

方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划  
招募说明书（更新）

集合计划管理人：方正证券股份有限公司

集合计划托管人：交通银行股份有限公司

二零二四年一月

## 【重要提示】

方正金泉友 2 号集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）于 2010 年 11 月 2 日取得《中国证监会关于核准方正证券股份有限公司设立方正金泉友 2 号集合资产管理计划的批复》（中国证监会证监许可[2010]1517 号），并于 2010 年 11 月 18 日开始募集，2010 年 12 月 28 日成立。

根据《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》，本集合计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将集合计划名称变更为“方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划”，变更后的资产管理合同自集合计划管理人公告的生效之日起生效，原《方正金泉友 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

方正证券股份有限公司保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会批准，但中国证监会对原集合计划变更为本集合计划的批准，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。投资者应当认真阅读集合计划招募说明书、资产管理合同、产品资料概要等信息披露文件，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本集合计划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。本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，投资者购买本集合计划，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。集合计划管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划财产，但不保证投资于本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。如对本招募说明书有任何疑问，应寻求独立及专业的财务意见。

本集合计划投资于证券市场，集合计划净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本集合计划前，应全面了解本集合计划的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担集合计划投资中出现的各类风险，包括：因集合计划持有的资产市场价格的波动而产生的市场风险，由于集合计划投资人连续大量赎回集合计划产生的流动性风险，由于投资于信用证券等标的而产生的信用风险，集合计划管理人在集合计划管理实施过程中产生的集合计划管理风险，本集合计划的特有风险及其它风险。

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

本集合计划投资国债期货，主要面临的风险有流动性风险、基差风险、合约展期风险、保证金不足风险、衍生品杠杆风险等。

本集合计划资产投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制试点（以下简称“港股通机制”）允

许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）的，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对集合计划的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险请查阅本集合计划招募说明书“风险揭示”章节的具体内容。

本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。

本集合计划可投资国内依法发行上市的存托凭证，除普通股票投资可能面临的宏观经济风险、政策风险、市场风险、流动性风险外，还将面临因存托凭证而产生的特殊风险。集合计划净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外交易机制相关的风险可能直接或间接成为本集合计划风险。具体风险请查阅本集合计划招募说明书的“风险揭示”章节的具体内容。

当本集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见资产管理合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，管理人将对集合计划简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请集合计划份额持有人仔细阅读相关内容并关注本集合计划启用侧袋机制时的特定风险。

本集合计划 A 类或 C 类集合份额每个开放日开放申购，但本集合计划对集合计划份额持有人持有的 A 类或 C 类计划份额均设置一年的锁定持有期。在锁定持有期内，A 类或 C 类计划份额不能赎回；自锁定持有期结束后即进入开放持有期，每份 A 类或 C 类计划份额持有人自开放持有期首日起方可就该计划份额提出赎回申请。由红利再投资而来的集合计划份额不受锁定持有期的限制。

本集合计划 A 类计划份额、C 类计划份额合并运作，但不同份额销售费用收取方式不同，此等安排可能导致两类份额的份额净值、集合计划份额持有人收益不相同。

本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划。

集合计划的过往业绩并不预示其未来表现。集合计划管理人管理的其它集合计划的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。投资人在申购本集合计划时应认真阅读本集合计划的招募说明书、资产管理合同及产品资料概要。

除特别说明外，本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2024 年 1 月 15 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2023 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

## 目录

第一部分 绪言.....	4
第二部分 释义.....	4
第三部分 集合计划管理人.....	8
第四部分 集合计划托管人.....	17
第五部分 相关服务机构.....	20
第六部分 集合计划的基本情况.....	22
第七部分 集合计划的历史沿革.....	24
第八部分 集合计划的存续.....	24
第九部分 集合计划份额的申购、赎回.....	24
第十部分 集合计划的投资.....	33
第十一部分 集合计划的业绩.....	46
第十二部分 集合计划的财产.....	48
第十三部分 集合计划资产估值.....	48
第十四部分 集合计划的收益与分配.....	53
第十五部分 集合计划费用与税收.....	54
第十六部分 集合计划的会计与审计.....	56
第十七部分 集合计划的信息披露.....	57
第十九部分 风险揭示.....	64
第二十部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算.....	70
第二十一部分 资产管理合同的内容摘要.....	72
第二十二部分 托管协议的内容摘要.....	85
第二十三部分 对集合计划份额持有人的服务.....	99
第二十四部分 其他应披露事项.....	100
第二十五部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	100
第二十六部分 备查文件.....	100

## 第一部分 绪言

《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《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与《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”或“《资产管理合同》”）编写。

本招募说明书阐述了方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读招募说明书。

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

本招募说明书根据本集合计划的资产管理合同编写，并经中国证监会批准。资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利、义务的法律文件。集合计划投资人自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和资产管理合同的当事人，其持有集合计划份额的行为本身即表明其对资产管理合同的承认和接受，并按照《基金法》、资产管理合同及其他有关规定享有权利、承担义务。集合计划投资人欲了解集合计划份额持有人的权利和义务，应详细查阅资产管理合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、集合计划或本集合计划：指方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划
- 2、集合计划管理人：指方正证券股份有限公司
- 3、集合计划托管人：指交通银行股份有限公司
- 4、资产管理合同或《资产管理合同》：指《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》及对资产管理合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指集合计划管理人与集合计划托管人就本集合计划签订之《方正证券鑫悦一年持有

期债券型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

7、产品资料概要：指《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新

8、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》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

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

20、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称

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

22、集合计划销售业务：指集合计划管理人或销售机构宣传推介集合计划，办理集合计划份额的

申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

23、销售机构：指方正证券股份有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与集合计划管理人签订了销售服务协议，办理销售业务的机构

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

25、登记机构：指办理登记业务的机构。集合计划的登记机构为方正证券股份有限公司或接受方正证券股份有限公司委托代为办理登记业务的机构

26、集合计划账户：指登记机构为投资者开立的、记录其持有的、集合计划管理人所管理的集合计划份额余额及其变动情况的账户

27、集合计划交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资等业务而引起的集合计划份额变动及结余情况的账户

28、资产管理合同生效日：指根据《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》变更后的《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效日，原《方正金泉友 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》同日失效

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

30、存续期：指原《方正金泉友 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》生效至资产管理合同终止之间的期限

31、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

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

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

34、开放日：指为投资者办理集合计划份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本集合计划参与港股通交易且该交易日为非港股通交易日，则本集合计划有权不开放申购、赎回，并按规定进行公告）。资产管理合同剩余存续期限不足 365 天时，集合计划份额的申购届时根据管理人公告办理

35、开放时间：指开放日集合计划接受申购、赎回或其他交易的时间段

36、《业务规则》：指本集合计划登记机构办理登记业务的相应规则及其不时做出的修订

37、申购：指资产管理合同生效后，投资者根据资产管理合同等文件的规定申请购买集合计划份额的行为

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

39、集合计划转换：指集合计划份额持有人按照资产管理合同和集合计划管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有集合计划管理人管理的、某一大集合计划的集合计划份额转换为集合计划管理人管理的其他大集合计划份额的行为

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

## 份额销售机构的操作

41、定期定额投资计划：指投资者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者指定银行账户内自动完成扣款及受理集合计划申购申请的一种投资方式

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

43、元：指人民币元

44、集合计划收益：指集合计划投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用集合计划财产带来的成本和费用的节约

45、集合计划资产总值：指集合计划拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、集合计划应收款项及其他资产的价值总和

46、集合计划资产净值：指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值

47、集合计划份额净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划份额总数

48、集合计划资产估值：指计算评估集合计划资产和负债的价值，以确定集合计划资产净值和集合计划份额净值的过程

49、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括集合计划管理人网站、集合计划托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

50、A 类计划份额：指本集合计划存续期间，在投资者申购时收取申购费用，且不从本类别计划资产中计提销售服务费的份额。对于投资者依据原《方正金泉友 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》参与并获得的方正金泉友 2 号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 A 类计划份额

51、C 类计划份额：指本集合计划存续期间，在投资者申购时不收取申购费用，但从本类别计划资产中计提销售服务费的份额

52、锁定持有期：本集合计划对集合计划份额持有人持有的 A 类或 C 类计划份额均设置一年的锁定持有期。即对于每份非红利再投资而来的 A 类或 C 类计划份额，锁定持有期为自 A 类或 C 类计划份额申购确认日起（即锁定持有期起始日），至申购确认日满一年对日的前一日（即锁定持有期到期日）的期间。若该对日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日。对于投资者依据原《方正金泉友 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》参与并获得的方正金泉友 2 号集合资产管理计划份额，申购确认日为原登记机构确认投资者持有方正金泉友 2 号集合资产管理计划份额之日。红利再投资所形成的集合计划份额不受锁定持有期限限制。在锁定持有期内，A 类或 C 类计划份额不能赎回

53、开放持有期：对于每份非红利再投资而来的 A 类或 C 类计划份额，自锁定持有期结束后即进入开放持有期，开放持有期首日为锁定持有期到期日的下一个工作日。每份非红利再投资而来的 A 类或 C 类计划份额在开放持有期期间的开放日可以办理赎回业务

54、销售服务费：指从集合计划财产中计提的，用于本集合计划市场推广、销售以及集合计划份



## 额持有人服务的费用

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

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

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

59、内地与香港股票市场交易互联互通机制：指上海证券交易所、深圳证券交易所分别和香港联合交易所有限公司（以下简称香港联合交易所）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票。内地与香港股票市场交易互联互通机制包括沪港股票市场交易互联互通机制（“沪港通”）和深港股票市场交易互联互通机制（“深港通”）

60、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由上海证券交易所/深圳证券交易所在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票，包括沪港通下的港股通和深港通下的港股通

61、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、使《资产管理合同》当事人无法全部或部分履行《资产管理合同》的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

62、大集合计划：指《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》规范的大集合产品

## 第三部分 集合计划管理人

### 一、集合计划管理人概况

名称：方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4, 5 号楼 3701-3717

办公地址：北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 18 层

法定代表人：施华

成立日期：1994年10月26日

批准设立机关及批准设立文号：浙江省人民政府办公厅浙政办发[1990]47号文批准

组织形式：股份有限公司

注册资本：82.32亿

存续期限：持续经营

联系电话：95571

联系人：李奕霏

股权结构：方正证券股份有限公司为A股上市公司。截至2023年9月30日，公司股权结构如下表所示：

股东名称	股份数量（股）	占股份总数的比例
新方正控股发展有限责任公司	2,363,237,014.00	28.71%
香港中央结算有限公司	1,263,462,349.00	15.35%
全国社会保障基金理事会	1,089,704,789.00	13.24%
中国信达资产管理股份有限公司	709,886,375.00	8.62%
其他A股股东	3,535,124,692.00	34.08%
合计	8,232,101,395.00	100.00%

注：全国社保基金理事会持股数量为按照财行[2022]195号《财政部关于将有关依法罚没股票划转充实全国社会保障基金有关事宜的通知》划入的持股数量，不含全国社会保障基金理事会通过委托投资及指数化投资组合（含港股通）间接持有的部分。

## 二、主要人员情况

### 1、集合计划管理人董事会、监事会成员、高级管理人员

姓名	主要工作经历
现任董事	
施华	施华先生，1972年1月出生，硕士。曾任北京北大方正电子有限公司媒体运营管理部经理，方正奥德计算机系统有限公司副总裁，方正国际软件有限公司资深副总裁，方正国际软件（长春）有限公司董事，深圳方正微电子有限公司董事，北京怡健殿诊所有限公司董事长、法定代表人，方正科技集团股份有限公司董事，方正产业控股有限公司董事长、法定代表人，北大医疗信息技术有限公司董事，方正集团（香港）有限公司董事，北大方正投资有限公司董事长、法定代表人，北京北大方正技术研究院有限公司董事，

