选池、实施交易的集中管理和控制，对产品投资组合情况、是否符合集合计划产品特征、集合计划绩效归因等进行分析。

2、会计管理制度

公司根据法律法规及业务的要求建立集合资产管理业务会计制度，对于公司

管理的不同资产管理计划独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

### 3、资金管理制度

公司制定资金管理制度，经营管理层负责制定公司资金管理政策和资产配置策略，及时根据市场变化趋势对资产配置做出调整，审议公司自有资金年度计划及资金筹集、分配、使用方案，对资金定价、资产负债率和杠杆率水平、流动性风险监控指标等做出决策及制度安排。财务负责人是资金管理的具体负责人，负责资金筹集、定价及日常管理工作，包括筹集资金和筹资成本的控制与管理，内部资金定价的测算与调整，资金分配与划拨，资金使用效率分析，存量资金保值与增值等，满足公司流动性管理需要。合规风控部牵头组织资金管理和流动性风险管理的制度建设，对各单位资金运用情况实施风险监测和压力测试，评估信用、市场、操作等各类风险对公司资金安全的影响，关注不同风险间的转化和传递。各业务部门按照公司资金管理的规定提出资金计划及使用资金，实施有效资金管理内部控制措施，提高资金使用效益，确保资金运用安全。

### 4、合规稽核与风险管理制度

公司根据监管规定建立合规管理制度、全面风险管理制度和监察稽核制度，确立风险管理三道防线，即各部门实施有效自我控制为第一道防线，合规风控部在事前和事中实施专业的风险管理为第二道防线，审计监察实施事后监督、评价为第三道防线，具体执行公司“市场风险、信用风险、操作风险、流动性风险、合规风险、法律风险”管理专项控制和“风险识别、风险审查、风险评估与度量、风险处理、风险报告与反馈、风险监督与检查”全方面多维度控制。

### 5、员工管理制度

公司直接适用母公司兴业证券股份有限公司（以下简称“兴业证券”）的聘用、培训、绩效考核、晋升与薪酬管理制度，根据国家的工资政策、公司的薪酬制度和管理办法以及个人业绩考核制度。

### 6、信息技术制度

公司直接适用母公司兴业证券的信息技术相关制度。根据国家法律法规及日常工作需要，兴业证券制定了信息安全管理、信息技术变更管理制度、应急

管理制度、机房安全管理制度、网站管理制度、技术服务商管理制度、数据管理制度等多项信息技术制度，使技术管理更加规范。维护工作完全按照一整套规范化的操作流程运维管理。兴业证券信息技术部下系统运行处制定了每日操作流程、周和月维护操作流程、变更管理流程、专项维护流程等。

## 第四部分 托管人

### 一、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号  
成立时间：1984 年 1 月 1 日  
法定代表人：陈四清  
注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元  
联系电话：010-66105799  
联系人：郭明

### 二、主要人员情况

截至 2023 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 人，平均年龄 34 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### 三、托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2023 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1365 只。自 2003 年以来，本行连续二十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 95 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内

托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

#### 四、托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从 2005 年至今共十六次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

##### 1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

##### 2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设投资监督处、风险管理处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的投资监督处与风险管理处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

##### 3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，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，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效

益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

#### 5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管

部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

## **五、托管人对管理人运作集合计划进行监督的方法和程序**

工商银行作为托管人，根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和有关证券法规的规定，对集合计划的投资对象、集合计划资产的投资组合比例、集合计划资产的核算、集合计划资产净值的计算、管理人报酬的计提和支付、托管人报酬的计提和支付、集合计划的申购资金的到账与赎回资金的划付、集合计划收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。工商银行作为托管人，发现管理人有违反《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和《资产管理合同》的行为，及时通知管理人予以纠正，管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。工商银行有权对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对工商银行通知的违规事项未能及时纠正的，工商银行有权报告中国证监会。工商银行作为托管人，发现管理人有重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知管理人限期纠正。



## 第五部分 相关服务机构

### 一、份额销售机构

#### （一）直销机构

兴证证券资产管理有限公司

地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 9 楼

法定代表人：孙国雄

客服电话：95562-3

网址：<http://www.ixzcggl.com/>

#### （二）其他销售机构

具体非直销销售机构参见管理人网站。管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和《资产管理合同》等的规定，选择其他符合要求的机构销售本集合计划，并及时履行信息披露义务。

### 二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

联系人：苑泽田

电话：010-59378697

传真：010-59378839

### 三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：国浩律师（上海）事务所

办公地址：上海市静安区北京西路 968 号嘉地中心 27 层

负责人：徐晨

电话：021-52341668

联系人：周蕾

经办律师：宣伟华、周蕾

### 四、审计集合计划财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东2办公楼8层

办公地址：上海静安区南京西路1266号恒隆广场二期16楼

执行事务合伙人：邹俊

电话：010-85085000

联系人：蔡晓晓

经办注册会计师：黄小熠、蔡晓晓

## 五、其他服务机构及委托办理业务的有关情况

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，由于公司是兴业证券的全资子公司，这些系统在公司筹建之初就由兴业证券或专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理也由兴业证券与专业的系统集成公司负责，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初及近些年陆续采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由兴业证券与专业的系统集成公司负责，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外，本公司可以根据自身发展战略的需要，委托资质良好的基金服务机构代为办理集合计划份额登记、估值核算等业务。

## 第六部分 集合计划的历史沿革

2013年7月8日，中国证券业协会作出《关于兴业证券股份有限公司发起设立兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函〔2013〕666号），兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划设立，自2013年5月8日起向社会公众发行，2013年5月24日结束募集并于2013年5月29日成立。2014年10月30日，兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划变更为兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划。

2020年4月13日，资产管理合同正式生效，兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划自该日起正式变更为兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划。

资产管理合同正式生效之日前一个工作日日终（即折算基准日），所有登记在册的份额持有人所持本集合计划份额净值调整为1.00元，折算后，份额持有人持有的本集合计划C类份额数按照份额的折算比例进行相应增减。

份额的折算比例=折算基准日折算前集合计划资产净值/折算基准日折算前集合计划总份额/1.00

经折算后的C类份额数=折算基准日折算前持有集合计划的份额×份额的折算比例

经折算后的C类份额数四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担，计算结果以登记机构的记录为准。鉴于折算基准日后一工作日，经折算后的C类份额数方被销售机构处理，因此折算基准日后一工作日，管理人有权暂停接受投资人的赎回申请，但应在实施前予以公告。

## 第七部分 集合计划的存续

资产管理合同生效后，连续 20 个工作日出现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、与其他公开募集性质的集合资产管理计划合并或者终止《资产管理合同》等，并在 6 个月内召开集合计划份额持有人大会进行表决。

本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期至 2024 年 12 月 31 日，期限届满后，按照中国证监会有关规定执行。如本集合计划到期后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合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、集合计划的运作方式

本集合计划 A 类份额，每份份额设定最短持有期，最短持有期为 1 年。每份 A 类份额的最短持有期到期日即进入开放持有期，期间可以办理赎回业务，每份 A 类份额的开放持有期首日为最短持有期到期日。

最短持有期指 A 类份额申购确认日起至该 A 类份额申购确认日 1 年后的对日的前一个工作日（即最短持有期到期日）止，若该对日不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日视同为对日。

对于 C 类份额，自资产管理合同生效日起每个工作日只开放赎回，不开放申购。

### 二、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。具体的销售网点将由管理人在招募说明书或管理人网站列明。管理人可根据情况变更或增减销售机构。本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本集合计划份额的申购与赎回。

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

具体申购、赎回场所参见管理人关于本集合计划的相关公告。

### 三、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

依据本资产管理合同的约定，本集合计划每笔 A 类份额的最短持有期为 1 年，最短持有期内，投资者不能提出申请赎回所持有的份额，最短持有期到期日及以后投资者可提出赎回申请。

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资产管理合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

资产管理合同生效后，若出现新的证券交易市场、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》的有关规定在指定媒介上公告。

## 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

管理人自本资产管理合同生效之日起不超过 3 个月开始办理 A 类份额的申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。此后的每个工作日为申购业务开放日。本资产管理合同剩余存续期限不足 1 年时，本集合计划的申购届时根据管理人公告办理。

本集合计划 A 类份额的最短持有期到期后，管理人开始办理 A 类份额的赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。对于每份 A 类份额，自其开放持有期首日（即最短持有期到期日）起才能办理赎回。如果投资人多次申购本集合计划 A 类份额，则其持有的 A 类份额的赎回开放时间可能不同。

本集合计划 C 类份额自本资产管理合同生效日起每个工作日开放赎回，不开放申购。

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》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

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

## 四、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在管理人规定的时间以内撤销，但申请经登记机构受理的不得撤销；

4、每类份额赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资人申购的先后次序进行顺序赎回，即登记确认日期在前的份额先赎回，登记确认日期在后的份额后赎回；

5、办理申购、赎回业务时，应当遵循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；

6、管理人有权决定份额持有人持有本集合计划的最高限额和本集合计划的总规模限额，但应最迟在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告；

7、投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守资产管理合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

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》的有关规定在指定媒介上公告。

## 五、申购与赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

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

### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购集合计划份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；集合计划份额登记机构确认集合计划份额时，申购生效。若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成立，申购款项将退回投资人账户，管理人、托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等任何损失。

份额持有人递交赎回申请，赎回成立；集合计划份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回或资产管理合同约定的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照资产管理合同有关条款处理。

遇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，则赎回款项划付时间相应顺延。管理人、托管人和销售机构等不承担由此顺延造成的损失或不利后果。

在发生巨额赎回时或资产管理合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照资产管理合同有关条款处理。

### 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,本集合计划登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人可在T+2日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。

本集合计划销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申请的确认以登记机构或管理人的确认结果为准。对于申请的确认情况,投资者应及时查询。因投资者怠于履行该项查询等各项义务,致使其相关权益受损的,管理人、托管人、销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。若申购不生效,则申购款项退还给投资人。

