
兴证证券资产管理有限公司
兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动
持有债券型集合资产管理计划
招募说明书更新
(2024 年第 1 号)

管理人：兴证证券资产管理有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司

二零二四年五月

重要提示

兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划自资产管理合同生效之日起正式变更为兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划。

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

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

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

本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平低于股票型集合资产管理计划和混合型集合资产管理计划，高于货币型集合资产管理计划及货币市场基金。

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，集合计划管理人依照法律法规及资产管理合同的约定履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体安排详见资产管理合同、本招募说明书等集合计划法律文件中关于侧袋机制的有关内容。侧袋机制实施期间，集合计划管理人将对集合计划简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户份额的申购赎回等业务。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的特定风险。

投资者在投资本集合计划之前，请仔细阅读本集合计划的招募说明书和资产管理合同，全面认识本集合计划的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。集合计划的过往业绩并不预示其未来表现。管理人管理的其他集合计划的业绩并不构成本集合计划业绩表现的保证。

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

本集合计划 A 类、C 类份额设置 30 天的滚动运作期，每个运作期到期日前，A 类、C 类份额持有人不能提出赎回申请。每个运作期到期日，A 类、C 类份额持有人可提出赎回申请。如果 A 类、C 类份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该集合计划份额进入下一个运作期。因此 A 类、C 类份额的份额持有人面临在滚动运作期内不能赎回集合资产管理计划份额的风险。本集合计划名称为兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划，但是考虑到周末、法定节假日等非工作日原因，每份 A 类、C 类份额的每个实际运作期期限或有不同，可能长于或短于 30 天。投资者应当在熟悉并了解本集合计划运作规则的基础上，结合自身投资目标、投资期限等情况审慎作出投资决策，及时行使赎回权利。

本次更新招募说明书所载内容截止至 2024 年 5 月 20 日，集合计划投资组合报告和集合计划业绩表现截止至 2024 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

目 录

第一部分 绪言	1
第二部分 释义	2
第三部分 管理人	9
第四部分 托管人	18
第五部分 相关服务机构	23
第六部分 集合计划的历史沿革	25
第七部分 集合计划的存续	26
第八部分 集合计划份额的申购与赎回	27
第九部分 集合计划的投资	42
第十部分 集合计划的业绩	53
第十一部分 集合计划的财产	56
第十二部分 集合计划资产估值	57
第十三部分 集合计划费用与税收	63
第十四部分 集合计划的收益与分配	67
第十五部分 集合计划的会计与审计	69
第十六部分 集合计划的信息披露	70
第十七部分 侧袋机制	77
第十八部分 风险揭示	81
第十九部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算	90
第二十部分 资产管理合同内容摘要	92
第二十一部分 托管协议内容摘要	118
第二十二部分 对份额持有人的服务	137
第二十三部分 其他应披露事项	139
第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式	141
第二十五部分 备查文件	142

第一部分 绪言

《兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）由兴证证券资产管理有限公司依据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106 号，以下简称“《意见》”）、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》和其他有关法律法规的规定以及《兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有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》”）编写。

本招募说明书阐述了兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划的投资目标、策略、风险、费率等与投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本招募说明书。

管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本集合计划是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本招募说明书由兴证证券资产管理有限公司负责解释。本管理人没有委托或授权任何其他人士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，并经中国证监会备案。《资产管理合同》是约定集合计划当事人之间权利、义务的法律文件。投资者自依《资产管理合同》取得份额，即成为份额持有人和《资产管理合同》的当事人，其持有份额的行为本身即表明其对《资产管理合同》的承认和接受，并按照《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。投资者欲了解份额持有人的权利和义务，应详细查阅《资产管理合同》。

第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合资产管理计划、本集合计划或集合计划：指兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划

2、管理人：指兴证证券资产管理有限公司

3、托管人：指中国工商银行股份有限公司

4、资产管理合同：指《兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》及对本集合资产管理计划资产管理合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指本集合计划管理人与托管人就本集合计划签订的《兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有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：指《兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