	<p>北大方正物产集团有限公司董事，北大方正集团财务有限公司董事长、法定代表人，北大医疗产业集团有限公司监事会主席，方正资本控股股份有限公司董事，江苏苏钢集团有限公司董事长、法定代表人，北大资源（控股）有限公司执行董事，北大方正集团财务有限公司董事，方正承销保荐董事。2015年10月至今任方正集团执行委员会委员、副总裁；2018年3月至今任方正集团首席运营官；2017年7月至今任北大方正人寿保险有限公司董事长、法定代表人；2018年1月至今任公司董事、党委书记，2018年9月至今任公司董事长、法定代表人。</p>
何亚刚	<p>何亚刚先生，1964年5月出生，硕士。曾任泰阳证券有限责任公司总裁，历任公司总裁助理、副总裁、执行委员会委员、执行委员会副主任、总裁、首席运营官、董事会秘书，曾任瑞信证券监事会主席、方正富邦基金监事、方正承销保荐董事长。2015年2月至今任公司董事，2020年8月至今任公司执行委员会主任；2013年12月至今任方正中期期货董事；2017年5月至今任方正和生投资董事长、方正富邦创融董事；2017年7月至今任方正富邦基金董事长、方正香港金控董事；2018年11月至今任瑞信证券董事；2021年12月至今任方正香港金控董事长、方正承销保荐董事。</p>
李岩	<p>李岩先生，1974年9月出生，硕士。曾在中国平安保险（集团）股份有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司任职；历任平安证券股份有限公司财务企划部副总经理、财务企划部总经理、财务总监、总经理助理兼首席财务官；曾任花样年集团（中国）有限公司首席运营官、平安理财有限责任公司财务总监、方正集团总裁特别助理。2023年1月至今任公司董事，2023年2月至今任公司执行委员会委员、副总裁、财务负责人，2023年4月至今任公司董事会秘书。</p>
宋洪军	<p>宋洪军先生，1966年1月出生，硕士。曾任财政部金融司金融一处副处长，交通银行股份有限公司董事；历任全国社会保障基金理事会财务会计部财务处副处长，基金财务部财务处处长，副主任，养老金会计部副主任、主任，证券投资部主任，股票投资部主任。2023年1月至今任社保基金会专职董事；2023年1月至今任公司董事。</p>
张路	<p>张路先生，1980年9月出生，硕士。历任中国信达资产管理公司资产管理部副经理，总裁办公室副经理、经理、高级副经理；信达资本管理有限公司副总经理，董事会执行委员会委员，总监。2022年10月至今任中国信达资产管理股份有限公司战略客户三部总经理助理，并在中国信达资产管理股份有限公司下属企业或出资企业担任董事、监事或高级管理人员；2023年1月至今任公司董事。</p>
张忠民	<p>张忠民女士，1968年10月出生，本科学历，博士学位。历任全国社会保障基金理事会投资部干部、投资部研究发展处助理调研员、股权资产部（实业投资部）权益处调研员、权益管理处处长、副主任。自2023年6月起，任全国社会保障基金理事会派出董监事。</p>

林钟高	林钟高先生，1960年9月出生，学士学位。历任安徽工业大学管理学院院长、校长助理、副校长；安徽工业大学“会计学”二级教授，1993年国务院“政府特殊津贴”获得者。2021年5月至今任中钢天源股份有限公司独立董事；2022年2月至今任黄山永新股份有限公司独立董事；2023年1月至今任公司独立董事。
曹诗男	曹诗男女士，1983年5月出生，博士研究生。曾任对外经济贸易大学金融学院讲师、副教授，中国人民大学财政与金融学院讲师、博士后，美国哈佛大学访问教授，美国波士顿大学访问研究员，北京师范大学发展心理研究所数据分析师，西藏奕泽技术科技合伙企业执行事务合伙人，西藏医途技术科技合伙企业执行事务合伙人，聚润（北京）资本管理有限公司执行董事，苏州智汇金融科技研究院有限公司监事。2014年8月至今任对外经济贸易大学金融战略与量化研究中心主任；2016年2月至今任聚润科技有限公司执行董事、法定代表人、经理；2018年10月至今任对外经济贸易大学博士生导师；2020年1月至今任苏州润泽致远科技信息有限公司监事；2021年4月至今任对外经济贸易大学金融学院教授；2021年5月至今任公司独立董事。
柯荣富	柯荣富先生，1964年9月出生，研究生学历，博士学位。曾任职于浙江师范大学外事办公室，浙江省嘉兴市外事办公室，中科联控股集团有限公司，天同星投资顾问有限公司，上海复帅投资管理有限公司，上海交通大学金融与创业投资研究所。现任中国浦东干部学院金融学讲席教授、金融创新研究中心主任、上海市金融学会理事、金融发展与合作研究部副主任、上海复浦投资管理中心(有限合伙)执行事务合伙人、上上德盛集团股份有限公司独立董事。2023年6月至今任公司董事。
现任监事	
蔡平	蔡平女士，1968年10月出生，研究生学历，硕士学位。曾先后任职于兰州生物制品研究所、广州索能联业科技发展有限公司、中国平安保险（集团）股份有限公司、平安银行股份有限公司、金融壹账通股份有限公司。曾任平安证券股份有限公司党委副书记、公共事务总监。2023年6月至今任公司监事会主席。2023年7月起兼任方正承销保荐监事。
陈曦	陈曦女士，1986年8月出生，本科学历，学士学位。曾任职于哈尔滨市呼兰区人才服务局；2013年8月至2017年3月先后任哈尔滨哈投投资股份有限公司办公室职员、证券事务专员。现任哈尔滨哈投投资股份有限公司证券事务代表、投资总监助理。2023年至今任公司监事。
徐国华	徐国华先生，1968年11月出生，法学学士。2008年7月至2017年1月历任方正证券法律合规与风险管理部总经理、法律合规部总经理、法律合规部行政负责人，方正承销保荐监事；2017年1月至今任公司助理总裁，2018年1月至今任公司监事，2018年4月至今兼任稽核监察部行政负责人；2017年4月至今任方正中期期货董事；2020年6月至今任方正和生投资董事。
现任高级管理人员	

何亚刚	详见本章节“现任董事”。
李岩	详见本章节“现任董事”。
孙斌	孙斌先生，1968年4月出生，硕士。曾任泰阳证券有限责任公司合规总监、公司首席风险官、方正和生投资董事、方正证券投资董事、瑞信证券董事、方正承销保荐首席风险官。2010年9月至2023年5月任公司合规总监；2012年11月至今任公司执行委员会委员；2023年2月至今任方正证券首席风险官；2015年8月至今任方正承销保荐合规总监；2018年2月至今任湖南方正证券汇爱公益基金会监事。
姜志军	姜志军先生，1969年2月出生，硕士。历任公司机构管理部、法律合规部、运营管理部、网点运营部、经纪业务管理部总经理、助理总裁、北京分公司总经理，历任方正承销保荐副总裁、总裁、董事。2016年7月至今任公司副总裁；2018年8月至今任公司执行委员会委员；2015年11月至今任方正中期期货董事长；2022年6月至今任方正证券投资董事；2022年6月至今任方正香港金控董事。
崔肖	崔肖先生，1976年8月出生，硕士学位。历任航天科技财务有限责任公司资产管理部副总经理、总经理，客户服务部总经理；历任公司自营分公司总经理，公司助理总裁、衍生品部行政负责人、创新投资部行政负责人；方正承销保荐助理总裁。2019年6月至今任公司副总裁；2021年12月至今任公司执行委员会委员；2021年12月至今任方正证券投资董事。
徐子兵	徐子兵先生，1965年5月出生，硕士。曾任深圳市龙岗区投资管理公司项目经理，联合证券有限公司项目经理，新华信托股份有限公司副总经理，长春证券有限责任公司副总经理，新世纪基金管理有限公司常务副总经理，新产业创业投资有限公司总经理，方正承销保荐副总裁、总裁，方正证券投资董事。2015年8月至今任公司执行委员会委员；2017年1月至今任公司副总裁；2014年7月至今任方正承销保荐董事；2018年4月至今任方正承销保荐董事长。
吴珂	吴珂先生，1978年11月出生，硕士学位。历任方正集团人力资源部经理、总监、高级总监、总经理，曾任公司助理总裁、人力资源部总经理，方正承销保荐副总裁。2013年5月至今任公司副总裁，2016年4月至今任公司执行委员会委员；2016年5月至今任方正证券投资董事；2017年1月至今任方正中期期货董事；2017年7月至今任方正香港金控董事；2018年12月至今任方正和生投资董事；2022年6月至今任方正证券投资董事长；2018年2月至今任湖南方正证券汇爱公益基金会理事。
袁玉平	袁玉平先生，1975年7月出生，研究生学历，博士学位。曾先后任职于北京有色金属研究总院、联合证券有限责任公司、中国证监会发行监管部、兴业证券股份有限公司；历

	任平安证券股份有限公司总经理助理、执行委员会委员。2023年2月至今任公司执行委员会委员、副总裁。
曹玉海	曹玉海先生，1981年12月出生，本科学历，硕士学位。曾任职于天健会计师事务所（特殊普通合伙），兴业证券股份有限公司，中国证监会，北京京东财信息科技有限公司；历任民生证券股份有限公司总裁助理、投资银行专业委员会副主任。现任公司执行委员会委员、合规总监。
曲浩	曲浩先生，1977年1月出生，硕士。曾任神州数码（中国）有限公司电信事业部高级软件工程师，IBM公司CRL高级软件工程师，人人网技术总监，58同城技术中心总经理，公司首席技术官、互联网金融研究与工程院行政负责人、金融科技工程院行政负责人。2019年6月至今任公司首席信息官；2019年6月至今任方正承销保荐首席信息官。
熊郁柳	熊郁柳女士，1982年4月出生，硕士。历任北大医药股份有限公司董事会秘书办公室主任、助理总裁、董事会秘书，历任公司董事会办公室总经理、助理总裁、董事会秘书、战略客户与市场部行政负责人，曾任方正承销保荐董事会秘书。2015年8月至今任公司副总裁；2021年9月至今任瑞信证券董事，2018年2月至今任湖南方正证券汇爱公益基金会理事，2022年1月至今任湖南方正证券汇爱公益基金会理事长。

## 2、集合计划管理人投资经理

### （1）现任投资经理

本集合计划现任投资经理为李理先生。

李理，男，清华大学经济学博士，2018年入职中国工商银行总行金融市场部固定收益处任投资经理，2016年加入广州证券股份有限公司（现中信证券华南股份有限公司）固定收益事业部任投资经理。2020年7月加入方正证券股份有限公司，现任方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司资管债券投资部联席行政负责人、投资经理。2021年3月3日起担任方正证券金港湾六个月持有期债券型集合资产管理计划投资经理。未在其他公司兼职。

### （2）历任投资经理

李道滢，男，2021年9月16日至2022年11月18日期间任本集合计划的投资经理。

傅岳鹏，男，2021年9月27日至2023年1月18日期间任本集合计划的投资经理。

## 3、投资决策委员会成员

本集合计划采取集体投资决策制度。方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司（以下简称“资产管理分公司”）是公司资产管理业务的归口管理部门。资产管理分公司公募证券投资决策委员会（以下简称“投决会”）设主任委员1名、秘书1名、委员若干名。

投决会委员包括：

李正红，男，投决会主任委员，资产管理分公司总经理；

杨笑天，男，投决会秘书，资管债券投资部投资经理助理。

公募组：

李理，男，公募组组长，资管债券投资部联席行政负责人；

宫健，男，公募组组员，资管债券投资部投资经理；

王炳修，女，公募组组员，资管权益投资部研究员；

魏铭江，男，公募组组员，资管债券投资部信评研究员。

#### 4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、集合计划管理人的职责

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

2、办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金手续；

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

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

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

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

7、依法接受集合计划托管人的监督；

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

9、进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

18、组织并参加集合计划财产清算小组，参与集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配；  
19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知集合计划托管人；  
20、因违反《资产管理合同》导致集合计划财产的损失或损害集合计划份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

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

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

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

24、执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

25、建立并保存集合计划份额持有人名册；

26、法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

#### 四、集合计划管理人承诺

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

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

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

(2) 不公平地对待管理的不同集合计划财产；

(3) 利用集合计划财产或者职务之便为集合计划份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4) 向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用集合计划财产；

(6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、集合计划管理人承诺严格遵守资产管理合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反资产管理合同行为的发生；

4、集合计划管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责；

5、集合计划管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

#### 五、集合计划投资经理承诺



- 1、依照有关法律法规和资产管理合同的规定，本着谨慎的原则为集合计划份额持有人谋取最大利益；
- 2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；
- 3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密，尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 六、集合计划管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

- (1) 全面性原则。内部控制应贯穿决策、执行和监督全过程，覆盖公司的各种业务和事项。
- (2) 重要性原则。内部控制应在全面控制的基础上，关注重要业务事项和高风险领域。
- (3) 制衡性原则。内部控制应在治理结构、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。
- (4) 适应性原则。内部控制应符合国家有关法律法规和中国证监会的有关规定，与公司经营规模、业务范围、风险状况及公司所处的环境相适应，并随着情况的变化及时加以调整。
- (5) 成本效益原则。内部控制应权衡实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

### 2、组织架构

公司董事会负责公司内部控制的建立健全和有效实施，对内部控制的有效性承担最终责任。

公司董事会下设审计委员会，负责审查公司内部控制，监督内部控制的有效实施和内部控制自我评价情况，协调内部控制审计等。

资产管理分公司开展资产管理业务的相关工作，全面防范资产管理业务各类风险。

公司合规部负责指导资产管理业务全面风险管理体系的建立和实施；负责对资产管理业务开展进行合规咨询、合规审查、合规检查等；负责对资产管理业务相关协议进行合同审查；公司风险管理部负责对资产管理业务的风险管理工作进行风险复核、监督、检查和评估。