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

## 六、申购和赎回的数量限制

1、投资人通过销售机构和直销渠道首次申购单笔最低金额为人民币1元,追加申购单笔最低金额为人民币1元;投资人通过直销机构(柜台方式)首次申购单笔最低金额为人民币1元,追加申购单笔最低金额为人民币1元。

2、本集合计划不设单笔赎回份额下限,单个交易账户最低持有份额余额下限为1份。本集合计划不设单个投资人累计持有的集合计划份额上限。

3、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。

4、管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额的数量限制、投资人每个集合计划交易账户的最低集合计划份额余额、单个投资人累计持有的集合计划份额上限等。管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 七、申购费用和赎回费用

1、申购费用



投资人申购集合计划份额在申购时支付申购费用，投资人可以多次申购本集合计划，申购费用按每笔申购申请单独计算。

申购费率如下：

申购金额 (M)	申购费率
单笔<100万元	1.2%
100万元≤单笔<300万元	1.0%
300万元≤单笔<500万元	0.6%
单笔≥500万元	每笔1000元

注：M 为申购金额

本集合计划的申购费用应在投资人申购集合计划份额时收取，不列入集合计划财产，主要用于本集合计划的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

## 2、赎回费用

本集合计划 A 类份额最短持有期为 1 年，C 类份额持有期间自 C 类份额持有人持有原兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划份额被确认之日起连续计算。

赎回费用由赎回集合计划份额的份额持有人承担，在份额持有人赎回集合计划份额时收取，按照持有期限的不同将赎回费按照不同比例计入集合计划财产，赎回费用的其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。持续持有期少于 7 日的，赎回费应全额归入集合计划财产。

本集合份额各类别的赎回费率设置相同，具体如下：

持有期限 (N)	赎回费率
0<N<7 日	1.5%
7 日≤N	0

3、本集合计划的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。

4、管理人可以在《资产管理合同》约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

5、管理人可以在不违反法律法规规定及资产管理合同约定的情形下根据市场情况制定集合计划促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、移动客户端交易）等进行集合计划交易的投资者定期或不定期地开展本集合计划促销活动。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

当调低本集合计划申购费率、赎回费率。

## 八、申购份额与赎回金额的计算

### （一）本集合计划申购份额的计算

申购本集合计划份额的申购费用采用前端收费模式（即申购集合计划时缴纳申购费），投资人的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算方式如下：

当集合计划份额的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（T日）集合计划份额净值。

上述申购费用以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此误差产生的收益或损失由集合计划财产承担。

上述申购份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由集合计划财产承担。

例：某投资人投资5万元申购本集合计划份额，对应费率1.2%，假设申购当日本集合计划份额净值为1.0500元，则可得到的申购份额为：

净申购金额=50,000/（1+1.2%）=49407.11元

申购费用=50,000-49407.11=592.89元

申购份额=49407.11/1.0500=47054.39份

即：如果投资人申购本集合计划份额，则该投资人可获得申购份额为47054.39份。

### （二）赎回金额的计算

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

本集合计划采用“份额赎回”方式，赎回价格以T日的集合计划份额净值为基准进行计算，计算公式：

如果投资人赎回集合计划份额，则赎回金额的计算方法如下：

赎回总额 = 赎回份额 × T日集合计划份额净值

赎回费用 = （赎回总额-业绩报酬） × 集合计划份额赎回费率

赎回金额 = 赎回总额 - 赎回费用 - 业绩报酬

例：某投资人赎回 1 万份本集合计划份额，持有时间为 6 天，对应的赎回费率为 1.5%，假设申购当日集合计划份额净值是 1.1100，赎回当日集合计划份额净值是 1.1200 元，则持有期间年化收益率为 54.80%。则其可得到的赎回金额为：

业绩报酬 =  $(54.80\% - 6\%) \times 20\% \times 1.1100 \times 10000 \times 6 \div 365 = 17.81$  元

赎回总额 =  $10,000 \times 1.1200 = 11,200$  元

赎回费用 =  $(11,200 - 17.81) \times 1.5\% = 167.73$  元

赎回金额 =  $11,200 - 167.73 - 17.81 = 11014.46$  元

即：投资人赎回 1 万份本集合计划份额，持有时间为 6 天，假设赎回当日本集合计划份额净值是 1.1200 元，则其可得到的赎回金额为 11014.46 元。

### （三）本集合计划份额净值的计算

《资产管理合同》生效后，在开始办理集合计划份额申购或者赎回后，管理人应当在每个交易日的次日，通过网站、集合计划份额发售网点以及其他媒介，披露交易日本集合计划份额净值和本集合计划份额累计净值。

本集合计划份额净值计算公式如下：

T 日集合计划份额净值 = T 日闭市后集合计划资产净值 / T 日集合计划份额的余额数量

T 日的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，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本集合计划各类别份额净值的计算，均保留到小数点后 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。

### （四）申购份额、余额的处理方式

申购的有效份额为净申购金额除以当日的集合计划份额净值，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。

### （五）赎回金额的处理方式

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日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。

## 九、申购和赎回的注册登记

(一) 投资人申购集合计划成功后, 登记机构在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续, 投资人自 T+2 日起有权赎回该部分集合计划份额。

(二) 投资人赎回集合计划成功后, 登记机构在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

(三) 管理人可在法律法规允许的范围内, 对上述注册登记办理时间进行调整, 并最迟于开始实施 2 日前在中国证监会指定媒介和管理人网站上予以公告。

## 十、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、因不可抗力导致本集合计划无法正常运转。
- 2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时, 管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市, 导致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份额持有人利益时。
- 5、本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本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因技术故障等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拒绝或暂停接受投资人申购申请时, 管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝, 被拒绝的申购款项本金将退

还给投资人。在暂停申购的情况消除时，管理人应及时恢复申购业务的办理。

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

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致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、中国证监会认定或资产管理合同约定的其他情形。

发生上述情形之一（第 4 项除外）且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按资产管理合同的相关条款处理。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。

## 十二、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，管理人可以根据本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集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 如发生单个开放日内单个份额持有人申请赎回的集合计划份额超过前一开放日的集合计划总份额的 10% 时，本集合计划管理人对该单个份额持有人持有的赎回申请实施全部赎回或者延期办理。

具体分为两种情况：

①如果管理人认为有能力支付其他投资人的全部赎回申请，为了保护其他赎回投资人的利益，对于其他投资人的赎回申请按正常程序进行。对于单个投资人超过集合计划总份额 10% 以上的大额赎回申请，管理人在剩余支付能力范围内对其按比例确认当日受理的赎回份额，未确认的赎回部分作自动延期处理。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时选择取消赎回的，则当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

②如果管理人认为仅支付其他投资人的赎回申请也有困难时，则对于所有投资人的赎回申请(包括单个投资人超过集合计划总份额 10% 以上的大额赎回申请

和其他投资人的赎回申请），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，具体按照上述“（2）部分延期赎回”的约定办理。

（4）暂停赎回：连续 2 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，并应当在指定媒介上进行公告。

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，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 个交易日内通知份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内依据相关规定指定媒介上刊登公告。

## 十三、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

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

## 十四、集合计划转换

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

## 十五、集合计划的非交易过户

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

额的投资人。

继承是指份额持有人死亡，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份额持有人持有的集合计划份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供集合计划登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按集合计划登记机构的规定办理，并按集合计划登记机构规定的标准收费。

## 十六、集合计划的转托管

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

如果出现管理人、登记机构、办理转托管的销售机构因技术系统性能限制或其它合理原因，可以暂停该业务或者拒绝份额持有人的转托管申请。

## 十七、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。

## 十八、集合计划的冻结和解冻

集合计划登记机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻，以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付。法律法规或资产管理合同另有规定的除外。

## 十九、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份额的过户登记。管理人拟受理份额转让业务的，将提前在指定媒介公告相关的业务规则，份额持有人应根据管理人届时公告的业务规则办理份额转让业务。

## 二十、集合计划份额的质押或其他业务

如相关法律法规允许登记机构办理集合计划份额的质押业务或其他集合计



划业务，管理人可制定相应的业务规则并开展相关业务，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则另有规定的，从其规定。

二十、在不违反相关法律法规且对份额持有人利益无实质不利影响的前提下，管理人可以依据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，无需召开份额持有人大会审议。

## 第九部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

本集合计划在严格控制风险的前提下,通过精选有较高成长性和各领域竞争力突出的龙头企业,结合估值水平进行积极的组合管理,追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券(含分离交易的可转债)、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他证券品种。

如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为:

本集合计划股票投资占集合计划总资产的比例为 50%-95%;本集合计划每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货保证金后,应当保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,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

#### (一) 大类资产配置策略

在本集合计划通过定性与定量相结合的方法,对宏观经济的发展周期,各项经济政策对经济发展趋势和证券市场的影响,证券市场中各投资品种的风险收益水平进行评估,确定投资组合中股票、债券、金融衍生品、货币市场工具等大类资产的比例,并适时依据环境变化进行动态调整。

## （二）股票投资策略

本集合计划侧重“自下而上”的选股方法，精选基本面优秀，竞争优势明显，成长性较高的企业在合适的估值水平进行配置。

### 1、通过定量分析筛选出基本面扎实的企业建立初选股票池

管理人通过对上市公司的历史财务数据进行初步筛选，选择较高 ROE、高现金、低有息负债、高于行业平均利润率、现金流与盈利相匹配等财务指标良好的上市公司建立初选股票池。

管理人认为，较高的利润率表明公司具备一定的竞争力；高现金，低有息负债的公司具有较好的风险抵抗力，且在行业底部具备逆势扩张的能力；ROE 较高的公司具备较强的内生增长能力；现金流与盈利匹配的公司，盈利的真实性更可靠。本集合计划选择质地优良的公司作为深入研究的对象。

### 2、对初选池中的股票进行深度研究讨论，选择有投资价值的股票建立投资备选池

对于初选股票池中的上市公司，本集合计划通过案头研究、实地调研、行业专家访谈、产业链上下游印证、销售渠道调研等方式，深入分析公司的竞争力，通过盈利模型预测公司未来的收入和利润情况。