7、集合计划产品资料概要：指《兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有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》及其配套规则以及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会第 166 号令《关于修改部分证券期货规章的决定》修订的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

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

15、《操作指引》：指中国证监会 2018 年 11 月 28 日颁布且于同日实施的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》及颁布机关对其不时做出的修订

16、大集合产品：指管理人依据《操作指引》进行规范，经中国证监会备案的投资者人数不受 200 人限制的集合资产管理计划，并按照《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管理运作

17、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

18、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

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

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

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

22、合格境外投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构

投资者境内证券期货投资管理办法》（包括颁布机关对其不时做出的修订）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

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

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

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

26、销售机构：指兴证证券资产管理有限公司以及经中国证监会或者其派出机构注册，取得证券投资基金销售业务资格并与管理人签订了集合资产管理计划销售服务协议，办理本集合计划销售业务的机构

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

28、登记机构：指办理登记业务的机构。本集合计划的登记机构为集合计划管理人或接受管理人委托代为办理登记业务的机构

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

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

31、资产管理合同生效日：指《兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》的生效之日，《兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划资产管理合同》自同日起失效

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

33、存续期：本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年

- 34、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
- 35、T 日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日
- 36、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）
- 37、开放日：指为投资人办理份额申购、赎回或其他业务的工作日（具体以届时提前发布的公告为准）
- 38、开放时间：指开放日本集合计划接受申购、赎回或其他交易的时间段
- 39、申购：指资产管理合同生效后，投资人根据资产管理合同和招募说明书的规定申请购买集合计划份额的行为
- 40、赎回：指资产管理合同生效后，份额持有人按资产管理合同规定的条件要求将本集合计划份额兑换为现金的行为
- 41、份额转换：指份额持有人按照资产管理合同和管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有的管理人管理的、某一集合计划的份额转换为管理人管理的其他集合计划份额的行为
- 42、转托管：指份额持有人在本集合计划的不同销售机构之间实施的变更所持份额销售机构的操作
- 43、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理本集合计划申购申请的一种投资方式
- 44、巨额赎回：指本集合计划单个开放日，本集合计划净赎回申请（赎回申请份额总数加上份额转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及份额转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日本集合计划总份额的 10%
- 45、元：指人民币元
- 46、集合计划收益：指本集合计划投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用本集合计划财产带来的成本和费用的节约
- 47、集合计划资产总值：指本集合计划拥有的各类有价证券、银行存款本息、应收申购款及其他资产的价值总和
- 48、集合计划资产净值：指本集合计划资产总值减去负债后的价值

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

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

51、A 类份额：指依据资产管理合同，在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别集合计划资产中计提销售服务费，且设定 30 天滚动持有期的集合计划的份额类别

52、B 类份额：指在本集合计划存续期间，只开放赎回，不开放申购，不从本类别集合计划资产中计提销售服务费和固定管理费，且不设定 30 天滚动有期的集合计划份额类别。投资者依据原《兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划份额，自资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合计划 B 类份额

53、C 类份额：指依据资产管理合同，在投资者申购时不收取申购费用，但从本类别集合计划资产中计提销售服务费，且设定 30 天滚动持有期的集合计划份额类别

54、运作期起始日：对于每份 A 类、C 类份额，第一个运作期起始日指该集合计划份额申购确认日；对于每份 A 类、C 类份额的红利再投资份额，第一个运作期起始日为红利再投资确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份 A 类、C 类份额的下一运作期起始日，指该份额上一运作期到期日的下一工作日；对于上一运作期到期日未赎回的每笔 A 类、C 类份额红利再投资份额的下一运作期起始日，指该红利再投资份额上一运作期到期日的下一工作日