公司稽核审计与法律部对资产管理业务进行定期或者不定期的全面审计工作，并出具审计报告。

公司财务管理部、资金运营中心、结算托管中心、信息技术中心和办公室等职能部门对资产管理业务开展财务核算、税务、资金和流动性管理、交易管理和清算交收、信息技术安全、系统支持和检查、档案管理、印章管理等工作，防范操作风险。

### 3、制度建设

公司严格按照《基金法》及其配套法规、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》等相关法律法规的规定，按照合法合规性、全面性、审慎性、适时性原则，建立健全内部控制制度。公司规章制度根据审定权限、适用范围及效力分为基本管理制度、重要管理制度、涉及多个部门或分支机构的管理制度和部门、分支机构的内部管理制度四个级别。

- (1) 基本管理制度为第一级别规章制度，由公司董事会审批。
- (2) 重要管理制度为第二级别规章制度，由公司执行委员会审批，为公司对总部部门职责范围

内的相关业务、运营及管理事项以及涉及分支机构管理相关事项总体安排的制度。

(3) 涉及多个部门或分支机构的管理制度为第三级别规章制度，为了实施基本管理制度和重要管理制度而制定的有关细则、指引等，由起草部门行政负责人审核，报分管领导审定；如需提报相关专业委员会审议的，分管领导审定后需提报专业委员会审议。

(4) 部门、分支机构的内部管理制度为第四级别规章制度，公司各部门、分支机构在职责范围内，为规范本部门、机构的内部经营而制定的有关规范、标准等，由起草部门行政负责人审核，报分管领导审定。

资产管理分公司各部门（以下简称“各部门”）负责各自业务及职责范围内制度的起草和修订；资产管理业务管理部为规章制度的审查部门，负责新制定或修订制度的合规审查、提出制度修订或废止的意见、编制制度制定或修订计划；资产管理分公司办公会负责由资产管理分公司各部门起草的第一、二、三级别规章制度的审议及第四级别中涉及资产管理分公司整体（即全体部门）的规章制度或起草部门行政负责人认为有必要提交资产管理分公司办公会审批的规章制度的审定、批准；资产管理分公司分管高管及各起草部门行政负责人、资产管理业务管理部行政负责人负责不属于上述情形的第四级别规章制度的审定、批准。

#### 4、管理人关于内部控制的声明

- (1) 管理人承诺内部控制的披露真实、准确。
- (2) 管理人承诺将根据市场环境的变化及公司的发展不断完善内部控制制度或规则。
- (3) 管理人承诺将积极配合外部风险监督工作。

## 第四部分 集合计划托管人

### 一、集合计划托管人基本情况

#### (一) 基本情况

名称：交通银行股份有限公司（简称“交通银行”）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号

办公地址：上海市长宁区仙霞路18号

法定代表人：任德奇

成立时间：1987年3月30日

组织形式：股份有限公司

注册资本：742.63亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立文号：国务院国发(1986)字第81号文和中国人民银行银发〔1987〕40号文

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字〔1998〕25号

联系人：陆志俊

联系电话：95559

传真：021-58798398

客服电话：95559

网址：www.bankcomm.com

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经各监督管理部门或者机构批准的其他业务（以许可批复文件为准）；经营结汇、售汇业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

交通银行股份有限公司（以下简称“交通银行”）始建于1908年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005年6月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007年5月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续14年跻身《财富》(FORTUNE)世界500强，营业收入排名第161位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第9位。

截至2023年9月30日，交通银行资产总额为人民币13.83万亿元。2023年三季度，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币691.7亿元。交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

## （二）主要人员情况

任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生2020年1月起任交通银行董事长（其中：2019年12月至2020年7月代为履行行长职责）、执行董事，2018年8月至2020年1月任交通银行副董事长（其中：2019年4月至2020年1月代为履行董事长职责）、执行董事，2018年8月至2019年12月任交通银行行长；2016年12月至2018年6月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015年10月至2018年6月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016年9月至2018年6月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014年7月至2016年11月任中国银行副行长，2003年8月至2014年5月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988年7月至2003年8月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生1988年于清华大学获工学硕士学位。

刘珺先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

刘先生2020年7月起担任交通银行行长；2016年11月至2020年5月任中国投资有限责任公司副总经理；2014年12月至2016年11月任中国光大集团股份公司副总经理；2014年6月至2014年12月任中国光大（集团）总公司执行董事、副总经理（2014年6月至2016年11月期间先后兼任光大永明人寿保险有限公司董事长、中国光大集团有限公司副董事长、中国光大控股有限公司执行董事兼副主席、中国光大国际有限公司执行董事兼副主席、中国光大实业（集团）有限责任公司董事长）；2009年9月至

2014年6月历任中国光大银行行长助理、副行长（期间先后兼任中国光大银行上海分行行长、中国光大银行金融市场中心总经理）；1993年7月至2009年9月先后在中国光大银行国际业务部、香港代表处、资金部、投行业务部工作。刘先生2003年于香港理工大学获工商管理博士学位。

徐铁先生，资产托管部总经理。

徐铁先生2022年4月起任交通银行资产托管部总经理；2014年12月至2022年4月任交通银行资产托管部副总经理；2000年7月至2014年12月，历任交通银行资产托管部客户经理、保险与养老金部副高级经理、高级经理、保险保障业务部高级经理、总经理助理。徐先生2000年于复旦大学获经济学硕士学位。

### （三）集合计划托管业务经营情况

截至2023年9月30日，交通银行共托管证券投资基金757只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、期货公司资产管理计划、QFII证券投资资产、RQFII证券投资资产、QDII证券投资资产、RQDII证券投资资产、QDIE、QDLP和QFLP等产品。

## 二、集合计划托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管部业务制度健全并确保贯彻执行各项规章制度，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护基金持有人的合法权益。

### （二）内部控制原则

1、合法性原则：托管部制定的各项制度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始终。

2、全面性原则：托管部建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管部独立负责受托基金资产的保管，保证基金资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托基金资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管部贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管部在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目标被有效执行。

6、效益性原则：托管部内部控制与基金托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管部制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保基金托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务系统建设管理办法》、《交通银行资产托管部信息披露制度》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管部通过对基金托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对基金托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### 三、集合计划托管人对集合计划管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

交通银行作为集合计划托管人，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，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金的申购资金的到账与赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为集合计划托管人，发现集合计划管理人有违反《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《基金合同》的行为，及时通知集合计划管理人予以纠正，集合计划管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促集合计划管理人改正。集合计划管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行有权报告中国证监会。

交通银行作为集合计划托管人，发现集合计划管理人有重大违规行为，有权立即报告中国证监会，同时通知集合计划管理人限期纠正。

## 第五部分 相关服务机构

### 一、集合计划份额销售机构

#### 1、方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4，5号楼3701-3717

办公地址：北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18层

法定代表人：施华

客户咨询电话：95571

传真：010-56992708

联系人：李奕霏

#### 2、上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

客户咨询电话：021-54509977

传真：021-64385308

联系人：陈思琦

### 3、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

办公地址：浙江省杭州市西湖区西溪路556号

法定代表人：王珺

联系人：韩爱彬

电话：0571-26888888-37494

### 4、北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2

法定代表人：王伟刚

联系人：史春晖

电话：15810201996

### 5、方正中期期货有限公司

注册地址：北京市石景山区金府路32号院3号楼5层512室

办公地址：北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座16层

法定代表人：姜志军

联系人：罗雯

电话：17752708690

### 6、京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区知春路76号(写字楼)1号楼4层1-7-2

办公地址：北京市亦庄经济开发区科创十一街18号院A座15层

法定代表人：邹保威

联系人：苏湘然

电话：13552280319

### 7、浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路1号903室

办公地址：浙江省杭州市文二西路1号903室

法定代表人：吴强

联系人：肖宏旭

电话：0571-88911818-8659

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

## 二、登记机构

名称	方正证券股份有限公司
住所	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4, 5号楼3701-3717
办公地址	北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18层
法定代表人	施华
联系人	丁一、吴元栋
电话	(010) 68585099、(010) 68585091

## 三、出具法律意见书的律师事务所

名称	上海市通力律师事务所		
住所、办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心19楼		
负责人	韩炯	联系人	丁媛
电话	(021) 31358666	传真	(021) 31358600
经办律师	黎明、丁媛		

## 四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大厦19层		
办公地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大厦19层		
法定代表人	毛鞍宁	联系人	王琦
电话	(010) 5815 3000	传真	(010) 8518 8298
经办注册会计师	宋雪强、王琦、孙婧		

# 第六部分 集合计划的基本情况

## 一、集合计划名称

方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划

## 二、集合计划的类别

债券型集合资产管理计划

## 三、集合计划的运作方式

契约型开放式

本集合计划A类或C类集合份额每个开放日开放申购，但本集合计划对集合计划份额持有人持有的A类或C类计划份额均设置一年的锁定持有期。自锁定持有期结束后即进入开放持有期，每份A类或C类计划份额持有人自开放持有期首日起方可就该计划份额提出赎回申请。由红利再投资而来的集合计划份额不受锁定持有期的限制。

具体请见“集合计划份额的申购、赎回”部分。

## 四、集合计划份额面值

本集合计划份额面值为人民币1.00元。

## 五、集合计划存续期限

本集合计划自资产管理合同生效日起存续期不得超过3年。

## 六、集合计划份额类别设置

本集合计划根据销售费用收取方式的不同，将份额分为不同的类别。

本集合计划存续期间，在投资者申购时收取申购费用，且不从本类别计划资产中计提销售服务费的份额称为A类计划份额。

本集合计划存续期间，在投资者申购时不收取申购费用，但从本类别计划资产中计提销售服务费的份额称为C类计划份额。

投资者依据原《方正金泉友2号集合资产管理计划集合资产管理合同》参与并获得的方正金泉友2号集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起自动转换为本集合计划A类计划份额，其持有时间从登记机构确认投资者持有方正金泉友2号集合资产管理计划份额之日起连续计算。本集合计划A类和C类计划份额分别设置代码，分别计算和公告各类集合计划份额净值和各类集合计划份额累计净值。

投资者在申购份额时可自行选择A类或C类计划份额类别。本集合计划不同份额类别之间不得互相转换。

根据集合计划实际运作情况，在不违反法律法规、资产管理合同的约定以及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与集合计划托管人协商一致，集合计划管理人可增加、减少或调整集合计划份额类别设置、对集合计划份额分类办法及规则进行调整并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开集合计划份额持有人大会。



## 第七部分 集合计划的历史沿革

本集合计划由方正金泉友2号集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。

原集合计划于2010年11月2日取得中国证监会《关于核准方正证券股份有限公司设立方正金泉友2号集合资产管理计划的批复》（证监许可[2010]1517号），并于2010年11月18日开始募集，2010年12月28日成立。

根据《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》，本集合计划参照《基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，并将集合计划名称变更为“方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划”，变更后的资产管理合同自集合计划管理人公告的生效之日起生效，原《方正金泉友2号集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

## 第八部分 集合计划的存续

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

本集合计划自资产管理合同生效日起存续期不得超过3年。如资产管理合同生效日起3年后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 第九部分 集合计划份额的申购、赎回

### 一、申购和赎回场所

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

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资者在开放日办理集合计划份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（若本集合计划参与港股通交易且该交易日为非港股通交易日，则本集合计划有权不开放申购、赎回，并按规定进行公告），但集合计划管理人根据法律法规、中国证监会的要求或资产管理合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

## 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

本集合计划对集合计划份额持有人持有的A类或C类计划份额均设置一年的锁定持有期。即对于每份非红利再投资而来的A类或C类计划份额，锁定持有期为自A类或C类计划份额申购确认日起（即锁定持有期起始日），至申购确认日满一年对日的前一日（即锁定持有期到期日）的期间。若该对日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日。

对于投资者依据原《方正金泉友2号集合资产管理计划集合资产管理合同》参与并获得的方正金泉友2号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A类计划份额，申购确认日为原登记机构确认投资者持有方正金泉友2号集合资产管理计划份额之日。在锁定持有期内，A类或C类计划份额不能赎回。

自锁定持有期结束后即进入开放持有期，每份A类或C类计划份额持有人自开放持有期首日起方可就该计划份额提出赎回申请。如果投资人多次申购本集合计划A类或C类计划份额，则其持有的A类或C类计划份额的赎回开放时间可能不同。由红利再投资而来的A类或C类计划份额不受锁定持有期的限制。

集合计划管理人自资产管理合同生效之日起不超过3个月开始办理计划份额的赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。自锁定持有期到期后的下一个工作日起（含该日），A类或C类计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。如果投资人多次申购本集合计划A类或C类计划份额，则其持有的A类或C类计划份额的赎回开放时间可能不同。由红利再投资而来的A类或C类计划份额不受锁定持有期的限制。在确定申购开始与赎回开始时间后，集合计划管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