#### （1）公司治理结构分析

本集合计划主要从公司股权结构、董事会构成、组织结构、管理层等几个方面进行公司治理结构的研究。本集合计划倾向于选择上市时间较长，过往历史已经证明其管理规范，经营透明，管理层诚实守信、专注实业、维护大小股东共同利益等各方面表现良好的公司进行投资。

#### （2）深入分析企业的竞争优势

对于初选股票池中的上市公司，本集合计划深入分析其在技术、品牌、渠道、管理、商业模式、特许经营权、成本等方面的竞争力，公司在产业链中的地位，对上下游的议价能力。

#### （3）建立上市公司的盈利预测模型

本集合计划通过上市公司调研和产业链跟踪等方式，了解上市公司所处行业未来的增长速度、产业政策、行业格局的演变、公司产能规划及建设进度、公司市场占有率的变化、产品和原材料价格趋势等，在对收入、成本、费用等参数指

标做出合理假设的基础上，做出公司未来的盈利预测模型。

#### (4) 选择具有投资价值的上市公司进入投资备选池

本集合计划重点选择优秀的成长股和优质的价值股进行投资。

##### ① 优秀的成长股。

相对于企业过往的成长速度，本集合计划更看重其未来的成长性，特别是基于盈利预测模型，未来三年的盈利复合增速超过所在行业平均增速或市场平均增速的企业。

本集合计划重视基于技术或模式创新而处于行业成长期的创新行业，国家产业政策鼓励发展的行业，以及景气度向上反转的周期性行业。高景气度行业内的企业能够跟随行业实现较快的盈利增长率。在稳定增长的行业内，市占率能持续提升的优势企业同样具有较好的成长性。

##### ② 优质的价值股。

对于进入成熟期的传统行业，其中的优质公司能够保持长期稳定的经营回报。在市场风格急剧转换、市场面临系统风险、行业性或公司的短期利空等等情绪大幅波动之下，优质的价值股会出现明显低估而带来较好的投资机会。

本集合计划通过投研联席会议充分讨论通过后，将公司治理规范、财务指标健康、竞争优势突出、成长性较好的上市公司，或传统行业的龙头上市公司纳入投资备选池。

### 3、企业估值分析

本集合计划根据企业所在的行业特点，通过市盈率(PE)、市净率(PB)、市销率(PS)、重估价值(RNAV)、市盈率相对增长比率(PEG)、现金流贴现(DCF)、企业价值/息税摊销前利润(EV/EBITA)、等不同的方式对备选池的股票进行估值衡量。

### 4、构建投资组合

本集合计划将及时评估股票池中备选品种的风险收益比。对于优秀的成长股，主要通过对比国内外同行历史上的PB、PE、PEG和EV/EBITA等指标，评价其估值水平的高低。对于优质的价值股，则通过PB、PE、PS、RNAV、DCF和股息率等指标，来评价其是否被低估。

本集合计划将根据股票的估值水平，动态选择最具性价比的品种进行配置，

规避绝对估值较高的投资标的，追求风险可控下的组合收益最大化。在构建投资组合时，本集合计划还会考虑行业集中度和投资标的的流动性，避免行业集中度过高的风险和流动性不足的风险。

### （三）债券投资策略

#### 1、资产配置策略

本集合计划将通过对宏观经济运行情况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境等重要因素的研究和预测，优化集合计划资产在利率债、信用债以及货币市场工具等各类固定收益类金融工具之间的配置比例。

#### 2、利率类品种投资策略

本集合计划对国债等利率品种的投资，是在对国内外宏观经济运行状况及政策环境等进行分析和预测基础上，研究利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化趋势，深入分析利率品种的收益和风险，预测调整债券组合的平均久期，选择合适的期限结构的配置策略。在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。

#### 3、信用债投资策略

本集合计划将在深入的宏观研究基础上，综合分析各类信用债发行主体所处行业环境、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素后，结合具体发行契约，对债券进行信用评级。在此基础上，建立信用类债券池，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资。

#### 4、可交换债券投资策略

管理人将积极把握新上市可交换债券的申购收益、二级市场的波段机会以及偏股型和平衡型可交换债的战略结构性投资机遇，适度把握可交换债券回售、赎回、修正相关条款博弈变化所带来的投资机会及套利机会，选择最具吸引力标的进行配置。

#### 5、可转债投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本集合计划在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，综合考虑可转换债券的债性和股性，利用可转换公司债券定价模型进行估值分析，并最终选择合适的投资品种。

## 6、资产支持证券投资策略

本集合计划基于对发行主体和资产支持证券风险收益特征的考察,通过对抵押的资产质量和现金流特征的研究,分析资产支持证券可能出现的提前偿付比例和违约率,选择具有投资价值的资产支持证券投资。本计划将会严格控制资产支持证券的投资比例,并且分散投资。

### (四) 金融衍生工具投资策略

#### 1、股指期货投资策略

管理人可能出于套期保值为目的投资股指期货,以回避市场的系统风险。管理人将遵守谨慎性原则,严格控制投资股指期货空头的合约价值,使之与股票组合的多头价值相对应,以对冲特殊情况下的流动性风险,改善组合的风险收益特性。

#### 2、国债期货投资策略

本集合计划对国债期货的投资以套期保值、回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作,获取超额收益。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

本集合计划的投资组合应遵循以下限制:

- (1) 本集合计划股票投资占集合计划总资产的比例为 50%-95%;
- (2) 本集合计划每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货保证金后,应当保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;
- (3) 本集合计划持有一家公司发行的证券,其市值不超过集合计划资产净值的 10%;
- (4) 本集合计划管理人管理的全部大集合资产管理计划(大集合资产管理计划系指投资人数不受 200 人限制的资产管理计划,下同)持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%;
- (5) 本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过集合计划资产净值的 10%;

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

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

(8) 本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合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。本集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

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

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

(13) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合计划资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等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；

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

(15) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(16) 本集合计划投资股指期货、国债期货时，将遵循以下投资比例限制：

1) 本集合计划在任何交易日日终, 持有的买入股指期货合约价值, 不得超过集合计划资产净值的 10%; 本集合计划在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过集合计划资产净值的 15%;

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

3) 本集合计划在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%; 本集合计划在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过集合计划持有的债券总市值的 30%;

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

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

本集合计划在开始进行股指期货或国债期货投资之前, 应与托管人就股指期货或国债期货的开户、清算、估值、交收、投资监督等事宜另行具体协商。

除上述(2)、(9)、(13)、(14)情形之外, 因证券市场波动、上市公司合并、集合计划规模变动等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, 但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

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



自资产管理合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，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。

## 2、禁止行为

为维护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。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，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，无需经份额持有人大会审议。

## 3、关联交易原则

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或变更上述限制，如适用于本集合计划，则本集合计划不再受相关限制或以变更后的规则为准，不需经集合计划份额持有人大会审议。

## 五、业绩比较基准

本集合计划业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*75%+上证国债指数收益率\*25%。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制的反映 A 股市场整体走势的指数，该指数从上海和深圳证券交易所中选取 300 只交易活跃、代表性强的 A 股作为成份股，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强且公信力较好的股票指数，适合作为本集合计划 A 股投资的比较基准。

上证国债指数由上海证券交易所上市的所有固定利率国债组成，编制合理、透明、运用广泛，具有较强的代表性和权威性，适合作为本集合计划债券投资的业绩基准。

随着法律法规和市场环境发生变化，如果上述业绩比较基准不适用本集合计划，或者本集合计划业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布或变更名称，或者推出更权威的能够代表本集合计划风险收益特征的指数，管理人可以依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，与托管人协商一致后，对业绩比较基准进行相应调整，并报中国证监会备案并及时公告，无需召开集合计划份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本集合计划是混合型集合资产管理计划，其预期收益和风险水平高于债券型集合资产管理计划和货币型集合资产管理计划，低于股票型集合资产管理计划。

## 七、管理人代表集合计划行使相关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、本集合计划投资组合报告

本投资组合报告所载数据取自兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告，投资组合报告所载数据截至 2023 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 1 报告期末集合计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占集合计划总资产的比例（%）
1	权益投资	421,797,627.77	80.70
	其中：股票	421,797,627.77	80.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,606,426.23	5.86
	其中：债券	30,606,426.23	5.86
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	70,018,823.05	13.40
8	其他资产	222,904.69	0.04
9	合计	522,645,781.74	100.00

## 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	10,292,436.00	1.98
B	采矿业	8,056,104.00	1.55
C	制造业	273,220,498.53	52.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,220,602.01	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,248,928.99	7.15
J	金融业	19,513,092.00	3.74
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	995,995.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	39,791,156.56	7.64
N	水利、环境和公共设施	6,586.74	0.00

	管理业		
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	29,452,227.94	5.65
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	421,797,627.77	80.94

## 2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

## 3 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例（%）
1	300012	华测检测	2,128,865	39,767,198.20	7.63
2	600519	贵州茅台	17,872	32,143,685.60	6.17
3	000333	美的集团	561,035	31,126,221.80	5.97
4	600426	华鲁恒升	931,300	29,894,730.00	5.74
5	000516	国际医学	3,684,050	29,435,559.50	5.65
6	688111	金山办公	72,991	27,065,062.80	5.19
7	603606	东方电缆	349,900	13,929,519.00	2.67
8	600150	中国船舶	476,879	13,304,924.10	2.55
9	300408	三环集团	372,500	11,547,500.00	2.22
10	000651	格力电器	314,800	11,427,240.00	2.19

## 4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,606,426.23	5.87
	其中：政策性金融债	30,606,426.23	5.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	30,606,426.23	5.87
----	----	---------------	------

## 5 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例（%）
1	210303	21 进出 03	300,000	30,606,426.23	5.87

## 6 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

## 7 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

## 8 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

## 9 报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明

### 9.1 报告期末本集合计划投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

### 9.2 本集合计划投资股指期货的投资政策

本集合计划管理人可能出于套期保值为目的投资股指期货，以回避市场的系统风险。本集合计划管理人将遵守谨慎性原则，严格控制投资股指期货空头的合约价值，使之与股票组合的多头价值相对应，以对冲特殊情况下的流动性风险，改善组合的风险收益特性。