55、运作期到期日：对于每份 A 类、C 类份额，第一个运作期到期日指自该笔集合计划份额申购确认日起（含当日，下同）的第 30 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日，下同），第二个运作期到期日指自该笔份额申购确认日起（含当日，下同）的第 30×2 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日，下同），以此类推；每份 A 类、C 类份额的红利再投资份额的第一个运作期到期日指自该笔红利再投资份额确认日起（含当日，下同）的第 30 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日，下同），第二个运作期到期日为自该笔红利再投资份额确认日起（含当日，下同）的第 30×2 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日，

下同），以此类推

示例：如某投资者于 2021 年 8 月 18 日（周三）申购本集合计划 A 类或 C 类份额，该笔份额第一个运作期起始日为 2021 年 8 月 19 日（周四）；第一个运作期到期日为 2021 年 9 月 17 日（周五），投资者可于该日办理该笔份额的赎回申请。对于未于当日赎回的份额，第二个运作期起始日遇周末顺延至 2021 年 9 月 20 日（周一），第二个运作期到期日遇周末顺延至 2021 年 10 月 18 日（周一），投资者可于该日办理该笔份额的赎回业务，以此类推

如某投资者于 2021 年 9 月 3 日（周五）申购本集合计划 A 类或 C 类份额，该笔份额第一个运作期起始日遇周末顺延至 2021 年 9 月 6 日（周一）；第一个运作期到期日遇节假日顺延至 2021 年 10 月 8 日（周五），投资者可于该日办理该笔份额的赎回申请。对于未于当日赎回的份额，第二个运作期起始日遇周末顺延至 2021 年 10 月 11 日（周一），第二个运作期到期日为 2021 年 11 月 4 日（周四），投资者可于该日办理该笔份额的赎回业务，以此类推

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

57、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

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

59、不可抗力：指资产管理合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

60、侧袋机制：指将集合计划投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个

专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

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

第三部分 管理人

一、管理人概况

名称：兴证证券资产管理有限公司

住所：福建省平潭县金井镇天山北路 3 号金井湾商务营运中心 6 栋 15 层 110 室

办公地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 9 楼

成立时间：2014 年 6 月 9 日

法定代表人：孙国雄

批准设立机关及批准设立文号：证监许可[2014]145 号

注册资本：8 亿元

电话：021-38565866

传真：021-68581323

客服电话：95562-3

网址：<http://www.ixzzcgl.com/>

联系人：高丹丹

二、主要人员情况

（一）董事会成员

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

徐翔，兴证证券资产管理有限公司董事、总裁。研究生学历，硕士学位。2000 年参加工作，历任上海世基投资顾问有限公司研发部分析师，国家开发银行总行

资金局交易中心交易员，德意志银行（中国）有限公司环球市场部交易员，澳新银行（中国）有限公司全球金融市场部交易总监，德意志银行（中国）有限公司环球市场部交易主管，永赢基金管理有限公司总经理助理、副总经理。

龚里，兴证证券资产管理有限公司董事、兴业证券销售交易业务总部副总经理（临时主持工作）。研究生学历，硕士学位。2010 年 7 月参加工作，历任兴业证券研究所分析师、中国人保资产管理证券研究部研究员、兴业证券研究所总经理助理、兴业证券经济与金融研究院公共服务研究中心总经理、兴业证券经济与金融研究院院长助理、兴业证券销售交易业务总部副总经理。

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

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

王国刚，兴证证券资产管理有限公司独立董事、中国人民大学财政金融学院教授。研究生学历，博士学位。1971 年参加工作，历任福建龙岩特钢厂工人，福建师范大学马列室讲师，南京大学经济系教授，中国社会科学院财贸经济研究所研究员，中国社科院金融研究所所长。

冯根福，兴证证券资产管理有限公司独立董事、国务院学位委员会第八届应用经济学学科评议组成员、西安交通大学经济与金融学院教授、博士生导师、院学术委员会委员主任、学位委员会委员。研究生学历，博士学位。1982 年参加工作，历任陕西财经学院学报编辑部主任，西安交通大学经济与金融学院院长、教授、博士生导师。