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

## 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在集合计划管理人规定的时间以内撤销，集合计划销售机构另有规定的，以集合计划销售机构的规定为准；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照投资者持有集合计划份额登记日期的先后次序进行顺序赎回，集合计划份额持有人持有原方正金泉友2号集合资产管理计划份额的期限连续计算；

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

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

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

投资者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

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

集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；集合计划登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，集合计划管理人将在法律法规规定的期限内支付赎回款项。正常情况下，投资者赎回（T日）申请生效后，集合计划管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。

如遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行交换系统故障、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制或其他非集合计划管理人及集合计划托管人所能控制的因素影响了业务流程，则赎回款项划付时间相应顺延至上述情形消除后的下一个工作日划往集合计划份额持有人银行账户。

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

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

##### 3、申购和赎回申请的确认

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

销售机构对申购和赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购和赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合法权利。因投资者怠于行使权利，致使其相关权益受损的，集合计划管理人、集合计划托管人、集

合计划销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

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

## 五、申购和赎回的数量限制

### 1、申请申购集合计划的金额

投资者通过代销机构或方正证券股份有限公司网上直销首次申购本集合计划份额的单笔最低限额为人民币1元（含申购费，下同），追加申购单笔最低限额为1元。

投资者通过直销中心柜台首次申购集合计划份额的单笔最低限额为人民币1元，追加申购单笔最低限额为人民币1元。实际操作中，各销售机构在符合上述规定的前提下，可根据情况调高首次申购和追加申购的最低金额，具体以销售机构公布的为准，投资人需遵循销售机构的相关规定。

### 2、申请赎回集合计划的份额

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

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

3、本集合计划管理人可以对投资人每个交易账户的最低集合计划份额余额进行限制，具体规定请参见招募说明书或相关公告。但各销售机构对交易账户最低份额余额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

4、本集合计划不对单个投资人累计持有的集合计划份额上限进行限制。法律法规或中国证监会另有规定的除外。

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

6、集合计划管理人可以对集合计划的总规模进行限制，并在相关公告中列明。

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

## 六、申购费用与赎回费用

### 1、申购费用

本集合计划A类计划份额在申购时收取申购费用，C类计划份额不收取申购费用。

本集合计划A类计划份额的申购费率按申购金额进行分档。投资人在一天之内如果有多笔申购，

适用费率按单笔分别计算。

A类计划份额的具体申购费率如下表所示：

申购确认金额（M）	申购费率
M<100万元	0.70%
100万元≤M<300万元	0.50%
300万元≤M<500万元	0.30%
M≥500万元	每笔1000元

A类计划份额的申购费用由申购A类计划份额的投资者承担，主要用于支付市场推广、销售等各项费用，不列入集合计划财产。

## 2、赎回费用

本集合计划A类计划份额、C类计划份额在一年锁定持有期后赎回不收取赎回费用。

具体赎回费率如下表所示：

连续持有时间（Y）	赎回费率
Y<7日	1.50%
Y≥7日	0

对持续持有期少于7日的投资人收取的赎回费全额计入集合计划财产。

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

3、集合计划管理人可以按照资产管理合同的约定调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

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

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

## 七、申购份额与赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算

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

A类计划份额申购份额的计算方式：

集合计划的申购金额包括申购费用和净申购金额，其中：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

（注：对于适用固定金额申购费的申购，净申购金额=申购金额—固定申购费金额）

申购费用=申购金额—净申购金额

申购份额=净申购金额/T日A类计划份额净值

例：某投资者投资100,150元申购本集合计划A类计划份额，且该申购申请被全额确认，对应的申购费率为0.7%，假定申购当日A类计划份额净值为1.2000元，则可得到的申购份额为：

净申购金额=100,150/（1+0.7%）=99,453.82元

申购费用=100,150-99,453.82=696.18元

申购份额=99,453.82/1.2000=82,878.18份

即投资者选择投资100,150元申购本集合计划A类计划份额，假定申购当日A类计划份额净值为1.2000元，可得到82,878.18份A类计划份额。

## 2、赎回金额的计算

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

赎回金额为赎回总额扣减赎回费用，其中：

赎回总额=赎回份额×T日该类集合计划份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用

例：某投资者赎回10,000份本集合计划A类计划份额，持有时间为380日，对应赎回费率为0，假设赎回申请当日A类计划份额净值是1.0680元，则可得到的赎回金额为：

赎回总额=10,000×1.0680=10,680.00元

赎回费用=0.00元

赎回金额=10,680.00-0.00=10,680.00元

即：投资者赎回10,000份A类计划份额，持有时间为380日，假设赎回申请当日A类计划份额净值是1.0680元，则其可得到的赎回金额为10,680.00元。

## 3、集合计划份额净值的计算

本集合计划A类、C类计划份额分别设置代码，分别计算和公告各类集合计划份额净值和各类集合计划份额累计净值。本集合计划各类集合计划份额净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。T日的各类集合计划份额净值在当天收市后计算，并在T+1日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

## 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，集合计划管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1、因不可抗力导致集合计划无法正常运作。

2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致集合计划管理人无法计算当日集合计划资产净值或者无法办理申购业务。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有集合计划份额持有人利益时。

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

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

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

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

9、港股通交易每日额度不足。

10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、7、9、10项暂停申购情形之一且集合计划管理人决定暂停接受申购申请时，集合计划管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第8项情形时，集合计划管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，集合计划管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项（无利息）将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，集合计划管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

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

1、因不可抗力导致集合计划管理人不能支付赎回款项。

2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致集合计划管理人无法计算当日集合计划资产净值或者无法办理赎回业务。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、集合计划管理人继续接受赎回申请将损害现有集合计划份额持有人利益的情形时。

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第1、2、3、5、6、7项情形之一而集合计划管理人决定暂停接受集合计划份额持有人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时，集合计划管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，集合计划管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按资产管理合同的相关条款处理。集合计划份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂

赎回的情况消除时，集合计划管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、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，集合计划管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

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

（2）部分延期赎回：当集合计划管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的财产变现可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，集合计划管理人在当日接受赎回比例不低于上一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。若集合计划发生巨额赎回，对于单个集合计划份额持有人当日超过上一开放日集合计划总份额10%以上部分的赎回申请，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，集合计划管理人应当通过邮寄、传真或者集合计划管理人网站在3个交易日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在指定媒介上刊登公告。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、集合计划管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确



重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、集合计划转换

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

## 十三、集合计划的非交易过户

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

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

## 十四、集合计划的转托管

集合计划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已持有集合计划份额在不同销售机构之间的转托管，集合计划销售机构可以按照规定的标准收取转托管费，相关规则由集合计划管理人届时根据相关法律法规及资产管理合同的规定制定并公告，并提前告知集合计划托管人与相关机构。

## 十五、定期定额投资计划

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

## 十六、集合计划的冻结和解冻

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

### 十七、集合计划份额的转让

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

### 十八、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回

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

### 十九、其他业务

在相关法律法规允许的条件下，集合计划登记机构可依据其业务规则，受理集合计划份额质押等业务，并收取一定的手续费用。

## 第十部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

本集合计划的投资目标是在充分考虑集合计划投资安全的基础上，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（含国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、证券公司发行的短期公司债券、非金融企业债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据））、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%，其中投资于可转换债券、可交换债券的比例合计不超过集合计划资产的20%；本集合计划股票投资占集合计划资产的0-20%，其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的0-50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于集

合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 三、投资策略

#### 1、资产配置策略

本集合计划将通过跟踪考量通常的宏观经济变量（包括GDP增长率、CPI走势、M2的绝对水平和增长率、利率水平与走势等）以及各项国家政策（包括财政、货币、税收、汇率政策等）来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向，在此基础上对各大类资产的风险和预期收益率进行分析评估，制定股票、债券、现金等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

#### 2、债券投资策略

本组合将根据国内外经济形势、货币政策环境、债券供需状况、市场微观机构的交易行为等多重因素综合判断债券市场的走势，并采取相应策略加以应对。

##### （1）利率策略

通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平。主要考虑的宏观经济政策因素包括：经济增长、就业、固定资产投资、市场销售、工业生产、居民收入等反映宏观经济运行态势的重要指标，银行信贷、货币供应和公开市场操作等反映货币政策执行情况的重要指标，以及居民消费物价指数和工业品出厂价格指数等反映通货膨胀变化情况的重要指标等。

##### （2）收益率曲线策略

通过对债券市场微观因素的分析判断，形成对未来收益率曲线形状变化的预期，相应地选择适当的组合期限配置，获取收益率曲线形变带来的投资收益。主要考虑的债券市场微观因素包括：收益率曲线、历史期限结构、新债发行、货币市场流动性及市场拆借利率等。

##### （3）类属替换策略

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

##### （4）个券优选策略

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

##### （5）信用债投资策略

本集合计划将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素，对信用债进行信用风险评估。依据内部的信用分析方法对可选的信用债进行筛选，买入并持有信用风险较低和溢价较高的信用债获取票息收益，并严格控制单只信用债券的投资比例，采取分散化投资策略，严

格控制组合整体的违约风险水平。

本集合计划所指信用债，包括企业债、公司债、金融债、中期票据、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等固定收益类证券。

本集合计划投资信用债时，所投资的信用债的信用评级范围和相应比例如下：

本集合计划主动投资信用债的债项评级范围为AA+级及以上，其中债项评级AA+级的信用债投资比例不超过信用债资产的50%，债项评级AAA级的信用债投资比例不低于信用债资产的50%。

信用评级或跟踪信用评级时，债券发行人仅披露主体信用等级的，则参考相应的主体信用等级的级别。信用评级主要参考取得中国证监会证券评级业务许可的资信评级机构的评级结果。如出现同一时间多家评级机构所出具信用评级不同的情况或没有对应评级的信用债券，集合计划管理人需结合自身的内部信用评级进行独立判断与认定，以集合计划管理人的判断结果为准。因资信评级机构调整评级等集合计划管理人之外的因素致使本集合计划投资信用债比例不符合上述约定投资比例的，集合计划管理人有权自行处理，不受10个交易日的调整限制，中国证监会规定的特殊情形除外。

#### （6）可转换债券、可交换债券投资策略

本集合计划将精选可转换债券、可交换债券投资标的，对发行公司的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等，并参考同类公司的估值水平、可转换债券的转股条款、可交换债券的换股条款等，判断可转换债券、可交换债券的股权投资价值；基于对利率水平、票息率及派息频率、信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值。把握可转换债券、可交换债券的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。

### 3、股票投资策略

本集合计划选择景气向上、质地优秀、业绩成长性较高以及估值合理的股票，强调具有可持续的景气度支撑的成长性、相对确定性及其与合理估值之间的动态平衡。本计划通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。核心思路在于：1）自上而下地分析经济发展趋势及其结构的变化、行业景气度与增长前景、行业结构与竞争格局、商业模式与市场空间等方面的重要变化与趋势来挖掘、把握投资机会；2）自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等及其所提供的产品和服务是否契合未来经济与社会发展的趋势以及行业变革的方向，在此基础上对企业基本面和估值水平进行综合的研判，深度挖掘优质的个股。

本集合计划还可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于港股通标的股票，在市值规模及流动性门槛的基础上，管理人将重点选取以下类别港股通标的：行业龙头公司；对于稀缺性行业，重点关注成长性较好或具有较强业务壁垒、安全边际较为充足的上市公司；与A股同类公司相比具有明显估值优势的上市公司。

### 4、国债期货投资策略

本集合计划进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

### 5、资产支持证券投资策略

本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益

和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

#### 6、存托凭证投资策略

本集合计划将根据投资目标和内地上市交易的股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

### 四、投资限制

#### （一）组合限制

本集合计划的投资组合将遵循以下比例限制：

（1）本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%，其中投资于可转换债券、可交换债券的比例不超过集合计划资产的20%；本集合计划股票投资占集合计划资产的0-20%，其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的0-50%；

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

（3）本集合计划持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合并计算，下同），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计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的大集合计划可以不受此条款规定的比例限制；

（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大集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

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

（10）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）本集合计划管理人管理的全部开放式大集合计划（包含开放式大集合计划以及处于开放期的采取定期开放方式运作的大集合计划）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的大集合计划以及

中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

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

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

(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) 本集合计划总资产不得超过集合计划净资产的140%；

(16) 本集合计划投资于国债期货的投资限制如下：

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

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

3) 本集合计划所持有的债券（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；

4) 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%；

(17) 本集合计划投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第（2）、（9）、（13）、（14）项情形之外，因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等集合计划管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，集合计划管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

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

如果法律法规或监管部门对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，则本集合计划投资不再受相关限制。

## （二）禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

1、承销证券；

2、违反规定向他人贷款或者提供担保；

- 3、从事承担无限责任的投资；
- 4、买卖其他集合计划或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- 5、向其集合计划管理人、集合计划托管人出资；
- 6、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- 7、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