## 10 报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明

### 10.1 本期国债期货投资政策

本集合计划对国债期货的投资以套期保值、回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

## 10.2 报告期末本集合计划投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

## 10.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

## 11 投资组合报告附注

### 11.1 本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内，本集合计划投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

### 11.2 集合计划投资的前十名股票超出集合计划合同规定的备选股票库情况的说明

本报告期内，本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

### 11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	222,056.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	848.45
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	222,904.69

### 11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

### 11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 第十部分 集合计划的业绩

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划财产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

### 一、 集合计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2020.04.13-2020.12.31	48.20%	1.12%	23.81%	0.95%	24.39%	0.17%
2021.1.1-2021.12.31	6.64%	1.25%	-2.84%	0.88%	9.48%	0.37%
2022.1.1-2022.12.31	-20.94%	1.08%	-15.32%	0.96%	-5.62%	0.12%
2023.1.1-2023.9.30	-9.63%	0.74%	-2.78%	0.65%	-6.85%	0.09%

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2020.04.13-2020.12.31	56.08%	1.11%	28.94%	0.92%	27.14%	0.19%
2021.1.1-2021.12.31	6.64%	1.25%	-2.84%	0.88%	9.48%	0.37%
2022.1.1-2022.12.31	-20.94%	1.08%	-15.32%	0.96%	-5.62%	0.12%
2023.1.1-2023.9.30	-9.63%	0.74%	-2.78%	0.65%	-6.85%	0.09%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





注：1、净值表现所取数据截至到 2023 年 9 月 30 日。

2、集合计划的过往业绩不代表未来表现。

## 第十一部分 集合计划的财产

### 一、集合计划资产总值

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

### 二、集合计划净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。

### 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、销售机构和集合计划登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。

### 四、集合计划财产的保管和处分

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

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财产所产生的债权债务不得相互抵销。非因集合计划财产本身承担的债务，不得对集合计划财产强制执行。

## 第十二部分 集合计划资产估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

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

### 三、估值原则

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

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

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

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

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

### 四、估值方法

## 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

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

(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、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

5、对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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。

6、股指期货合约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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

7、国债期货合约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。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

8、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行公布的人民币与港币的中间价。

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、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

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

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

根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管

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

## 五、估值程序

1、集合计划各类别份额净值是按照每个工作日闭市后，集合计划该类别资产净值除以当日集合计划该类别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。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算集合计划资产净值及各类别份额净值，并按规定公告集合计划净值信息。

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资产管理合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将集合计划各类别份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人对外公布。

## 六、估值错误的处理

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

资产管理合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 错误偏差达到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。如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，管理人与托管人应本着平等和保护份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

## 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，管理人应当暂停估值；

4、法律法规规定、中国证监会和资产管理合同认定的其它情形。

## 八、集合计划净值的确认

资产净值和各类别份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的资产净值和各类别份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。

## 九、特殊情况的处理

1、管理人或或托管人按估值方法的第 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、由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误或第三方估值机构提供的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，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消除或减轻由此造成的影响。



## 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、除法律法规、中国证监会另有规定外，《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 4、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的注册登记机构相关费用（包括登记结算费、服务月费、年度电子合同服务费）、审计费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、集合计划份额持有人大会费用；
- 6、集合计划的证券账户等相关账户的开户费用；
- 7、集合计划的证券交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、相关账户费用及其他类似性质的费用等）及投资其他基金的费用；
- 8、集合计划的银行汇划费用、银行账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、管理人的管理费

##### （1）固定管理费

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

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送管理费划款指令，托管人复核后于次月前 2 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### （2）业绩报酬

### （2.1）业绩报酬计提原则

符合业绩报酬计提条件时，在集合计划投资人退出日或本集合计划终止日计提业绩报酬。本集合计划分红日，管理人不提取业绩报酬。

### （2.2）业绩报酬计提方法

业绩报酬计提日为集合计划投资人退出日或本集合计划终止日。以业绩报酬计提期间的年化收益率  $R$ ，作为计提业绩报酬的基准。

$$R = \frac{A - B}{C} \times \frac{365}{N} \times 100\%$$

A=为本次业绩报酬计提日累计单位净值；

B=为上一个业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）的累计单位净值；

C=为上一个业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）的单位净值；

N=为本次计提业绩报酬区间天数，即前一次业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）至本次业绩报酬计提日的间隔天数。

业绩报酬计提日为集合计划投资人退出日或本集合计划终止日。从前一次业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）至本次业绩报酬计提日，若计划单位份额年化收益率  $R$  小于或等于 6% 时，管理人不提取业绩报酬；若计划单位份额年化收益率  $R$  大于 6%，管理人对超过 6% 以上的部分提取 20% 作为业绩报酬。

年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬（H）计算方法
$R \leq 6\%$	0	$H = 0$
$R > 6\%$	20%	$H = (R - 6\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{N}{365}$

（F 为参与计提业绩报酬的份额数）

如投资人退出的份额为多笔参与，则采用“先进先出”法分别对每笔参与的份额计算业绩报酬。

### （3）业绩报酬的支付

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，由管理人向托管人发送划付指令，托管人于收到指令后 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管

理人。

## 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 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送托管费划款指令，托管人复核后于次月前 2 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、集合计划费用的种类”中第 3—8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

## 三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

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

2、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；

3、《资产管理合同》生效前的相关费用；

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、费用调整

管理人和托管人协商一致后，可根据本集合计划的发展情况调整管理费率、托管费率等相关费率。

调整管理费率、托管费率，应召开集合计划份额持有人大会审议。

管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

## 五、集合计划税收

本集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。集合计划财产投资的相关税收，由份额持有人承担，管理人或者其他扣

缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 第十四部分 集合计划的收益与分配

### 一、集合计划利润的构成

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

### 二、集合计划可供分配利润

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

### 三、集合计划收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为4次，若《资产管理合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式为现金分红；

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

4、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份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，管理人、登记机构和托管人协商一致后，可对集合计划收益分配原则进行调整，不需召开集合计划份额持有人大会。

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

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

### 六、集合计划收益分配中发生的费用

集合计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，集合计划登记机构可将份额持有人的现金红利自动转为集合计划份额。

## 第十五部分 集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

- 1、管理人为本集合计划的会计责任方；
- 2、集合计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日；集合计划首次募集的会计年度按如下原则：如果《资产管理合同》生效少于2个月，可以并入下一个会计年度；
- 3、集合计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4、会计制度执行国家有关会计制度；
- 5、本集合计划独立建账、独立核算；
- 6、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、托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本集合计划的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得管理人同意。
- 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日内在指定媒介公告。

## 第十六部分 集合计划的信息披露

一、本集合计划的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《资产管理合同》及其他有关规定。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，无需经集合计划份额持有人大会审议。

### 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份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

本集合计划信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的集合计划信息通过中国证监会指定媒介披露，并保证投资者能够按照《资产管理合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

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

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

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的集合计划信息

公开披露的集合计划信息包括：



(一) 集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要、《资产管理合同》、集合计划托管协议

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

2、集合计划招募说明书应当最大限度地披露影响集合计划投资者决策的全部事项，说明集合计划申购和赎回安排、集合计划投资、集合计划产品特性、风险揭示、信息披露及份额持有人服务等内容。

3、集合计划产品资料概要系集合计划招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的集合计划概要信息。

4、《资产管理合同》生效后，集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要，并登载在指定网站上，并将集合计划产品资料概要登载在销售机构网站或营业网点。

集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。

《资产管理合同》终止的，除《资产管理合同》另有约定外，管理人可以不再更新集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要。

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

管理人、托管人应当将《资产管理合同》、集合计划托管协议登载在网站上。

(二) 集合计划净值信息

《资产管理合同》生效后，在开始办理集合计划份额申购或者赎回前，管理人应当至少每周在指定网站公告一次集合计划各类别份额净值和份额累计净值。

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，通过指定网站、集合计划销售机构网站或者营业网点披露开放日的集合计划各类别份额净值和份额累计净值。

管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日集合计划各类别份额净值和份额累计净值。

### （三）集合计划份额申购、赎回价格

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

（四）集合计划定期报告，包括集合计划年度报告、集合计划中期报告和集合计划季度报告（含资产组合季度报告）

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

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

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

《资产管理合同》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。

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

### （五）临时报告

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

前款所称重大事件，是指可能对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；

- 2、《资产管理合同》终止、集合计划清算；
- 3、转换集合计划运作方式、集合计划合并；
- 4、更换管理人、托管人、集合计划份额登记机构、集合计划改聘会计师事务所；
- 5、管理人委托服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；
- 6、管理人、托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更管理人的实际控制人；
- 8、管理人高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门公募证券投资基金（含公开募集性质的集合计划）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；
- 10、管理人、托管人专门公募证券投资基金（含公开募集性质的集合计划）托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及集合计划财产、集合计划管理业务、集合计划托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、管理人或其高级管理人员、集合计划投资经理因集合计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，托管人或其专门公募证券投资基金托管部门负责人因公募证券投资基金（含公开募集性质的集合计划）托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、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，中国证监会另有规定的情形除外；
- 14、集合计划收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 16、某一类别集合计划份额净值计价错误达集合计划该类别份额净值百分之零点五；
- 17、本集合计划开始办理申购、赎回；
- 18、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；

- 19、本集合计划连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 20、本集合计划暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 21、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；
- 22、管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 23、本集合计划推出新业务或服务；
- 24、集合计划变更份额类别设置。
- 25、集合计划信息披露义务人认为可能对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或《资产管理合同》规定的其他事项。