程林，兴证证券资产管理有限公司独立董事、中欧国际工商学院金融学 and 会计学系主任。研究生学历，博士学位。1996 年 9 月参加工作，历任烟台双一集团职员，美国亚利桑那大学 Eller 商学院助教，美国亚利桑那大学 Eller 商学院

会计学副教授。

（二）监事会成员

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

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

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

徐邈，兴证证券资产管理有限公司监事、兴证证券资产管理有限公司投融资业务审批部总经理。研究生学历，硕士学位。2008 年参加工作，历任兴证期货风险管理部总经理助理，兴业证券合规与风险管理部机构业务风控部机构业务风控，风险管理部投行业务风险管理部场外业务风险管理，风险管理二部股权风险管理处风险管理，兴证资管投融资业务审批部投资业务审批、副总经理。

（三）公司总裁及其他高级管理人员

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

郭贤珺，兴证证券资产管理有限公司副总裁、党委委员、纪委书记、公募业务部总经理、公募基金管理业务负责人。研究生学历，硕士学位。1996 年参加工作，历任福州福清虞阳中学教师，兴业证券网上业务部、经纪业务部营销岗，兴全基金筹备组成员，国海富兰克林基金人力资源及行政管理部总经理，兴证全球基金综合管理部总监、董秘，兴证全球基金市场部总监，兴证全球基金上海分公司总经理。

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

（四）本集合计划投资经理

吕晓威，兴证证券资产管理有限公司公募业务部公募投资经理。上海交通大学硕士。2010 年 5 月进入金融行业，曾任一德期货有限公司金融工程研究中心副总监、银河期货有限公司金融市场部投资经理及量化团队负责人、天风证券股份有限公司固定收益总部投资经理、浙江浙商证券资产管理有限公司固定收益部/FICC 部投资主办。2021 年 8 月加入兴证证券资产管理有限公司，历任固定收益部投资经理、公募投资部公募投资经理。现任公募业务部公募投资经理。2022 年 1 月 10 日起担任兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合型集合资产管理计划的投资经理，2022 年 11 月 7 日起担任兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型集合资产管理计划的投资经理，2022 年 5 月 30 日起担任本集合计划的投资经理。

（五）投资决策委员会成员

本公司公募投资决策委员会成员由以下人员组成：

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

委员：郑方镡，兴证证券资产管理有限公司总裁助理、权益投资总监、公募投资经理。

王德伦，兴证证券资产管理有限公司总裁助理、首席经济学家、资产配置总监、公募投资经理。

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

(六) 上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、管理人的职责

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

(二) 办理集合计划备案手续；

(三) 对所管理的不同集合计划财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

(四) 计算并公告集合计划资产净值，确定集合计划份额申购、赎回价格；

(五) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(六) 编制集合计划定期报告；

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

(八) 办理与集合计划财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(九) 召集集合计划份额持有人大会；

(十) 保存集合计划财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

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

(十二) 中国证监会规定的其他职责。

四、管理人的承诺

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

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

1、将管理人固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资；

- 2、不公平地对待管理人管理的不同集合计划财产；
- 3、利用集合计划财产为份额持有人以外的第三人谋取利益；
- 4、向份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
- 5、法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

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

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

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

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

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

（四）投资经理承诺

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

2、不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取不当利益；

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

4、不从事损害集合计划财产和份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、管理人的内部控制制度

(一) 公司内部控制的总体目标:

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

(二) 内部控制制度概述

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

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

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

(三) 公司完善内部控制制度应当遵循以下原则:

1、合法合规性原则。公司内控制度符合国家法律、法规、规章和各项规定。

2、全面性原则。内部控制制度涵盖公司经营管理的各个环节, 不得留有制度上的空白或漏洞。

3、审慎性原则。制定内部控制制度以审慎经营、防范和化解风险为出发点。

4、适时性原则。随着有关法律法规的调整和公司经营战略、经营方针、经营理念等内外部环境的变化及时的修改或完善内部控制制度。

5、明晰性原则。各项控制制度以防范和化解风险为出发点, 明确各项业务流程、职责权限以及风险预防和控制措施等, 避免矛盾和冲突。

(四) 公司主要内部控制制度

1、投资管理制度

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

2、会计管理制度

公司根据法律法规及业务的要求建立集合资产管理业务会计制度，对于公司管理的不同资产管理计划独立建账，独立核算；公司通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。

3、资金管理制度

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

4、合规稽核与风险管理制度

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

5、员工管理制度

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

6、信息技术制度

公司直接适用母公司兴业证券的信息技术相关制度。根据国家法律法规及日常工作需要，兴业证券制定了信息安全管理、信息技术变更管理、应急管理制度、机房安全管理制度、网站管理制度、技术服务商管理制度、数据管理制度等多项信息技术制度，使技术管理更加规范。维护工作完全按照一整套规范化的操作流程运维管理。兴业证券信息技术部下系统运行处制定了每日操作流程、周和月维护操作流程、变更管理流程、专项维护流程等。

第四部分 托管人

一、基本情况

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

二、主要人员情况

截至 2024 年 3 月，中国工商银行资产托管部共有员工 210 人，平均年龄 38 岁，99%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

三、托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFI 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2023 年 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1404 只。自 2003 年以来，本行连续二十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等

境内外权威财经媒体评选的 97 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

四、托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。从 2005 年至今共十七次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，全部获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对中国工商银行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

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

2、内部风险控制组织结构

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

3、内部风险控制原则

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

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

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

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

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

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

4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

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

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

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

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

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

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

5、资产托管部内部控制情况

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

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

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

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

五、托管人对管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规的规定，以及资产管理合同、托管协议约定，工商银行作为托管人，对集合计划的投资范围和投资对象、集合计划投资比例、集合计划投资禁止行为、集合计划参与银行间债券市场、集合计划资产净值的计算、集合计划份额净值计算、应收资金到账、集合计划费用开支及收入确定、集合计划收益分配、相关信息披露、集合计划宣传推介材料中登载集合计划业绩表现数据等进行监督和核查，其中对集合计划的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

工商银行作为托管人，发现管理人违反《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关证券法规和资产管理合同、托管协议的行为，应及时以书面形式通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对托管人发出回函确认。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。

托管人发现管理人有重大违规行为，应报告中国证监会，同时通知管理人限期纠正。

第五部分 相关服务机构

一、份额销售机构

（一）直销机构

兴证证券资产管理有限公司

地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 9 楼

客服电话：95562-3

网址：<http://www.ixzscgl.com/>

（二）其他销售机构

管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本集合计划，管理人增减或变更本集合计划的销售机构时，在管理人网站公示。

二、登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：金颖

联系人：苑泽田

电话：010-59378697

传真：010-59378839

三、出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：国浩律师（上海）事务所

办公地址：上海市静安区北京西路 968 号嘉地中心 27 层

负责人：徐晨

电话：021-52341668

联系人：周蕾

经办律师：宣伟华、周蕾

四、审计集合计划财产的会计师事务所和经办注册会计师

名称：毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 办公楼 8 层

办公地址：上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 楼

执行事务合伙人：邹俊

电话：010-85085000

联系人：蔡晓晓

经办注册会计师：黄小熠、蔡晓晓

五、其他服务机构及委托办理业务的有关情况

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

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

第六部分 集合计划的历史沿革

2012 年 10 月 15 日，中国证券监督管理委员会作出《关于核准兴业证券股份有限公司设立兴业证券金麒麟定享纯利集合资产管理计划的批复》（证监许可[2012]1319 号），核准兴业证券设立兴业证券金麒麟定享纯利集合资产管理计划。兴业证券金麒麟定享纯利集合资产管理计划自 2012 年 11 月 8 日起发行并于 2012 年 12 月 5 日成立。2014 年 6 月 27 日兴业证券金麒麟定享纯利集合资产管理计划管理人由“兴业证券股份有限公司”变更为“兴证证券资产管理有限公司”。2014 年 11 月 12 日，兴业证券金麒麟定享纯利集合资产管理计划变更为兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划。资产管理合同正式生效之日，兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划自该日起正式变更为兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划。