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

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，集合计划管理人在履行适当程序后，本集合计划可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

## 五、业绩比较基准

本集合计划的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率 $\times$ 85%+沪深300指数收益率 $\times$ 10%+恒生指数收益率 $\times$ 5%。

其中，中债综合全价（总值）指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成份券种包括除资产支持债券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，同时兼具价值属性及成长属性，能够反映A股市场总体发展趋势。

恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制，以香港股票市场中的50家上市股票为成份股样本，以其发行量为权数的加权平均股价指数，是反映香港股市价幅趋势最有影响的一种股价指数。

本集合计划的业绩比较基准根据本集合计划资产配置比例和策略特点设置，能够准确反映本集合计划的风险收益特征，便于集合计划管理人合理衡量比较本集合计划的业绩表现。

如果今后法律法规发生变化，或者相关数据编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本集合计划时，本集合计划管理人可依据维护投资者合法权益的原则，在与集合计划托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开集合计划份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理

计划，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划。本集合计划可以投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 七、集合计划管理人代表集合计划行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于集合计划财产的安全与增值；

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

## 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

## 九、投资组合报告（未经审计）

管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本报告中财务资料未经审计。本报告期自2023年07月01日起至2023年09月30日止。

### 1、报告期末集合计划资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,208,271.76	8.63
	其中：股票	4,208,271.76	8.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	41,883,139.35	85.90
	其中：债券	41,883,139.35	85.90



	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	2,028,959.76	4.16
8	其他资产	637,497.57	1.31
9	合计	48,757,868.44	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

## (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)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	296,612.00	0.70
C	制造业	1,383,272.00	3.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	135,200.00	0.32
E	建筑业	208,320.00	0.49
F	批发和零售业	167,234.00	0.39
G	交通运输、仓储和邮政业	391,163.00	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	486,107.00	1.15
J	金融业	387,848.00	0.92
K	房地产业	62,140.00	0.15
L	租赁和商务服务业	110,587.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,340.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	122,176.00	0.29

S	综合	-	-
	合计	3,757,999.00	8.87

## (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
基础材料	34,236.77	0.08
消费者非必需品	89,015.61	0.21
消费者常用品	0.00	0.00
能源	77,374.56	0.18
金融	81,478.20	0.19
医疗保健	17,549.67	0.04
工业	47,753.46	0.11
信息技术	88,916.51	0.21
电信服务	0.00	0.00
公用事业	13,947.98	0.03
房地产	0.00	0.00
合计	450,272.76	1.06

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	100	179,855.00	0.42
2	002050	三花智控	3,400	100,980.00	0.24
3	600900	长江电力	4,500	100,080.00	0.24
4	601088	中国神华	2,400	74,880.00	0.18
4	01088	中国神华	500	11,653.90	0.03
5	600188	兖矿能源	4,000	81,000.00	0.19
6	600350	山东高速	10,000	71,600.00	0.17
7	601601	中国太保	2,500	71,475.00	0.17
8	600028	中国石化	11,000	66,770.00	0.16
9	601668	中国建筑	12,000	66,360.00	0.16
10	600857	宁波中百	7,000	66,150.00	0.16

## 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)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,342,051.14	5.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	14,478,793.00	34.17
	其中：政策性金融债	4,127,381.42	9.74
4	企业债券	11,351,018.63	26.79
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	9,128,814.75	21.54
7	可转债（可交换债）	3,625,463.71	8.56
8	同业存单	-	-
9	其他	956,998.12	2.26
10	合计	41,883,139.35	98.84

## 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)	占基金资产净值比例(%)
1	230205	23国开05	40,000	4,127,381.42	9.74
2	184694	G23淄博1	30,000	3,146,126.30	7.42
3	232380008	23广州农商行二级资本债01	30,000	3,130,285.25	7.39
4	2020093	20河北银行永续债	30,000	3,103,187.67	7.32
5	138977	23恒信Y1	30,000	3,091,076.71	7.29

## 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

本集合计划本报告期末无股指期货投资。

## 10、报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明

## (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为主要目的，结合现券市场与国债期货市场的流动性、基差水平等情况，通过国债期货进行相应套期保值操作。

(2) 报告期末本集合计划投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/ 卖)	合约市 值(元)	公允价值变 动(元)	风险指标说明
T2312	10年期国债期 货2312合约	-2	-2,035, 600.00	-5,366.67	-
公允价值变动总额合计(元)					-5,366.67
国债期货投资本期收益(元)					-1,198.09
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-5,366.67

(3) 本期国债期货投资评价

本集合计划通过对国债期货的投资对投资组合进行套期保值操作，调节组合的整体久期和 DV01 水平，适度调整风险敞口以降低利率波动风险对基金的影响。本报告期内，本集合计划投资国债期货符合既定的投资政策和投资目的。

11、投资组合报告附注

(1) 本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，广州农村商业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情形。

本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本报告期内未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	70,607.41
2	应收证券清算款	479,885.51
3	应收股利	10,247.38
4	应收利息	-
5	应收申购款	35.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	76,721.30
8	其他	-

9	合计	637,497.57
---	----	------------

## (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113042	上银转债	218,136.58	0.51
2	110088	淮22转债	123,654.29	0.29
3	110073	国投转债	123,257.46	0.29
4	113021	中信转债	116,488.86	0.27
5	113061	拓普转债	112,471.64	0.27
6	132026	G三峡EB2	112,033.42	0.26
7	110059	浦发转债	108,815.66	0.26
8	110077	洪城转债	86,701.89	0.20
9	127056	中特转债	83,373.45	0.20
10	110091	合力转债	81,851.00	0.19
11	127040	国泰转债	79,765.96	0.19
12	113049	长汽转债	79,125.73	0.19
13	110089	兴发转债	78,261.63	0.18
14	123035	利德转债	76,702.91	0.18
15	110075	南航转债	75,780.59	0.18
16	110081	闻泰转债	75,386.80	0.18
17	110062	烽火转债	74,122.92	0.17
18	113052	兴业转债	72,237.66	0.17
19	127018	本钢转债	61,144.42	0.14
20	113047	旗滨转债	59,901.34	0.14
21	113053	隆22转债	58,332.89	0.14
22	110064	建工转债	57,152.82	0.13
23	110047	山鹰转债	56,899.77	0.13
24	113631	皖天转债	56,631.31	0.13
25	113054	绿动转债	54,200.95	0.13
26	110067	华安转债	52,175.22	0.12
27	113056	重银转债	51,906.21	0.12
28	127007	湖广转债	49,804.62	0.12
29	123048	应急转债	49,323.23	0.12
30	113051	节能转债	48,601.47	0.11
31	113024	核建转债	45,883.98	0.11

32	128136	立讯转债	44,480.75	0.10
33	127030	盛虹转债	43,101.19	0.10
34	113045	环旭转债	40,917.40	0.10
35	128129	青农转债	40,814.66	0.10
36	110093	神马转债	35,267.41	0.08
37	127005	长证转债	32,718.40	0.08
38	128034	江银转债	32,277.00	0.08
39	113641	华友转债	31,788.00	0.08
40	113516	苏农转债	27,784.44	0.07
41	110048	福能转债	25,519.44	0.06
42	110085	通22转债	23,700.40	0.06
43	127016	鲁泰转债	22,612.64	0.05
44	113616	韦尔转债	22,606.07	0.05
45	127017	万青转债	22,594.63	0.05
46	110083	苏租转债	22,050.31	0.05
47	127049	希望转2	21,860.39	0.05
48	113046	金田转债	21,688.40	0.05
49	127028	英特转债	20,752.50	0.05
50	113060	浙22转债	18,762.37	0.04
51	113050	南银转债	17,057.42	0.04
52	127064	杭氧转债	14,851.40	0.04
53	127020	中金转债	13,096.50	0.03
54	127039	北港转债	12,719.05	0.03
55	127006	敖东转债	12,601.08	0.03
56	123107	温氏转债	12,418.26	0.03
57	110079	杭银转债	11,639.87	0.03
58	113043	财通转债	11,279.59	0.03
59	123108	乐普转2	11,231.18	0.03
60	127025	冀东转债	10,660.83	0.03
61	113017	吉视转债	10,635.90	0.03
62	113065	齐鲁转债	10,284.97	0.02
63	110061	川投转债	8,979.23	0.02
64	127012	招路转债	6,381.46	0.02
65	113066	平煤转债	6,345.80	0.01

66	113055	成银转债	6,231.22	0.01
67	113044	大秦转债	5,887.01	0.01
68	128048	张行转债	5,850.49	0.01
69	127014	北方转债	4,038.17	0.01
70	110045	海澜转债	3,834.26	0.01
71	110043	无锡转债	2,169.23	0.01

(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。

## 第十一部分 集合计划的业绩

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

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

本集合计划资产管理合同生效日为2021年9月16日，集合计划业绩截止日为2023年9月30日。

一、本报告期集合计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较：

方正鑫悦一年持有债券A净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.77%	0.18%	-0.65%	0.14%	-0.12%	0.04%
过去六个月	-1.18%	0.21%	-0.72%	0.14%	-0.46%	0.07%
过去一年	-1.65%	0.19%	0.65%	0.16%	-2.30%	0.03%
自基金合同生效起至今	1.93%	0.17%	-1.94%	0.18%	3.87%	-0.01%

方正鑫悦一年持有债券C净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.87%	0.18%	-0.65%	0.14%	-0.22%	0.04%
过去六个月	-1.37%	0.21%	-0.72%	0.14%	-0.65%	0.07%
过去一年	-2.04%	0.19%	0.65%	0.16%	-2.69%	0.03%

自基金合同生效起至今	1.27%	0.17%	-2.01%	0.18%	3.28%	-0.01%
------------	-------	-------	--------	-------	-------	--------

注：基金合同生效日为2021年09月16日，方正鑫悦一年持有债券C自2021年10月11日起开放申购和赎回业务。

二、自基金合同生效以来基金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

方正鑫悦一年持有债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



方正鑫悦一年持有债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图





## 第十二部分 集合计划的财产

### 一、集合计划资产总值

集合计划资产总值是指集合计划拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、集合计划应收款项及其他资产的价值总和。

### 二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

### 三、集合计划财产的账户

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

### 四、集合计划财产的保管和处分

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

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

## 第十三部分 集合计划资产估值

### 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、国债期货合约、债券、资产支持证券、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

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

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

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

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

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

### 四、估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（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减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；

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

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

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、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，应当以集合计划估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

6、本集合计划投资国债期货合约，一般以期货合约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、本集合计划投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。

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

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

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

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

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

值信息的计算结果对外予以公布。由此给集合计划持有人和集合计划资产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，由集合计划管理人负责赔付。

## 五、估值程序

(1) 各类集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，该类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。集合计划管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

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

(2) 集合计划管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但集合计划管理人根据法律法规或资产管理合同的规定暂停估值时除外。集合计划管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将集合计划份额净值结果发送集合计划托管人，经集合计划托管人复核无误后，由集合计划管理人依据资产管理合同和相关法律法规的规定对外公布。

## 六、估值错误的处理

集合计划管理人和集合计划托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当任一类集合计划份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为集合计划份额净值错误。

资产管理合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失（“受损方”），则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内

对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方。

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 错误偏差达到该类集合计划份额净值的 0.25%时，集合计划管理人应当通报集合计划托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类集合计划份额净值的 0.5%时，集合计划管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

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

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

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

4、法律法规、中国证监会和资产管理合同认定的其他情形。

## 八、集合计划净值的确认

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

## 九、特殊情况的处理

1、集合计划管理人或集合计划托管人按“四、估值方法”的第8项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、登记结算公司等发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非集合计划管理人与集合计划托管人原因，集合计划管理人和集合计划托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的集合计划资产估值错误，集合计划管理人和集合计划托管人免除赔偿责任。但集合计划管理人、集合计划托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### 十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

## 第十四部分 集合计划的收益与分配

### 一、集合计划利润的构成

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

### 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、收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年可根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《资产管理合同》生效不满3个月可不进行收益分配。

2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为**相应类别**集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红。

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

4、由于本集合计划A类计划份额不收取销售服务费，而C类计划份额收取销售服务费，各集合计划份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划**同一类别**的每一集合计划份额享有同等分配权。

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不影响投资者利益的情况下，集合计划管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计

划收益分配原则，此项调整不需要召开集合计划份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介和集合计划管理人网站公告。

#### 四、收益分配方案

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

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

#### 六、集合计划收益分配中发生的费用

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

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

## 第十五部分 集合计划费用与税收

### 一、集合计划费用的种类

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

## 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、集合计划管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.6%的年费率计提。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提，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据管理人的指令于次月前5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

### 2、集合计划托管人的托管费

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

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划托管费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据管理人的指令于次月前5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