#### （六）澄清公告

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

#### （七）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。

#### （八）清算报告

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

#### （九）投资资产支持证券的相关公告

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

#### （十）投资股指期货信息披露

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）

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

（十一）投资流通受限证券的相关公告

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

（十二）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信息披露内容与格式准则等法规的规定。

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

管理人、托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

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

管理人、托管人除按法律法规要求披露信息外，按照《信息披露办法》自主披露信息如产生信息披露费用，该费用不得从集合计划财产中列支。

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

## 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，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，本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、本集合计划投资所涉及的证券、期货市场或外汇市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、出现资产管理合同约定的暂停估值的情形；
- 4、法律法规、资产管理合同或中国证监会规定的其他情况。

## 第十七部分 风险揭示

集合资产管理计划是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。集合计划不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买集合计划，既可能按其持有份额分享集合计划投资所产生的收益，也可能承担集合计划投资所带来的损失。

集合计划分为股票型集合资产管理计划、混合型集合资产管理计划、债券型集合资产管理计划等不同类型，投资人投资不同类型的集合资产管理计划将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。本集合计划是混合型集合资产管理计划，其预期收益和风险水平高于债券型集合资产管理计划和货币型集合资产管理计划，低于股票型集合资产管理计划。

投资人应当充分了解集合计划定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避集合计划投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

投资人应当认真阅读本集合计划《资产管理合同》、《招募说明书》等集合计划法律文件，了解本集合计划的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本集合计划是否和投资人的风险承受能力相适应。

投资人应当通过管理人或其他销售机构购买和赎回本集合计划，销售机构名单详见本集合计划的招募说明书以及相关公告。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益；管理人管理的其他集合计划的业绩不构成对本集合计划业绩表现的保证。

除管理人直接办理本集合计划的销售外，本集合计划还通过其他销售机构代理销售，管理人与销售机构都不能保证其收益或本金安全。

管理人提醒投资人在作出投资决策后，须了解并自行承担以下风险：

### 一、市场风险

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

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

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，从而引起债券价格波动，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。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。利率风险是债券投资所面临的主要风险。

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

5、信用风险。债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

6、购买力风险。本集合计划投资的收益可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使本集合计划的实际收益下降。

7、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资时的收益率的影响。具体为当利率下降时，本集合计划从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较以前低的收益率。

## 二、流动性风险

本集合计划的流动性风险主要体现为集合计划申购、赎回等因素对集合计划造成的流动性影响。在集合计划交易过程中，可能会发生巨额赎回的情形。巨额赎回可能会产生集合计划仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响集合计划份额净值。

### （1）集合计划申购、赎回安排

投资人具体请参见资产管理合同“第六部分 集合计划份额的申购与赎回”和本招募说明书“第八部分 集合计划份额的申购与赎回”，详细了解本集合计划的申购以及赎回安排。



### (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，同时本集合计划基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征。此外，本集合计划每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货保证金后，应当保持不低于集合计划资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。综上所述，本集合计划拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。

### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

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

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

## 三、管理风险

1、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和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响集合计划收益水平。

2、管理人和托管人的管理水平、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。

#### 四、操作和技术风险

集合计划的相关当事人在各业务环节的操作过程中,可能因内部控制不到位或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险,如越权违规交易、内幕交易、交易错误和欺诈等。

此外,在集合计划的后台运作中,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甚至导致份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

#### 五、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《资产管理合同》有关规定的风险。

#### 六、本集合计划特有风险

1、本集合计划为混合型集合资产管理计划,存在大类资产配置风险,有可能受到经济周期、市场环境或管理人对市场所处的经济周期和产业周期的判断不足等因素的影响,导致集合计划的大类资产配置比例偏离最优化水平,给集合计划投资组合的绩效带来风险。本集合计划在股票选择上具有一定的主观性,将在个股投资决策中给本集合计划带来一定的不确定性,因而存在个股选择风险。

##### 2、可转换债券投资风险

###### (1) 可转换债券收益不确定的风险

可转换债券的收益除受到利率风险、流动性风险的影响以外,还受转股价格、标的股票价格、投资者的预期等诸多因素的影响。

###### (2) 转股风险

转股期内,标的股票价格低于转股价格而影响投资收益的风险;赎回条款可能导致债券提前兑付或转股期缩短而影响投资收益的风险;转股价格向下修正条款触发时,修正转股价格未被同意的风险;因标的股票重大事项导致暂停转股时间超过债券存续期的风险。

###### (3) 偿付风险

若在可转换债券存续期内,发行人自身的盈利及获现能力无法按期支付本息,使投资者面临一定的偿付风险。

###### (4) 资信风险

如果由于发行人自身的相关风险或不可控制的因素，发行人的财务状况发生不利变化，导致不能按约定偿付贷款本息或在业务往来中发生严重违约行为，将可能使发行人资信状况恶化，从而影响本次可转换债券还本付息。

(5) 债券持有人回售债券导致发行人集中兑付的风险。

(6) 流动性风险

公司债券由监管部门批准的证券登记机构负责托管、登记及结算工作，发行结束后，转换债交易市场的交易活跃程度受到宏观经济环境、投资者分布、投资者交易意愿等因素的影响，发行人无法保证转换债券的持有人能够随时并足额交易其所持有的债券，由此可能产生由于无法及时完成交易带来的流动性风险。

(7) 周期性风险

可转债投资具有周期性、风险特性等固有特点，因而存在持仓比例不稳定的风险。管理人根据市场情况在合同约定范围内自主决策各类资产投资比例，因而存在单一类型资产配置比例前后不均甚至显著偏低的可能性。

### 3、可交换债券投资风险

(1) 可交换债券的收益波动风险

可交换债券与标的股票挂钩，其波动因素除利率风险、流动性风险外，还受换股价格、标的股票价格、赎回条款、向下修正条款、投资者的预期等诸多因素的影响。具有波动风险的收益包括：①持有期间获取利息，持有至到期被发行人以到期赎回价格赎回而获取的赎回收益，或在存续期内被发行人按照债券面值加应计利息赎回而获取的赎回收益；②当标的股票二级市场价格高于换股价时，通过交换股票获取二级市场价格与换股价之间差价；③在报价系统公司以高于票面价值转让的收益等。

(2) 股票质押担保风险

可交换债券可能采用股票质押担保方式，预备用于交换的股票及其孳息（包括送股、转股和现金红利）一并予以质押给受托管理人，用于对债券持有人交换股份和本期私募债券本息偿付提供担保；若标的股票价格大幅下跌，且发行人不对换股价格进行修正时，将影响到质押股票对债券本息偿付的最终保障效果。

(3) 换股风险

主要包括：①换股期内标的股票价格可能低于换股价格而影响投资收益的风

险；②债券的赎回条款可能导致债券提前兑付或换股期缩短而影响投资收益的风险；③换股价格向下修正条款触发时，董事会未同意修正换股价格的风险；④预备可交换的股票被限售、冻结，或因标的股票重大事项导致暂停换股时间超过债券存续期等导致投资者无法换股的风险。

#### （4）发行人资信风险

若由于发行人自身的相关风险或不可控制的因素，发行人的财务状况发生不利变化，导致不能按约定偿付贷款本息或在业务往来中发生严重违约行为，将可能使发行人资信状况恶化，发行人上述受限资产将可能用于对相关债权人的偿付，发行人的资产将会大幅减少，并面临集中偿付的巨大压力，届时发行人的偿债能力将严重下降，从而影响债券还本付息。

#### 4、股指期货投资风险

（1）基差风险。在使用股指期货对冲市场风险的过程中，集合计划财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而遭受基差风险。

（2）系统性风险。组合现货的 $\beta$ 可能不足或者过高，组合风险敞口过大，股指期货空头头寸不能完全对冲现货的风险，组合存在系统性暴露的风险。

（3）杠杆风险。股指期货是一种高风险的投资工具，实行保证金交易制度具有杠杆性，高杠杆效应放大了价格的波动风险；当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使委托资产遭受较大损失。

（4）股指期货展期时的流动性风险。本集合计划持有的股指期货头寸需要进行展期操作，平仓持有的股指期货合约，换成其它月份股指期货合约，当股指期货市场流动性不佳、交易量不足时，将会导致展期操作执行难度提高、交易成本增加，从而可能对集合计划资产造成不利的影响。

（5）期货盯市结算制度带来的现金管理风险。股指期货采取保证金交易制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，资金管理要求高。当市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，如果未能在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给集合计划资产带来超出预期的损失。

（6）到期日风险。股指期货合约到期时，本集合计划的账户如仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将账户持有的合约进行现金交割，因此无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

(7) 对手方风险。管理人运用集合计划资产投资于股指期货时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致集合计划资产遭受损失。

(8) 连带风险。为本集合计划资产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，集合计划资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

#### 5、国债期货投资风险

本集合计划投资范围包括国债期货，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、次级债券的投资风险

##### (1) 次级性风险

次级债券本金和利息的清偿顺序在发行人的普通债之后、先于发行人的股权资本，存在次级性风险。

##### (2) 利率风险

受国民经济总体运行状况、国家宏观货币政策财等因素的影响，市场利率水平和结构存在波动可能性从而对次级债券的投资收益产生影响。

##### (3) 流动性风险

证券公司次级债采用非公开发行的形式，向不超过 200 名特定对象发行，发行结束后在交易所固定收益平台转让，在债券到期之前只能在有限的投资者之间进行转让。在上述要求下，证券公司次级债具有一定的流动性风险，投资证券公司次级债可能存在无法随时并足额转让的风险。

#### （4）偿付风险

在次级债券持有期间，如发行人公司所处的宏观经济环境、行业政策和资本市场状况等外部因素发生变化，加上公司本身生产经营中存在的确定性，可能导致公司不能从预期的还款来源中获得足够的资金，从而影响公司按期偿付本期债券本息的能力，使投资者面临一定的偿付风险。

#### 7、合同到期的风险

本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期至 2024 年 12 月 31 日，同时本集合计划对集合计划份额持有人持有的 A 类份额均设置一年的最短持有期限。临近资产管理合同到期日申购的本集合计划 A 类份额，将面临持有时间不满一年的期限内资产管理合同到期的风险。