第七部分 集合计划的存续

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

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第八部分 集合计划份额的申购与赎回

一、集合计划的运作方式

在本集合计划存续期间，对于每份 A 类、C 类份额，设定 30 天的滚动运作期。运作期内 A 类、C 类份额不办理赎回或其他业务。每份 A 类、C 类份额可以在运作期到期日就该份额提出赎回申请。如果 A 类、C 类份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起，该份额自动进入下一个运作期。

对于每份 A 类、C 类份额，第一个运作期起始日指该集合计划份额申购确认日；对于每份 A 类、C 类份额的红利再投资份额，第一个运作期起始日为红利再投资确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份 A 类、C 类份额的下一运作期起始日，指该份额上一运作期到期日的下一工作日；对于上一运作期到期日未赎回的每笔 A 类、C 类份额红利再投资份额的下一运作期起始日，指该红利再投资份额上一运作期到期日的下一工作日。

对于每份 A 类、C 类份额，第一个运作期到期日指自该笔集合计划份额申购确认日起（含当日，下同）的第 30 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日，下同），第二个运作期到期日指自该笔份额申购确认日起（含当日，下同）的第 30×2 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日，下同），以此类推；每份 A 类、C 类份额的红利再投资份额的第一个运作期到期日指自该笔红利再投资份额确认日起（含当日，下同）的第 30 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日，下同），第二个运作期到期日为自该笔红利再投资份额确认日起（含当日，下同）的第 30×2 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日，下同），以此类推。

示例：如某投资者于 2021 年 8 月 18 日（周三）申购本集合计划 A 类或 C 类份额，该笔份额第一个运作期起始日为 2021 年 8 月 19 日（周四）；第一个运作期到期日为 2021 年 9 月 17 日（周五），投资者可于该日办理该笔份额的赎回申请。对于未于当日赎回的份额，第二个运作期起始日遇周末顺延至 2021 年 9 月 20 日（周一），第二个运作期到期日遇周末顺延至 2021 年 10 月 18 日（周一），投资者可于该日办理该笔份额的赎回业务，以此类推。

如某投资者于 2021 年 9 月 3 日（周五）申购本集合计划 A 类或 C 类份额，该笔份额第一个运作期起始日遇周末顺延至 2021 年 9 月 6 日（周一）；第一个运作期到期日遇节假日顺延至 2021 年 10 月 8 日（周五），投资者可于该日办理该笔份额的赎回申请。对于未于当日赎回的份额，第二个运作期起始日遇周末顺延至 2021 年 10 月 11 日（周一），第二个运作期到期日为 2021 年 11 月 4 日（周四），投资者可于该日办理该笔份额的赎回业务，以此类推。

在本集合计划存续期间，B 类份额只开放赎回，不开放申购，且不设定 30 天的滚动运作期。投资者依据原《兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划份额，自资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合计划 B 类份额。B 类份额持有期间自 B 类份额持有人持有原兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划份额被确认之日起连续计算。

二、申购和赎回场所

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

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

三、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

管理人在开放日办理集合计划份额的申购，在每个运作期到期日办理集合计划份额的赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或资产管理合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间详见相关公告。资产管理合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

管理人自资产管理合同生效之日起不超过 3 个月开始办理 A 类份额和 C 类份额的申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。资产管理合同剩余存续期限不足 3 个月时，本集合计划的申购届时根据管理人公告办理。