3、销售服务费用用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。本集合计划A类计划份额不收取销售服务费，C类计划份额的销售服务费年费率为0.4%。C类计划份额的销售服务费按前一日C类计划份额的集合计划资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H为C类计划份额每日应计提的销售服务费

E为C类计划份额前一日的集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由管理人向托管人发送销售服务费划款指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

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

## 三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

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



产的损失；

- 2、集合计划管理人和集合计划托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；
- 3、《资产管理合同》生效前的相关费用，根据原《方正金泉友2号集合资产管理计划集合资产管理合同》的约定执行；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目。

#### 四、实施侧袋机制期间的集合计划费用

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

#### 五、集合计划税收

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

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

## 第十六部分 集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

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

### 二、集合计划的年度审计

1、集合计划管理人聘请与集合计划管理人、集合计划托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本集合计划的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得集合计划管理人同意。

3、集合计划管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报集合计划托管人。更换会计师事务所需在2日内在规定媒介公告。

## 第十七部分 集合计划的信息披露

一、本集合计划的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《资产管理合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的披露内容、披露方式、登载媒介、报备方式等规定发生变化时，本集合计划从其最新规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他集合计划管理人、集合计划托管人或者集合计划销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性文字；
- 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、集合计划特性、风险揭示、信息披露及集合计划份额持有人服务等内容。

3、集合计划产品资料概要是集合计划招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的集合计划概要信息。集合计划管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新集合计划产品资料概要。

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，集合计划管理人应当在三个工作日内，更新集合计划招募说明书和集合计划产品资料概要，并登载在规定网站上，其中集合计划产品资料概要还应当登载在集合计划销售机构网站或营业网点；集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要其他信息发生变更的，集合计划管理人至少每年更新一次。

集合计划终止运作的，除资产管理合同另有约定外，集合计划管理人可以不再更新集合计划招募说明书和集合计划产品资料概要。

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

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

（二）集合计划份额净值和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，集合计划管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

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

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

（三）集合计划份额申购、赎回价格

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

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）

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

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

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

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

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

#### （五）临时报告

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

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

- 1、集合计划份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《资产管理合同》终止、集合计划清算；
- 3、转换集合计划运作方式、集合计划合并；
- 4、更换集合计划管理人、集合计划托管人；
- 5、集合计划管理人委托集合计划服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，集合计划托管人委托集合计划服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；
- 6、集合计划管理人、集合计划托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、集合计划管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人；
- 8、集合计划管理人高级管理人员、集合计划投资经理和集合计划托管人专门托管部门负责人发生变动；
- 9、集合计划管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十；
- 10、集合计划管理人、集合计划托管人专门托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及大集合计划管理业务、大集合计划财产、大集合计划托管业务的重大诉讼或仲裁；

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

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

14、集合计划收益分配事项，但资产管理合同另有约定的除外；

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

16、任一类集合计划份额净值估值错误达该类集合计划份额净值百分之零点五；

17、集合计划改聘会计师事务所；

18、更换集合计划份额登记机构；

19、本集合计划开始办理申购、赎回；

20、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；

21、本集合计划连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

22、发生涉及集合计划申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

23、集合计划管理人采用摆动定价机制进行估值时；

24、本集合计划暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

25、调整本集合计划的份额类别设置；

26、集合计划推出新业务或服务；

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

#### （六）澄清公告

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

#### （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）投资资产支持证券的信息披露

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

集合计划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。

#### （九）投资港股通标的股票的信息披露

集合计划管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件

中披露港股通标的股票的投资情况。若中国证监会对公开募集证券投资基金投资港股通标的股票的信息披露另有规定的，从其规定。

#### （十）投资国债期货的信息披露

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

#### （十一）清算报告

资产管理合同终止的，集合计划管理人应当依法组织集合计划财产清算小组对集合计划财产进行清算并作出清算报告。集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### （十二）实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### （十三）中国证监会规定的其他信息

### 六、信息披露事务管理

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

集合计划管理人、集合计划托管人应加强对未公开披露集合计划信息的管控，并建立集合计划敏感信息知情人登记制度。集合计划管理人、集合计划托管人及相关从业人员不得泄露未公开披露的集合计划信息。

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

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

集合计划管理人、集合计划托管人应当在规定报刊中选择披露信息的报刊，单只集合计划只需选择一家报刊。

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

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，集合计划管理人应当自中国证监会规定之日起，按照中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息。

集合计划管理人、集合计划托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响集合计划正常投资操作的前提下，

自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从集合计划财产中列支。

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

## 七、信息披露文件的存放与查阅

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

## 八、暂停或延迟集合计划净值信息披露的情形

- 1、集合计划投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使集合计划管理人、集合计划托管人无法准确评估集合计划资产价值时；
- 3、法律法规、中国证监会或《资产管理合同》认定的其他情形。

# 第十八部分 侧袋机制

## 一、侧袋机制的实施条件和程序

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

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

## 二、实施侧袋机制期间集合计划份额的申购与赎回

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

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

3、除管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“集合计划份额的申购、赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过上一开放日主袋账户总份额的10%认定。

### 三、实施侧袋机制期间的集合计划投资

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

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

管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### 四、实施侧袋机制期间的集合计划估值

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

### 五、实施侧袋账户期间的集合计划费用

- 1、本集合计划实施侧袋机制的，管理费和托管费按主袋账户集合计划资产净值作为基数计提。
- 2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费。

### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

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

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

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



## 七、侧袋机制的信息披露

### 1、临时公告

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

### 2、集合计划净值信息

管理人应按照招募说明书“集合计划的信息披露”部分规定的集合计划净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。实施侧袋机制期间本集合计划暂停披露侧袋账户份额净值和累计净值。

### 3、定期报告

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

## 第十九部分 风险揭示

### 一、市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使本集合计划资产面临潜在的风险，本集合计划的市场风险来源于集合计划持有的资产市场价格的波动，市场风险主要来源于：

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策的变化对资本市场产生一定的影响，导致市场价格波动，影响集合资产管理计划的收益而产生风险。

#### 2、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合资产管理计划收益水平随之发生变化，从而产生风险。

#### 3、购买力风险

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

#### 4、债券收益率曲线变动风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分

反映这一风险的存在。

#### 5、再投资风险

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

#### 6、经济周期风险

随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，集合计划投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

#### 7、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等都会导致公司盈利发生变化。如果本集合计划所投资的上市公司盈利下降，其股票价格可能会下跌，或能够用于分配的利润减少，导致本集合计划投资收益减少。虽然，本集合计划可以通过多样化投资来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

## 二、流动性风险

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

### 1、集合计划申购、赎回安排

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

### 2、拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

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

### 3、巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

### 4、实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

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

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

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

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

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

### 三、信用风险

信用风险主要指债券、资产支持证券等信用证券发行主体信用状况恶化，导致信用评级下降甚至到期不能履行合约进行兑付的风险，另外，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。

### 四、管理风险

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

### 五、本集合计划特有风险

1、本集合计划为债券型集合计划，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金和股票型集合资产管理计划。

2、本集合计划投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。集合计划管理人将本着谨慎和控制风险的原

则进行资产支持证券投资，请集合计划份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的集合计划净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

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

4、本集合计划A类或C类计划份额每个开放日开放申购，但本集合计划持有人持有的A类或C类计划份额均设置一年的锁定持有期。在锁定持有期内，A类或C类计划份额不能赎回；自锁定持有期到期后的下一个工作日起（含该日），A类或C类计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。

5、本集合计划投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对集合计划的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体而言：

#### （1）汇率风险

本集合计划以人民币募集和计价，但本集合计划可通过港股通投资香港证券市场。港币相对于人民币的汇率变化将会影响本集合计划以人民币计价的计划资产价值，从而导致本集合计划资产面临潜在风险。人民币对港币的汇率的波动也可能加大集合计划净值的波动，从而对本集合计划业绩产生影响。

此外，由于本集合计划运作中的汇率取自汇率发布机构，如果汇率发布机构出现汇率发布时间延迟或是汇率数据错误等情况，可能会对本集合计划运作或者投资者的决策产生不利影响。

#### （2）香港市场风险

与内地A股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，港股价格与海外资金流动表现出高度相关性，本集合计划在参与港股市场投资时受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统风险相对更大。加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在，港股股价受到意外事件影响可能表现出比A股更为剧烈的股价波动。

#### （3）香港交易市场制度或规则不同带来的风险

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

1) 港股市场实行T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，因此每日涨跌幅空间相对较大；

2) 只有内地与香港均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日；

3) 香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所规定的其他情形时，香港联合交易所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现上海证券交易所和深圳证券交易所的证券交易服务公司认定的交易异常情况时，证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服

务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

#### 4) 交收制度带来的本计划流动性风险

通过港股通机制投资香港市场，基于两地市场交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本集合计划可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险，同时也存在不能及时调整本集合计划资产组合中A股和港股投资比例，造成比例超标的风险。

#### 5) 香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联合交易所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地A股市场的停牌制度，香港联合交易所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与A股市场存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记(例如，ST及\*ST等标记)以警示投资者风险的做法不同，在香港联合交易所市场没有风险警示板，香港联合交易所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得香港联合交易所上市公司的退市情形较A股市场相对复杂。因该等制度性差异，本计划可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给本集合计划带来损失的风险。

#### (4) 港股通制度限制或调整带来的风险

现行的港股通规则存在若干交易限制，该等限制可能在一定程度上带来本计划投资收益的不确定性，所持港股不能及时卖出带来一定的流动性风险，资产估值出现波动增大的风险，以及现行的港股通规则调整所带来的相应风险。

### 6、本集合计划可投资国债期货，主要面临的风险有：

#### (1) 流动性风险

本集合计划在国债期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

#### (2) 基差风险

基差是指现货价格与期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本集合计划投资产生影响。

#### (3) 合约展期风险

若本集合计划所持有的国债期货合约临近交割期限需要向较远月份的合约进行展期时，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

#### (4) 保证金不足风险

由于国债期货价格朝不利方向变动，导致期货保证金账户的资金低于金融期货交易所、期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，直接影响本集合计划投资策略的实现和收益水平，从而产生风险。

#### (5) 衍生品杠杆风险

国债期货作为金融衍生品的投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本集合计划可能承受超出保证金甚至本集合计划资产本金的损失。

7、本集合计划可投资存托凭证，存托凭证由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。本集合计划可投资存托凭证，集合计划净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外交易机制相关的风险可能直接或间接成为本集合计划风险。

(1) 存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但并不能等同于直接持有境外基础证券，存托凭证与基础证券所代表的权利在范围和行使方式等方面的存在差异。同时，存托凭证具有证券交易普遍存在的宏观经济风险、政策风险、市场风险、不可抗力风险。

(2) 存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、发行主体和存托人可能对存托协议作出修改、更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。

(3) 存托凭证存续期间，对应的基础证券等财产可能出现被质押、挪用、司法冻结、强制执行等情形，本集合计划可能存在失去应有权利的风险。

(4) 若存托凭证退市，本集合计划可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券、本集合计划持有的存托凭证无法转到境内其他市场进行公开交易或者转让、存托人无法继续按照存托协议的约定提供相应服务等风险。

(5) 境外基础证券发行人在境外注册设立，适用境外注册地公司法等法律法规的规定以及境外上市地相关规则。本集合计划可能需要承担跨境行使权利或者维护权利的成本和负担。同时，本集合计划参与存托凭证享有的权益可能受境外法律变化影响。

(6) 境外基础证券发行人可能仅在境内市场发行并上市较小规模的存托凭证，公司大部分或者绝大部分的表决权由境外股东等持有；另外若发行人设置投票权差异安排的，投资者投票权利也可能存在较大差异。本集合计划可能无法实际参与公司重大事务的决策。

(7) 境外基础证券发行人如果采用协议控制架构，可能由于法律、政策变化带来合规、经营等风险，可能面临对境内实体运营企业重大依赖、协议控制架构下相关主体违约等风险。

(8) 境外基础证券发行人决定分红后，将有换汇、清算等程序，可能导致本集合计划取得分红派息时间较境外有所延迟。同时，延迟期间的汇率波动，也可能导致本集合计划实际取得分红派息与境外投资者存在一定差异。分红派息还可能因外汇管制、注册地法规政策等发生延迟或税费。

(9) 本集合计划无法直接作为境外基础证券发行人境外注册地或者境外上市地的投资者，依据当地法律制度提起证券诉讼。

(10) 存托凭证和境外基础证券分别在境内和境外上市，由于境内外市场的交易时差和交易制度的差异，存托凭证的交易价格可能受到境外市场开盘价或者收盘价的影响，从而出现大幅波动。

(11) 存托凭证首次公开发行的价格可能高于境外基础证券的发行价格或者二级市场交易价格，境外基础证券的交易价格也可能因基本面变化、第三方研究报告观点、境内外交易机制差异、异常交易情形、做空机制等出现较大波动，影响境内存托凭证价格；因境内外市场股权登记日、除权除息日的不同，境内外证券在除权除息日也可能出现较大价格差异。