### 七、资产支持证券投资风险

本集合计划可能投资于资产支持证券。本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，可能造成集合计划财产损失。此外，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，从而对集合计划收益造成影响。

### 八、科创板股票投资风险

集合资产管理计划财产投资于科创板股票，会面临科创板因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

投资科创板股票存在的风险包括但不限于：

#### （1）市场风险

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

科创板个股上市前五日无涨跌幅限制，第六日开始涨跌幅限制在正负 20% 以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

#### （2）流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在 50 万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，资产管理计划组合存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

(3) 信用风险

科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，科创板个股存在退市风险。

(4) 集中度风险

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

(5) 系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

(6) 政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

## 九、北京证券交易所股票投资风险

北京证券交易所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异，集合计划投资北京证券交易所股票的风险包括但不限于：

(1) 中小企业经营风险

由于北京证券交易所上市的企业大部分为创新型中小企业，该类企业在持续经营能力、核心技术、管理团队稳定性、财务数据稳定性及企业应对外部政策、市场等方面具有较大的不确定性，由此可能导致投资北京证券交易所上市股票对集合计划净值产生不利影响。

(2) 股价大幅波动风险

北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置

了更宽的涨跌幅限制（上市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。

### （3）企业退市风险

根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，集合计划可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对集合计划净值造成不利影响。

### （4）流动性风险

北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致集合计划面临无法及时变现及其他相关流动性风险。

### （5）系统性风险

北京证券交易所上市公司主要属于创新成长型企业，其商业模式、盈利、风险和业绩波动等特征较为相似，因此集合计划难以通过分散投资来降低风险，若股票价格同向波动，将引起集合计划净值较大波动。

### （6）监管规则变化的风险

北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对集合计划投资运作产生影响，或导致集合计划投资运作相应调整变化。

### （7）集中度风险

北京证券交易所为新设全国性证券交易所，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

估值风险：传统估值方法可能不适用北交所上市企业，投资者需关注难估值的风险。北交所上市企业多聚焦行业细分领域，业绩受外部环境影响大，可比公司较少，传统估值方法可能不适用，上市后可能存在股价波动的风险。

### （8）表决权差异化风险

北交所允许上市公司存在表决权差异安排。根据此项安排，上市公司可能存



在控制权相对集中，以及因每一特别表决权股份拥有的表决权数量大于每一普通股份拥有的表决权数量等情形，而使普通投资者的表决权权利及对公司日常经营等事务的影响力受到限制。出现北交所上市规则及上市公司章程规定的情形时，特别表决权股份将按 1:1 的比例转换为普通股份，股份转换自相关情形发生时生效，并可能与相关股份转换登记时点存在差异。

#### （9）上市交易差异化风险

北交所股票上市首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%，投资者应当关注可能产生的股价波动风险。

北交所股票交易具有盘中临时停牌情形，设有异常波动股票核查制度，投资者应当关注与此相关的风险。

### 十、其他风险

1、在符合本集合计划投资理念的新型投资工具出现和发展后，如果投资于这些工具，集合计划可能会面临一些特殊的风险；

2、因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

3、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；

4、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

5、对主要业务人员如投资经理的依赖可能产生的风险；

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

7、其他意外导致的风险。

## **第十八部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算**

### **一、《资产管理合同》的变更**

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

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

### **二、《资产管理合同》的终止事由**

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

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

### **三、集合计划财产的清算**

1、集合计划财产清算小组：自出现《资产管理合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，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) 《资产管理合同》终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管集合计划；

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

- (3) 对集合计划财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

#### **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，按份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

#### **六、集合计划财产清算的公告**

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

#### **七、集合计划财产清算账册及文件的保存**

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 15 年以上。

## 第十九部分 资产管理合同的内容摘要

### 一、份额持有人、管理人和托管人的权利、义务

#### （一）份额持有人的权利与义务

集合计划投资者持有本集合计划份额的行为即视为对《资产管理合同》的承认和接受，集合计划投资者自依据《资产管理合同》取得的集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《资产管理合同》的当事人，直至其不再持有本集合计划的集合计划份额。份额持有人作为《资产管理合同》当事人并不以在《资产管理合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份集合计划份额具有同等的合法权益。

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

- （1）分享集合计划财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余集合计划财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的集合计划份额；
- （4）按照规定要求召开集合计划份额持有人大会或者召集集合计划份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席集合计划份额持有人大会，对集合计划份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的集合计划信息资料；
- （7）监督管理人的投资运作；
- （8）对管理人、托管人、集合计划服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

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

- （1）认真阅读并遵守《资产管理合同》；
- （2）了解所投资集合计划产品，了解自身风险承受能力，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；

- (4) 交纳集合计划申购款项及法律法规和《资产管理合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的集合计划份额范围内，承担集合计划亏损或者《资产管理合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损集合计划及其他《资产管理合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决定；
- (8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## (二) 管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自《资产管理合同》生效之日起，根据法律法规和《资产管理合同》独立运用并管理集合计划财产；
- (3) 依照《资产管理合同》收取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《资产管理合同》及有关法律的规定监督托管人，如认为托管人违反了《资产管理合同》及国家有关法律的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护集合计划投资者的利益；
- (7) 在托管人更换时，提名新的托管人；
- (8) 选择、更换销售机构，对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《资产管理合同》规定的费用；
- (10) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；
- (11) 在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (12) 依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使股东权利，为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利；
- (13) 以管理人的名义，代表份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他

法律行为；

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

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

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

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

(3) 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；

(4) 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；

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

(6) 依法接受托管人的监督；

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

(8) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(9) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

(13) 按规定受理申购与赎回申请, 及时、足额支付赎回款项;

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

(15) 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;

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

(17) 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;

(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并通知托管人;

(19) 因违反《资产管理合同》导致集合计划财产的损失或损害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;

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

(21) 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;

(22) 以管理人名义, 代表份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;

(23) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议;

(24) 建立并保存份额持有人名册;

(25) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

### (三) 托管人的权利与义务

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

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

(2) 依《资产管理合同》约定获得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《资产管理合同》及国家法律法规行为，对集合计划财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护集合计划投资者的利益；

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

(5) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

(6) 在管理人更换时，提名新的管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

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

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

(5) 保管由管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；

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



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

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 建立并保存份额持有人名册；

(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份额持有人支付集合计划收益和赎回款项；

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

(16) 按照法律法规和《资产管理合同》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监管机构，并通知管理人；

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

(20) 按规定监督管理人按法律法规和《资产管理合同》规定履行自己的义务，管理人因违反《资产管理合同》造成集合计划财产损失时，应为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定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

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

### (一) 召开事由

1、除法律法规和中国证监会另有规定或本资产管理合同另有约定外，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：

- (1) 终止《资产管理合同》；
- (2) 更换管理人；
- (3) 更换托管人；
- (4) 转换集合计划运作方式；
- (5) 调整管理人、托管人的报酬标准；
- (6) 变更集合计划类别（根据法律法规要求变更类别的除外）；
- (7) 本集合计划与其他集合计划的合并；
- (8) 变更集合计划投资目标、范围或策略；
- (9) 变更集合计划份额持有人大会程序；
- (10) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；

(11) 资产管理合同生效后，连续 60 个工作日出现份额持有人数量不满 200 人或者集合计划资产净值低于人民币 5000 万元情形的，管理人提出持续运作、转换运作方式、与其他公开募集性质的集合资产管理计划合并、终止资产管理合同等解决方案；

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

(13) 对集合计划当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在法律法规规定和《资产管理合同》约定的范围内且对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后修改，不需召开集合计划份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加的集合计划费用的收取；
- (2) 在法律法规和《资产管理合同》规定的范围内调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率；
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《资产管理合同》进行修改；
- (4) 对《资产管理合同》的修改对份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《资产管理合同》当事人权利义务关系发生变化；
- (5) 管理人、登记机构、代销机构调整有关集合计划申购、赎回、转换、收益分配、非交易过户、转托管等业务的规则；
- (6) 本集合计划推出新业务或服务；
- (7) 增加、取消或调整份额类别设置；
- (8) 按照法律法规和《资产管理合同》规定不需召开集合计划份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

2、管理人未按规定召集或不能召开时，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。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，在指定媒介公告。集合计划份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席集合计划份额持有人大会的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）、授权方式（包括但不限于纸质授权、电话授权、短信授权及网络授权方式等）、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及投票方式（包括但不限于以纸质表决票投票、网络投票及短信投票等）、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）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。由份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派代表出席，现场开会时管理人和托管人的授权代表应当列席集合计划份额持有人大会，管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行集合计划份额持有人大会议程：

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按资产管理合同约定通知托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）到指定地点对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表决意见；托管人或管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响

表决效力；

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

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

3、在不与法律法规冲突的前提下，经会议通知载明，本集合计划亦可采用网络、电话、短信等其他非书面方式由份额持有人向其授权代表进行授权。

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

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

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

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

### (2) 通讯开会

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

### (六) 表决

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交

符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表决符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的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份额持有人中选举三名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表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

### （八）生效与公告

集合计划份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证



监会备案。

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

管理人、托管人和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份额持有人、管理人、托管人均有约束力。

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

(十) 法律法规或监管部门对集合计划份额持有人大会另有规定的，从其规定。

### 三、集合计划收益分配原则、执行方式

#### (一) 集合计划利润的构成

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

#### (二) 集合计划可供分配利润

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

#### (三) 集合计划收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为 4 次，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式为现金分红；

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

- 4、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份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，管理人、登记机构和托管人协商一致后，可对集合计划收益分配原则进行调整，不需召开集合计划份额持有人大会。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

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

#### （六）集合计划收益分配中发生的费用

集合计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，集合计划登记机构可将份额持有人的现金红利自动转为集合计划份额。

### 四、与集合计划财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

#### （一）集合计划费用的种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、除法律法规、中国证监会另有规定外，《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 4、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的注册登记机构相关费用（包括登记结算费、服务月费、年度电子合同服务费）、审计费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、集合计划份额持有人大会费用；
- 6、集合计划的证券账户等相关账户的开户费用；
- 7、集合计划的证券交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过