(12) 在境内法律及监管政策允许的情况下，境外基础证券可能转移至境内市场上市交易，或者

公司实施配股、非公开发行、回购等行为，从而增加或者减少境内市场的存托凭证流通数量，可能引起存托凭证交易价格波动。

(13) 境内外市场证券停复牌制度存在差异，存托凭证与境外基础证券可能出现在一个市场正常交易而在另一个市场实施停牌等现象。

8、本集合计划A类计划份额、C类计划份额合并运作，但不同份额销售费用收取方式不同，此等安排可能导致两类份额的份额净值、集合计划份额持有人收益不相同。

## 六、其它风险

### 1、操作风险

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

### 2、技术风险

在开放式集合计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自集合计划管理人、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。

### 3、法律风险

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

### 4、其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致集合计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管行违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或者集合计划份额持有人利益受损。

## 第二十部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算

### 一、《资产管理合同》的变更

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

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

### 二、《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

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

### 三、集合计划财产的清算

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

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

- (1) 《资产管理合同》终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管集合计划；
- (2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对集合计划财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

### 四、清算费用

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

### 五、集合计划财产清算剩余资产的分配

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



## 六、集合计划财产清算的公告

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

## 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

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

# 第二十一部分 资产管理合同的内容摘要

## 一、资产管理合同当事人及其权利义务

### （一）集合计划管理人的权利与义务

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

- （1）依法募集资金；
- （2）自资产管理合同生效之日起，根据法律法规和《资产管理合同》独立运用并管理集合计划财产；
- （3）依照《资产管理合同》收取集合计划管理费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集合计划托管人，如认为集合计划托管人违反了《资产管理合同》及国家有关法律的规定，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）在集合计划托管人更换时，提名新的集合计划托管人；
- （8）选择、更换集合计划销售机构，对集合计划销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）担任或委托其他符合条件的机构担任集合计划登记机构办理集合计划登记业务并获得《资产管理合同》规定的费用；
- （10）依据《资产管理合同》及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；
- （11）在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请；
- （12）依照法律法规为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利；
- （13）在法律法规允许的前提下，为集合计划的利益依法为集合计划进行融资；
- （14）以集合计划管理人的名义，代表集合计划份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法

律行为；

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

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关集合计划申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和定期定额投资等业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

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

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

(2) 办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受集合计划托管人的监督；

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

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

(17) 确保需要向集合计划投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够

按照《资产管理合同》规定的时间和方式，随时查阅到与集合计划有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；

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

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

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

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

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

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

(24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## (二) 集合计划托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

(6) 在集合计划管理人更换时，提名新的集合计划管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保集合计划财产的

安全，保证其托管的集合计划财产与集合计划托管人自有财产以及不同的集合计划财产相互独立；对所托管的不同的集合计划分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同集合计划之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由集合计划管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与集合计划管理人核对；

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

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

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

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

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

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

(21) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

### (三) 集合计划份额持有人

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

**同一类别**每份集合计划份额具有同等的合法权益。本集合计划 A 类计划份额与 C 类计划份额由于集合计划份额净值的不同，集合计划收益分配的金额以及参与清算后的剩余集合计划财产分配的数量将可能有所不同。

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

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

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《资产管理合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资集合计划，了解自身风险承受能力，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳集合计划申购款项及法律法规和《资产管理合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的集合计划份额范围内，承担集合计划亏损或者《资产管理合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损集合计划及其他《资产管理合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## 二、集合计划份额持有人大会

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

本集合计划份额持有人大会未设日常机构，如今后设立集合计划份额持有人大会的日常机构，按照相关法律法规的要求执行。

#### （一）召开事由

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

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

（2）更换集合计划管理人（集合计划管理人更换为本集合计划管理人独资或控股设立的子公司除外）；

（3）更换集合计划托管人；

（4）转换集合计划运作方式；

（5）调整集合计划管理人、集合计划托管人的报酬标准或提高销售服务费率；

（6）变更集合计划类别；

（7）本集合计划与其他集合计划的合并；

（8）变更集合计划投资目标、范围或策略；

（9）变更集合计划份额持有人大会程序；

（10）集合计划管理人或集合计划托管人要求召开集合计划份额持有人大会；

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

（12）对《资产管理合同》当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在法律法规规定和《资产管理合同》约定的范围内且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由集合计划管理人和集合计划托管人协商一致后修改，不需召开集合计划份额持有人大会：

（1）法律法规要求增加的集合计划费用的收取；

（2）调整本集合计划的申购费率、调低集合计划的赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式，调整集合计划份额类别设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整；

（3）因相应的法律法规发生变动而应当对《资产管理合同》进行修改；

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

- (5) 调整有关集合计划申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- (6) 集合计划推出新业务或服务；
- (7) 集合计划管理人更换为本集合计划管理人独资或控股设立的子公司；
- (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集合计划管理人召集。

2、集合计划管理人未按规定召集或不能召集时，由集合计划托管人召集。

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

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

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

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

## (三) 召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

(1) 会议召开的时间、地点和会议形式；

(2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

(3) 有权出席集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人的权益登记日；

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

- (5) 会务常设联系人姓名及联系电话；
- (6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

#### （四）集合计划份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按资产管理合同约定通知集合计划托管人（如果集合计划托管人为召集人，则为集合计划管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在集合计划托管人（如果集合计



划托管人为召集人，则为集合计划管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取集合计划份额持有人的表决意见；集合计划托管人或集合计划管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

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

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

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

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

## (五) 议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第(七)条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为集合计划管理人授权出席会议的代表，在集合计划管理人授权代表未能主持大会的情况下，由集合计划托管人授权其出席会议的代表主持；如果集合计划管理人授权代表和集合计划托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的集合计划份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上(含二分之一)选举产生一名集合计

划份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人。集合计划管理人和集合计划托管人拒不出席或主持集合计划份额持有人大会，不影响集合计划份额持有人大会作出的决议的效力。

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

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

集合计划份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。在上述规则的前提下，具体规则以召集人发布的集合计划份额持有人大会通知为准。

## （七）计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

## 2、通讯开会

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

## (八) 生效与公告

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

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

## (九) 实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。

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

### 三、资产管理合同的变更、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资产管理合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的，应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和资产管理合同约定可不经集合计划份额持有人大会决议通过的事项，由集合计划管理人和集合计划托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

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

#### （二）《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

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

#### （三）集合计划财产的清算

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

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

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

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

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 集合计划财产清算的公告

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

#### (七) 集合计划财产清算账册及文件的保存

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

### 四、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意, 因《资产管理合同》而产生的或与《资产管理合同》有关的一切争议, 如经友好协商未能解决的, 任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会, 仲裁地点为北京市, 按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的, 对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定, 仲裁费用由败诉方承担。

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

《资产管理合同》受中国法律(为本资产管理合同之目的, 不包括香港、澳门和台湾法律)管辖。

### 五、资产管理合同存放地和投资者取得资产管理合同的方式

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

## 第二十二部分 托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）集合计划管理人：

名称：方正证券股份有限公司

住所：湖南省长沙市天心区湘江中路二段 36 号华远华中心 4，5 号楼 3701-3717

办公地址：北京市朝阳区朝阳门南大街 10 号兆泰国际中心 A 座 18 层

法定代表人：施华

成立时间：1994 年 10 月 26 日

批准设立机关及批准设立文号：浙江省人民政府办公厅浙政办发 [1990] 47 号文批准

批准证券资产管理业务资格批文及文号：证监许可[2009]304 号

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品。（按经营证券期货业务许可证核定的期限和范围从事经营）（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

注册资本：82.32 亿

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

#### （二）集合计划托管人：

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

法定代表人：任德奇

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发 [1987] 40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [1998] 25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.63 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

## 二、集合计划托管人对集合计划管理人的业务监督和核查

### (一) 集合计划托管人对集合计划管理人的投资行为行使监督权

1、集合计划托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同和本协议的约定，对集合计划的投资范围、投资对象进行监督。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（含创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（含国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、证券公司发行的短期公司债券、非金融企业债务融资工具（含短期融资券、超短期融资券、中期票据））、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于可转换债券、可交换债券的比例合计不超过集合计划资产的 20%；本集合计划股票投资占集合计划资产的 0-20%，其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的 0-50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

集合计划托管人对集合计划管理人业务进行监督和核查的义务自资产管理合同生效日起开始履行。

2、集合计划托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同和本协议的约定，对集合计划投资比例进行监督。

(1) 本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于可转换债券、可交换债券的比例不超过集合计划资产的 20%；本集合计划股票投资占集合计划资产的 0-20%，其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的 0-50%；

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

(3) 本集合计划持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算，下同），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计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的大集合计划可以不受此条款规定的比例限制；

(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大集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

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

(10) 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) 本集合计划管理人管理的全部开放式大集合计划(包含开放式大集合计划以及处于开放期的采取定期开放方式运作的大集合计划)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 15%;本集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%;完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的大集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;

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

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

(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) 本集合计划总资产不得超过集合计划净资产的 140%;

(16) 本集合计划投资于国债期货的投资限制如下:

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

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

3) 本集合计划所持有的债券(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;

4) 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%;

(17) 本集合计划投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行,与境内上市交易的股票合并计算;

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资比例限制。

除上述第(2)、(9)、(13)、(14)项情形之外,因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等集合计划管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的,集合



计划管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

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

如果法律法规或监管部门对上述投资比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，则本集合计划投资不再受相关限制。

集合计划托管人依照上述规定对本集合计划的投资组合限制及调整期限进行监督。

3、集合计划托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同和本协议的约定，对集合计划投资禁止行为进行监督。集合计划财产不得用于下列投资或者活动。

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

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

在资产管理合同生效后 2 个工作日内，集合计划管理人和集合计划托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东、实际控制人或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，集合计划管理人在履行适当程序后，本集合计划可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

4、集合计划托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同和本协议的约定，对集合计划管理人参与银行间债券市场进行监督。

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

(2) 集合计划管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，集合计划管理人应当负责向相关责任人追偿。

5、集合计划托管人根据有关法律法规、资产管理合同和本协议，对集合计划管理人投资银行存款业务约定如下：

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

(2) 集合计划管理人与集合计划托管人应根据相关规定，就本集合计划银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保集合计划财产的安全，保护集合计划份额持有人的合法权益。

(3) 集合计划托管人应加强对集合计划银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

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

#### 6、集合计划托管人对集合计划投资流通受限证券的监督。

(1) 集合计划投资流通受限证券，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) 流通受限证券，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。

(3) 集合计划管理人应在集合计划首次投资流通受限证券前，向集合计划托管人提供有关集合计划投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。集合计划投资非公开发行股票，集合计划管理人还应提供流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于集合计划投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。集合计划管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至集合计划托管人，保证集合计划托管人有足够的时间进行审核。集合计划托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

(4) 集合计划投资流通受限证券前，集合计划管理人应向集合计划托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于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。集合计划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集合计划托管人，保证集合计划托管人有足够的时间进行审核。

(5) 集合计划托管人应对集合计划管理人提供的有关书面信息进行审核，集合计划托管人认为上述资料可能导致集合计划投资出现风险的，有权要求集合计划管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看集合计划管理人风险管理部门就集合计划投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，集合计划托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成集合计划财产损失的，集合计划托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如集合计划管理人和集合计划托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果集合计划托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。

7、集合计划托管人根据法律法规的规定及资产管理合同和本协议的约定，对集合计划投资其他方面进行监督。

(二)集合计划托管人应根据有关法律法规的规定及资产管理合同的约定，对集合计划资产净值计算、各类集合计划份额净值计算、应收资金到账、集合计划费用开支及收入确认、集合计划收益分配、相关信息披露等进行监督和核查。如果集合计划管理人未经集合计划托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则集合计划托管人对此不承担任何责任，并有权在发现后报告中国证监会。

(三)集合计划管理人应积极配合和协助集合计划托管人的监督和核查，在规定时间内答复并改正，就集合计划托管人的疑义进行解释或举证。对集合计划托管人按照法规要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的，集合计划管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

集合计划托管人发现集合计划管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、资产管理合同和本协议规定的行为，应及时以书面形式通知集合计划管理人限期纠正，集合计划管理人收到通知后应及时核对，并以电话或书面形式向集合计划托管人反馈，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，集合计划托管人有权随时对通知事项进行复查，督促集合计划管理人改正。集合计划管理人对集合计划托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，集合计划托管人有权报告中国证监会。

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

集合计划托管人发现集合计划管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反资产管理合同和本协议约定的，应当拒绝执行，立即通知集合计划管理人，并有权向中国证监会报告。

集合计划托管人发现集合计划管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反资产管理合同约定的，应当立即通知集合计划管理人，并有权向中国证监会报告。