户费、手续费、券商佣金、相关账户费用及其他类似性质的费用等)及投资其他基金的费用;

8、集合计划的银行汇划费用、银行账户维护费用;

9、按照国家有关规定和《资产管理合同》约定,可以在集合计划财产中列支的其他费用。

(二) 集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理人的管理费

(1) 固定管理费

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

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由管理人向托管人发送管理费划款指令,托管人复核后于次月前 2 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(2) 业绩报酬

(2.1) 业绩报酬计提原则

符合业绩报酬计提条件时,在集合计划投资人退出日或本集合计划终止日计提业绩报酬。本集合计划分红日,管理人不提取业绩报酬。

(2.2) 业绩报酬计提方法

业绩报酬计提日为集合计划投资人退出日或本集合计划终止日。以业绩报酬计提期间的年化收益率 R, 作为计提业绩报酬的基准。

$$R = \frac{A - B}{C} \times \frac{365}{N} \times 100\%$$

A=为本次业绩报酬计提日累计单位净值;

B=为上一个业绩报酬计提日(若无则为份额参与本集合计划日)的累计单位净值;

C=为上一个业绩报酬计提日(若无则为份额参与本集合计划日)的单位净值;

$N$  = 为本次计提业绩报酬区间天数，即前一次业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）至本次业绩报酬计提日的间隔天数。

业绩报酬计提日为集合计划投资人退出日或本集合计划终止日。从前一次业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）至本次业绩报酬计提日，若计划单位份额年化收益率  $R$  小于或等于 6% 时，管理人不提取业绩报酬；若计划单位份额年化收益率  $R$  大于 6%，管理人对超过 6% 以上的部分提取 20% 作为业绩报酬。

年化收益率（ $R$ ）	计提比例	业绩报酬（ $H$ ）计算方法
$R \leq 6\%$	0	$H = 0$
$R > 6\%$	20%	$H = (R - 6\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{N}{365}$

（ $F$  为参与计提业绩报酬的份额数）

如投资人退出的份额为多笔参与，则采用“先进先出”法分别对每笔参与的份额计算业绩报酬。

### （3）业绩报酬的支付

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，由管理人向托管人发送划付指令，托管人于收到指令后 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。

## 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 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

$H$  为每日应计提的集合计划托管费

$E$  为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送托管费划款指令，托管人复核后于次月前 2 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、集合计划费用的种类”中第 3—8 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

### （三）不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

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

2、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；

3、《资产管理合同》生效前的相关费用；

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）费用调整

管理人和托管人协商一致后，可根据本集合计划的发展情况调整管理费率、托管费率等相关费率。

调整管理费率、托管费率，应召开集合计划份额持有人大会审议。

管理人必须于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### （五）集合计划税收

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

## 五、集合计划财产的投资方向和投资限制

### （一）投资目标

本集合计划在严格控制风险的前提下，通过精选有较高成长性和各领域竞争力突出的龙头企业，结合估值水平进行积极的组合管理，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。

### （二）投资范围

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易的可转债）、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存

款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他证券品种。

如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：

本集合计划股票投资占集合计划总资产的比例为 50%-95%；本集合计划每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货保证金后，应当保持不低于集合计划资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，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）投资禁止行为与限制

#### 1、组合限制

本集合计划的投资组合应遵循以下限制：

（1）本集合计划股票投资占集合计划总资产的比例为 50%-95%；

（2）本集合计划每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货保证金后，应当保持不低于集合计划资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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

（4）本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划（系指投资人数不受 200 人限制的资产管理计划，下同）持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

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

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

（7）本集合计划持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得

超过该资产支持证券规模的 10%；

(8) 本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合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。本集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

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

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

(13) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合计划资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等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；

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

(15) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(16) 本集合计划投资股指期货、国债期货时，将遵循以下投资比例限制：

1) 本集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 10%；本集合计划在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 15%；

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

3) 本集合计划在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%; 本集合计划在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过集合计划持有的债券总市值的 30%;

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

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

本集合计划在开始进行股指期货或国债期货投资之前, 应与托管人就股指期货或国债期货的开户、清算、估值、交收、投资监督等事宜另行具体协商。

除上述(2)、(9)、(13)、(14)情形之外, 因证券市场波动、上市公司合并、集合计划规模变动等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, 但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的, 以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制, 如适用于本集合计划, 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。

## 2、禁止行为

为维护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。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，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，无需经集合计划份额持有人大会审议。

## 3、关联交易原则

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或变更上述限制，如适用于本集合计划，则本集合计划不再受相关限制或以变更后的规则为准，不需经集合计划份额持有人大会审议。

## 六、集合计划资产净值的计算方法和公告方式

### (一) 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负债后的价值。

### (二) 集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额累计净值

《资产管理合同》生效后，在开始办理集合计划份额申购或者赎回前，管理人应当至少每周在指定网站公告一次集合计划各类别份额净值和份额累计净值。

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,通过指定网站、集合计划销售机构网站或者营业网点披露开放日的集合计划各类别份额净值和份额累计净值。

管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站披露半年度和年度最后一日集合计划各类别份额净值和份额累计净值。

## 七、资产管理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) 《资产管理合同》的变更

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

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

### (二) 《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的,经履行相关程序后,《资产管理合同》应当终止:

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

### (三) 集合计划财产的清算

1、集合计划财产清算小组:自出现《资产管理合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,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) 《资产管理合同》终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管集合计划；

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

#### (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，按份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

#### (六) 集合计划财产清算的公告

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

#### (七) 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 15 年以上。

## 八、争议解决方式

各方当事人同意，因《资产管理合同》而产生的或与《资产管理合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照上海国际经济贸易仲裁委员会会届时有效的仲裁规则按普通程序进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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

《资产管理合同》受中国法律管辖。

#### **九、《资产管理合同》存放地和投资者取得资产管理合同的方式**

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

## 第二十部分 托管协议内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）管理人

名称：兴证证券资产管理有限公司

住所：福建省福州市平潭综合实验区管委会现场指挥部办公大楼一楼

法定代表人：孙国雄

设立日期：2014年6月9日

批准设立机关及批准设立文号：证监许可[2014]145号

组织形式：有限公司

注册资本：8亿元

存续期限：2014年6月9日至长期

联系人：高丹丹

联系电话：021-38565866

#### （二）托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：陈四清

成立时间：1984年1月1日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币35,640,625.7089万元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号

联系人：郭明

联系电话：010-66105799

### 二、托管人对管理人的业务监督与核查

(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《资产管理合同》的约定，对下述集合计划投资范围、投资对象进行监督。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易的可转债）、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他证券品种。

如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种，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《资产管理合同》的约定对下述集合计划投资比例进行监督：

(1) 本集合计划的投资组合比例为：

本集合计划股票投资占集合计划总资产的比例为50%-95%；本集合计划每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货保证金后，应当保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，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) 根据法律法规的规定及《资产管理合同》的约定，本集合计划投资组合遵循以下投资限制：

1) 本集合计划股票投资占集合计划总资产的比例为50%-95%；

2) 本集合计划每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货保证金后，应当保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

3) 本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值

的10%；

4) 本集合计划管理人管理且由本托管人托管的全部公开募集性质的集合资产管理计划（系指投资人数不受200人限制的资产管理计划，下同）持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

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

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

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

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

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。本集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

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

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

12) 本集合计划管理人管理且由本托管人托管的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的15%；本集合计划管理人管理且由本托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的30%；

13) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合计划资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等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；

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

15) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的140%；

16) 本集合计划投资股指期货、国债期货时，将遵循以下投资比例限制：

① 本集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的10%；本集合计划在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的15%；

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

③ 本集合计划在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的20%；本集合计划在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过集合计划持有的债券总市值的30%；

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

⑤ 本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于股票投资比例的有关约定；本集合计划所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于债券投资比例的有关约定；

17) 法律法规及中国证监会规定的其他投资限制。

本集合计划在开始进行股指期货或国债期货投资之前，应与托管人就股指期货或国债期货的开户、清算、估值、交收、投资监督等事宜另行具体协商。

除上述（2）、（9）、（13）、（14）情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、集合计划规模变动等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，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，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。

对于因法律法规变化导致本集合计划投资范围及投资限制等事项调整的，管理人应提前通知托管人，经托管人书面同意后方可纳入投资监督范围。管理人知晓托管人履行投资监督职责受外部数据来源或系统开发等因素影响，应为托管人系统调整预留所需的合理必要时间。

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

本集合计划禁止从事下列行为：

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

(6) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动，托管人实际无法进行监控的除外。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，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，无需经份额持有人大会审议。

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。

管理人和托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，加盖公章（或授权业务章）并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后管理人应及时发送托管人，如果托管人在运作中严格遵循了监督流程，管理人仍违规进行关联交易，并造成集合计划资产损失的，由管理人承担责任。若托管人发现管理人与关联交易名单中列示的关联方进行关联交易时，托管人应及时提醒并协助管理人履行披露义务。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本集合计划，则本集合计划不再受相关限制或以变更后的规则为准，不需经集合计划份额持有人大会审议。

#### 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。托管人发现管理人与银行间市场的丙类会员进行债券交易的，可以通过邮件、电话等双方认可的方式提醒管理人，管理人应及时向托管人提供可行性说明。管理人应确保可行性说明内容真实、准确、完整。托管人不对管理人提供的可行性说明进行实质审查。管理人同意，经提醒后管理人仍执行交易并造成集合计划资产损失的，托管人不承担责任。

管理人在银行间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。

#### 5、关于银行存款投资

本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。因管理人违反上述原则给本计划造成的损失，托管人不承担任何责任，相关损失由管理人先行承担。管理人履行先行赔付责任后，有权要求相关责任人进行赔偿。托管人的职责仅限于督促管理人履行先行赔

付责任。

#### 6、托管人对本计划投资流通受限证券的监督

(1) 此处的流通受限证券与本协议提及的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券,不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本计划投资流通受限证券，还应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