### 三、集合计划管理人对集合计划托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、资产管理合同和本协议规定，集合计划管理人对集合计划托管人履行托管职责的情况进行核查，核查事项包括但不限于集合计划托管人是否安全保管集合计划财产、开立集合计划财产的资金账户、证券账户、期货账户及债券托管账户等投资所需账户，是否及时、准确复核集合计划管理人计算的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值，是否根据集合计划管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和资产管理合同规定进行相关信息披露和监督集合计划投资运作等行为。

集合计划管理人定期和不定期地对集合计划托管人保管的集合计划资产进行核查。集合计划托管人应积极配合集合计划管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供集合计划管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复并改正。

集合计划管理人发现集合计划托管人未对集合计划资产实行分账管理、擅自挪用集合计划资产、未执行或无故延迟执行集合计划管理人资金划拨指令、泄露集合计划投资信息等违反《基金法》、资产管理合同、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知集合计划托管人在限期内纠正，集合

计划托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对集合计划管理人发出回函。在限期内，集合计划管理人有权随时对通知事项进行复查，督促集合计划托管人改正。集合计划托管人对集合计划管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，集合计划管理人应报告中国证监会。对集合计划管理人按照法规要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的，集合计划托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

#### 四、集合计划财产保管

##### （一）集合计划财产保管的原则

1、集合计划托管人应安全保管集合计划财产，未经集合计划管理人的指令，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何资产。

2、集合计划财产应独立于集合计划管理人、集合计划托管人的固有财产。

3、集合计划托管人按照规定开立集合计划财产的资金账户、证券账户和债券托管账户等投资所需账户，集合计划管理人和集合计划托管人按照规定开立期货资金账户。

4、集合计划托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，确保集合计划财产的完整和独立。

5、对于因为集合计划投资产生的应收资产和集合计划申购过程中产生的应收资产，应由集合计划管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知集合计划托管人，到账日集合计划资产没有到达集合计划银行存款账户的，集合计划托管人应及时通知集合计划管理人采取措施进行催收。由此给集合计划造成损失的，集合计划管理人应负责向有关当事人追偿集合计划的损失。集合计划托管人对此不承担任何责任。

##### （二）集合计划的银行存款账户的开立和管理

1、集合计划托管人应负责本集合计划银行存款账户的开立和管理。

2、集合计划托管人以本集合计划的名义在其营业机构开立集合计划的银行存款账户，并根据集合计划管理人合法合规的指令办理资金收付。本集合计划的银行预留印鉴由集合计划托管人保管和使用。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付集合计划收益，均需通过本集合计划的银行存款账户进行。

3、本集合计划银行存款账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。集合计划托管人和集合计划管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行存款账户；亦不得使用集合计划的任何银行存款账户进行本集合计划业务以外的活动。

4、集合计划托管人可以通过申请开通本集合计划银行账户的企业网上银行进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

5、集合计划银行存款账户的管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

##### （三）集合计划证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

集合计划托管人以集合计划托管人和本集合计划联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司

开立证券账户。

集合计划证券账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。集合计划托管人和集合计划管理人不得出借和未经对方同意擅自转让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。

集合计划管理人不得对集合计划证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。集合计划证券账户资产的管理和运用由集合计划管理人负责。

集合计划托管人以集合计划托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。集合计划托管人以本集合计划的名义在集合计划托管人处开立集合计划的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

#### （四）债券托管账户的开立和管理

1、资产管理合同生效后，集合计划管理人负责向人民银行进行报备，并在备案通过后由集合计划托管人在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司以本集合计划的名义开立债券托管账户，并由集合计划托管人负责集合计划的债券及资金的清算。集合计划管理人负责申请集合计划进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由集合计划管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

2、集合计划管理人代表集合计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由集合计划管理人保存。

#### （五）国债期货的相关账户的开立和管理

集合计划管理人、集合计划托管人应当按照相关规定开立期货资金账户，在中国金融期货交易所获取交易编码。期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照规定设立。

集合计划托管人已取得期货保证金存管银行资格，集合计划管理人授权集合计划托管人办理相关银期转账业务。

#### （六）集合计划投资银行存款账户的开立和管理

存款账户必须以集合计划名义开立，账户名称为集合计划名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴（须包括集合计划托管人印章）及集合计划管理人公章。

本集合投资银行存款时，集合计划管理人应当与存款银行签订具体存款协议或存款确认单据，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式、存款到期指定收款账户等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

#### （七）其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许集合计划从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，由集合计划管理人协助集合计划托管人根据有关法律法规的规定和资产管理合同的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

#### （八）集合计划财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由集合计划托管人存放于集合计划托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由集合计划托管人根据集合计划管理人的指令办理。集合计划托管人对由集合计划托管人以外机构实际有效控制的集合计划资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由集合计划托管人负责保管。集合计划托管人只负责对存款证实书进行保管，不负责存款证实书真假的辨别，不承担存款证实书对应存款的本金及收益的安全保管责任。

#### （九）与集合计划财产有关的重大合同的保管

由集合计划管理人代表集合计划签署的与集合计划有关的重大合同的原件分别由集合计划托管人、集合计划管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，集合计划管理人在代集合计划签署与集合计划有关的重大合同时，应尽可能保证持有二份以上的正本，以便集合计划管理人和集合计划托管人至少各持有一份正本的原件，集合计划管理人应及时将正本送达集合计划托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

对于无法取得二份以上的正本的，集合计划管理人应向集合计划托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

### 五、集合计划资产净值计算和会计核算

#### （一）集合计划资产净值及集合计划份额净值的计算与复核

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。

##### 1、估值日

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

##### 2、估值对象

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

##### 3、估值原则

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

##### 4、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减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净

价进行估值；

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

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

(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) 估值计算中涉及港币对人民币汇率的，应当以集合计划估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

(6) 本集合计划投资国债期货合约，一般以期货合约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) 本集合计划投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。

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

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

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

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

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

## 5、估值程序

(1) 各类集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，该类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。集合计划管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

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

(2) 集合计划管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但集合计划管理人根据法律法规或资产管理合同的规定暂停估值时除外。集合计划管理人与托管人通过电子对账的方式完成每个工作日对集合计划资产估值，份额净值结果以电子对账核对结果为准，由集合计划管理人依据资产管理合同和相关法律法规的规定对外公布。

### (二) 净值差错处理

集合计划管理人和集合计划托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当任一类集合计划份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为集合计划份额净值错误。

资产管理合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、估值错误类型

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

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

#### 2、估值错误处理原则

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

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

(3) 因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则估值错误责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对



获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给估值错误责任方；

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 错误偏差达到该类集合计划份额净值的 0.25%时，集合计划管理人应当通报集合计划托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类集合计划份额净值的 0.5%时，集合计划管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告；

(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。

#### (三) 集合计划会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

#### (四) 集合计划账册的建立

集合计划管理人和集合计划托管人在资产管理合同生效后，应按照双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，对双方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证集合计划财产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以集合计划管理人的处理方法为准。

#### (五) 会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双方的账目存在不符的，集合计划管理人和集合计划托管人必须及时查明原因并纠正，确保核对一致。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到集合计划资产净值的计算和公告的，以集合计划管理人的账册为准，由此给计划份额持有人和计划造成的损失以及因该交易日集合计划净值信息计算顺延错误而引起的损失，由集合计划管理人承担。

#### (六) 集合计划招募说明书、定期报告的编制和复核

集合计划财务报表由集合计划管理人和集合计划托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于季度终了后 15 个工作日内完成；招募说明书的信息发生重大变更的，集合计划管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在规定网站上；招募说明书其他信息发生变更的，集合计划管理人至

少每年更新一次。集合计划终止运作的，集合计划管理人不再更新招募说明书。中期报告在集合计划会计年度前6个月结束后的两个月内公告；年度报告在会计年度结束后三个月内公告。

集合计划管理人在月初3个工作日内完成上月度报表的编制，以约定方式将有关报表提供集合计划托管人；集合计划托管人收到后在2个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面或双方约定的其他方式通知集合计划管理人。对于季度报告、中期报告、年度报告、更新招募说明书等报告，集合计划管理人和集合计划托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。集合计划托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，集合计划管理人和集合计划托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果集合计划管理人与集合计划托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，集合计划管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，集合计划托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

集合计划托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

## 六、集合计划份额持有人名册的保管

集合计划管理人可委托登记机构登记和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包括但不限于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，包括资产管理合同生效时的集合计划份额持有人名册、集合计划权益登记日的集合计划份额持有人名册、集合计划份额持有人大会权益登记日的集合计划份额持有人名册、每年最后一个交易日的集合计划份额持有人名册，由登记机构负责编制和保管，并对集合计划份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

集合计划管理人定期和不定期向集合计划托管人提供集合计划份额持有人名册。

集合计划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，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。集合计划托管人不得将所保管的集合计划份额持有人名册用于集合计划托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若集合计划管理人或集合计划托管人由于自身原因无法妥善保管集合计划份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算

### （一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对本协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与资产管理合同的规定有任何冲突。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

### （二）托管协议的终止

#### 1、资产管理合同终止；

2、集合计划托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消集合计划托管资格或因其他事由造成其他集合计划托管人接管集合计划财产；

3、集合计划管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消集合计划管理人资格或因其他事由造成其他集合计划管理人接管集合计划管理权。

4、发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

### （三）集合计划财产的清算

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

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

- （1）《资产管理合同》终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管集合计划；
- （2）对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；
- （3）对集合计划财产进行估值和变现；
- （4）制作清算报告；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- （6）将清算报告报中国证监会备案并公告；
- （7）对集合计划剩余财产进行分配。

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

#### 6、清算费用

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

#### 7、集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### 8、集合计划财产清算的公告

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

#### 9、集合计划财产清算账册及文件的保存

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

## 八、争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方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和本协议规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律（为本协议之目的，不包括香港、澳门和台湾法律）管辖。

## 第二十三部分 对集合计划份额持有人的服务

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

### 一、资料寄送

投资人更改个人信息资料，请利用以下方式进行修改：到原开立集合计划账户的销售网点，登录集合计划管理人网站进行或投资者本人致电客服中心。在从销售机构获取准确的客户地址和邮编的前提下，集合计划管理人将负责寄送集合计划投资人对账单：

集合计划管理人每年（1月份）向所有的集合计划份额持有人以书面或电子文件形式寄送一次对账单。对账单在每年（12月份）结束后的7个工作日内寄出。

由于投资者提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成对账单无法按时或准确送达。因上述原因无法正常收取对账单的投资者，敬请及时通过集合计划管理人网站网站，或拨打集合计划管理人网站客服热线查询、核对、变更您的预留联系方式。

### 二、定期定额投资计划

本集合计划可通过销售机构为投资人提供定期定额投资的服务，即投资人可通过固定的渠道，采用定期定额的方式申购集合计划份额。定期定额投资不受最低申购金额限制，具体实施时间和业务规则将在本集合计划开放申购赎回后公告。

### 三、集合计划转换

集合计划管理人可以根据相关法律法规以及资产管理合同的规定，在条件成熟的情况下提供本集合计划与集合计划管理人管理的其他集合计划之间的转换服务。集合计划转换可以收取一定的转换费，相关规则由集合计划管理人届时根据相关法律法规及资产管理合同的规定制定并公告。

### 四、电话查询服务

集合计划管理人免长途费客服专线95571, 为客户提供安全高效的电话自助语音或人工查询服务。

## 五、在线服务

集合计划管理人利用管理人官方网站 (<http://www.foundersc.com>) 为集合计划投资人提供网上查询、网上资讯等服务。

## 六、客户投诉和建议处理

投资人可以通过集合计划管理人提供的呼叫中心人工座席、书信、传真等渠道对集合计划管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资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。

七、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容, 请通过上述方式联系本集合计划管理人。请确保投资前, 您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

## 第二十四部分 其他应披露事项

本集合计划从2023年8月17日至2023年11月16日已连续60个工作日基金资产净值低于五千万元, 集合计划管理人已根据《资产管理合同》的约定在定期报告中予以披露并已向中国证监会派出机构报告并提出解决方案, 即在6个月内召集集合计划份额持有人大会表决终止《资产管理合同》事宜。

本集合计划的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露, 并在规定媒介上公告。

## 第二十五部分 招募说明书的存放及查阅方式

依法必须披露的信息发布后, 集合计划管理人、集合计划托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所。投资人在支付工本费后, 可在合理时间内取得上述文件复印件。

## 第二十六部分 备查文件

备查文件等文本存放在集合计划管理人、集合计划托管人的住所，投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件，资产管理合同条款及内容应以资产管理合同正本为准。

- (一) 《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》
- (二) 《方正证券鑫悦一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议》
- (三) 法律意见书
- (四) 集合计划管理人业务资格批件、营业执照
- (五) 集合计划托管人业务资格批件、营业执照
- (六) 中国证监会要求的其他文件

方正证券股份有限公司

年 月 日