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

本计划投资流通受限证券前，管理人应向托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，如拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，集合计划拟认购的数量、价格、总成本、总成本占集合计划资产净值的比例、已持有流通受限证券市值占资产净值的比例、资金划付时间等。管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至托管人，保证托管人有足够的时间进行审核。

(3) 托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核管理人提供的有关书面信息。托管人认为上述资料可能导致本计划出现风险的，有权要求管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看管理人风险管理部门就本计划投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成本计划财产损失的，托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。如管理人和托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。如果托管人没有切实履行监督职责，导致集合计划出现风险，托管人应承担连带责任。

(二) 托管人应根据有关法律法规的规定及《资产管理合同》的约定，对集

合计划资产净值计算、集合计划各类别份额净值计算、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运作及其他运作违反《基金法》、《资产管理合同》、托管协议有关规定时,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《资产管理合同》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集合计划监督报告的,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集合计划各类别份额净值、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、无故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》、《资产管理合同》、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的，管理人应报告中国证监会。管理人有权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银行业监督管理机构，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或法律法规、《资产管理合同》及本协议另有规定，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、托管人不得利用本协议为自己及任何第三人谋取利益，托管人从事上述违法违规所得利益归入集合计划财产。

6、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，托管人应当给予必要的协助与配合，但对此不承担责任。

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

#### （二）集合计划的银行账户的开立和管理

托管人接受管理人委托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》以及银行业监督管理机构的其他规定。

#### （三）集合计划证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

托管人接受管理人委托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、《资产管理合同》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和资金结算专户，并代表集合计划进行银行间债券市场债券和资金的清算。

2、管理人和托管人应一起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，正本由托管人保管，管理人保存副本。

#### （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《资产管理合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，由管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《资产管理合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

（六）集合计划财产投资的有关实物证券、银行存款证实书等有价凭证的保管

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。托管人对托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

#### （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5个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达托管人处。合同原件应存放于管理人和托管人各自文件保管部门15年以上。对于无法取得两份以上正本的，管理人应向托管人提供加盖公章的合同复印件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

#### （八）特别约定

本协议生效后，针对以兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合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、开放式基金账户、存款账户等，管理人与托管人应互相配合，共同完成账户名称及开户资料的变更。

## 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。集合计划各类别份额净值是按照每个工作日闭市后，集合计划各类别资产净值除以当日集合计划该类别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。国家另有规定的，从其规定。

管理人应每工作日对集合计划资产估值。估值原则应符合《资产管理合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。集合计划资产净值和集合计划各类别份额净值由管理人负责计算，托管人复核。管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的集合计划各类别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予以公布。

根据《基金法》，管理人计算并公告集合计划资产净值，托管人复核、审查管理人计算的集合计划资产净值。因此，本集合计划的会计责任方是管理人，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照管理人对估值结果对外予以公布。法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

### （二）集合计划资产估值方法

#### 1、估值对象

集合计划所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

#### 2、估值方法

##### 1) 证券交易所上市的有价证券的估值

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



影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

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

(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) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

#### 5) 存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### 6) 金融衍生品的估值

(1) 评估金融衍生品价值时，应当采用市场公认或者合理的估值方法确定公允价值；

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

8) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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。

9) 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。

10) 其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

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

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

### (三) 估值差错处理

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。

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。

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。

当管理人计算的集合计划资产净值、集合计划份额净值已由托管人复核确认后公告的，由此造成的份额持有人或集合计划的损失，应根据法律法规的规定对份额持有人或集合计划支付赔偿金，就实际向份额持有人或集合计划支付的赔偿金额，由管理人与托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致集合计划资产净值、集合计划份额净值计算错误造成投资者或集合计划的损失，以及由此造成以后交易日集合计划资产净值、集合计划份额净值计算顺延错误而引起的份额持有人或集合计划的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

管理人或托管人按估值方法的第 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。

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误或第三方估值机构提供的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，管理人

和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，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消除或减轻由此造成的影响。

当管理人计算的集合计划资产净值与托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失以及因该交易日集合计划资产净值计算顺延错误而引起的损失由管理人承担赔偿责任，托管人不负赔偿责任。

#### （四）集合计划账册的建立

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

管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成集合计划年度报告，将年度报告登载于指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成集合计划中期报告，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成集合计划季度报告，将季度报告登载在指定网站上，并将季度报告提示性公告登载在指定报刊上。《资产管理合同》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。

《资产管理合同》生效后，集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要的

信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要，并登载在指定网站上，并将集合计划产品资料概要登载在销售机构网站或营业网点。集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。

管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给托管人复核，托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知管理人。管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给托管人复核，托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知管理人。管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供托管人复核，托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知管理人。管理人和托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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。核对无误后，托管人在管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。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出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

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。

## **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注册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的保存期限自集合计划账户销户之日起不得少于 20 年。

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：《资产

管理合同》生效日、《资产管理合同》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；《资产管理合同》生效日、《资产管理合同》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 15 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

各方当事人同意，因《资产管理合同》而产生的或与《资产管理合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交上海国际经济贸易仲裁委员会，按照上海国际经济贸易仲裁委员会会届时有效的仲裁规则按普通程序进行仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

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

《资产管理合同》受中国法律管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与集合财产的清算

### （一）托管协议的变更与终止

#### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与《资产管理合同》的约定有任何冲突，但关于托管人的托管职责以本协议的约定为准。托管协议的变更报中国证监会备案。

#### 2、托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

##### （1）《资产管理合同》终止；

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

2、在集合计划财产清算小组接管集合计划财产之前，管理人和托管人应严格按照《资产管理合同》和本托管协议的约定继续履行保护集合计划财产安全的职责。

3、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、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。

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

### 5、集合计划财产清算程序：

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

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

### 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，按份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

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

##### （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 15 年以上。



## 第二十一部分 对份额持有人的服务

管理人承诺为份额持有人提供一系列的服务,并将根据份额持有人的需要和市场的变化增加、修改这些服务项目。主要的服务项目如下:

### 一、资料寄送

#### 1、份额交易对账单

本管理人将按照份额持有人的定制情况,提供电子邮件或短信方式对账单。客户可通过客户服务热线或者网站进行对账单服务定制或更改。

电子邮件对账单经互联网传送,可能因邮件服务器解析等问题无法正常显示原发送内容,也无法完全保证其安全性与及时性。因此兴证证券资产管理有限公司不对电子邮件或短信息电子化账单的送达做出承诺和保证,也不对因互联网或通讯等原因造成的信息不完整、泄露等而导致的直接或间接损害承担任何赔偿责任。

#### 2、其他相关的信息资料

其他相关的信息资料指不定期寄送的资讯材料。

### 二、电子化服务

#### 1、微信服务

份额持有人可以通过关注管理人微信公众号(可搜索“兴证资产管理微理财”),查阅集合计划份额净值、集合计划动态及活动、服务资讯等。

### 三、客户服务中心

#### 1、客户服务电话

目前呼叫中心在工作时间提供人工应答服务。

#### 2、网上客户服务

管理人网站为份额持有人提供查询服务和资讯服务。份额持有人在我公司网站“账户查询”登录后,即可7\*24小时查询个人账户资料,包括份额持有情况、份额交易明细、份额分红实施情况等;此外,还可修改部分个人账户资料,查询热点问题及其解答等。

公司网址: <http://www.ixzzcgl.com/>

客服信箱: [zcgl@xyzq.com.cn](mailto:zcgl@xyzq.com.cn)

### 四、客户投诉处理

份额持有人可以通过管理人提供的客服热线人工坐席、书信、电子邮件等渠道对管理人和销售机构所提供的服务进行投诉。份额持有人还可以通过销售机构的服务电话对该销售机构提供的服务进行投诉。

## 五、服务渠道

- 1、客服电话：95562-3
- 2、公司网站：<http://www.ixzzcgl.com/>
- 3、客服邮箱：[zcgl@xyzq.com.cn](mailto:zcgl@xyzq.com.cn)
- 4、微信公众号：兴证资产管理微理财
- 5、其他，如邮寄等。

## 第二十二部分 其他应披露事项

以下信息披露事项已通过中国证监会规定媒介进行公开披露。

序号	法定披露日期	公告事项
1	2023-03-31	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划 2022 年年度报告
2	2023-04-03	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划（A 类份额）产品资料概要更新
3	2023-04-03	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划（C 类份额）产品资料概要更新
4	2023-04-03	兴证证券资产管理有限公司兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书更新（2023 年第 1 号）
5	2023-04-03	兴证证券资产管理有限公司兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同
6	2023-04-03	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划暂停申购、定期定额投资业务的公告
7	2023-04-03	兴证证券资产管理有限公司兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告
8	2023-04-07	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划（A 类份额）产品资料概要更新
9	2023-04-07	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划（C 类份额）产品资料概要

		更新
10	2023-04-07	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书更新（2023年第2号）
11	2023-04-21	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划2023年第1季度报告
12	2023-04-26	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划恢复申购、定期定额投资业务的公告
13	2023-07-21	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划2023年第2季度报告
14	2023-8-22	关于兴证证券资产管理有限公司运用自有资金投资旗下集合资产管理计划的公告
15	2023-8-31	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划2023年中期报告
16	2023-10-25	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划2023年第3季度报告
17	2023-12-19	兴证证券资产管理有限公司关于旗下部分集合计划参与北京证券交易所股票投资及相关风险提示的公告

## 第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书可印制成册，存放在管理人、托管人等机构的办公场所和营业场所，供投资者查阅；投资者也可按工本费购买本招募说明书印制件或复印件。但应以招募说明书正本为准。

管理人和托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第二十四部分 备查文件

本集合计划备查文件包括以下文件：

- （一）中国证监会准予兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同申请变更合同的文件
- （二）兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同
- （三）兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议
- （四）法律意见书
- （五）管理人业务资格批件和营业执照
- （六）托管人业务资格批件和营业执照
- （七）中国证监会要求的其他文件

兴证证券资产管理有限公司  
二〇二三年十二月二十九日