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

本集合计划每笔 A 类份额、C 类份额可以在每一个运作期到期日就该笔份额提出赎回申请。如果该笔份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则该笔份额将在该运作期到期后自动进入下一个运作期。具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。如果投资人多次申购 A 类份额或 C 类份额，则其持有的份额的运作期到期日可能不同。

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

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

四、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

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

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

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

6、管理人有权决定份额持有人持有本集合计划的最高限额和本集合计划的

总规模限额，但应最迟在新的限额实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告；

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

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

五、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

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

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

遇交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延。管理人、托管人和销售机构等不承担由此顺延造成的损失或不利后果。

3、申购和赎回申请的确认

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

则申购款项退还给投资人。

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

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

六、申购和赎回的数量限制

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

2、本集合计划不设单笔赎回份额下限。若某笔赎回导致单个交易账户最低持有份额余额少于 1 份时，管理人有权将投资人在该交易账户剩余份额一次性全部赎回。具体规定请参见招募说明书或相关公告。本集合计划不设单个投资人累计持有的集合计划份额上限。

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

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

七、申购费用和赎回费用

本集合计划根据收费方式的不同分为 A 类、B 类和 C 类份额。投资人在申

购 A 类份额时支付申购费用，但不从本类别集合计划资产中计提销售服务费。投资人申购 C 类份额不支付申购费用，但从该类别集合计划资产中计提销售服务费。B 类份额在本集合计划存续期间，只开放赎回，不开放申购，且不从该类别集合计划资产中计提销售服务费和固定管理费。本集合计划各类别份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。T 日的集合计划份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

1、申购费用

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

A 类份额申购费率如下：

申购金额 (M)	申购费率
单笔 < 100 万元	0.30%
100 万元 ≤ 单笔 < 500 万元	0.15%
单笔 ≥ 500 万元	每笔 1000 元

注：M 为申购金额

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

2、赎回费用

(1) 本集合计划 B 类份额（含红利再投资份额，下同）的赎回费率如下：

持有期限 (N)	赎回费率
0 < N < 7 日	1.5%
7 日 ≤ N	0

本集合计划对持续持有期少于 7 日的 B 类份额持有人收取的赎回费全额计入集合计划财产。

(2) 本集合计划份额的赎回费用由赎回对应类别集合计划份额的份额持有人承担，在份额持有人赎回该类集合计划份额时收取。

(3) 本集合计划对于每份 A 类、C 类份额设定 30 天的滚动运作期，对于每份 A 类、C 类份额，集合计划管理人仅在每个运作期到期日为该份额持有人办理赎回。每个运作期到期日，A 类、C 类份额持有人可提出赎回申请，不收取赎回费。

3、本集合计划的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。

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

5、管理人可以在不违反法律法规规定及资产管理合同约定的情形下根据市场情况制定集合计划促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易、移动客户端交易）等进行集合计划交易的投资者定期或不定期地开展本集合计划促销活动。在集合计划促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，管理人可以适当调低本集合计划申购费率、赎回费率，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。

八、申购份额与赎回金额的计算

（一）本集合计划申购份额的计算

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

当集合计划份额的申购费用适用比例费率时：

申购费用=申购金额/（1+申购费率）*申购费率；

净申购金额=申购金额-申购费用；

申购份额=净申购金额/申购当日（T日）集合计划份额净值。

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

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

例 1：某投资人投资 5 万元申购本集合计划 A 类份额，对应费率 0.30%，假设申购当日本集合计划 A 类份额净值为 1.0300 元，则可得到的申购份额为：

申购费用=50,000/（1+0.30%）*0.30%=149.55 元

净申购金额=50,000-149.55=49,850.45 元

申购份额=49,850.45/1.0300=48,398.50 份

即：如果投资人申购本集合计划 A 类份额，则该投资人可获得申购份额为

48,398.50 份。

例 2：假设申购当日 C 类份额净值为 1.0150 元，某投资人投资 10 万申购本集合计划 C 类份额，不收取申购费用，则可得到的 C 类份额为：

$$\text{申购份额} = 100,000.00 / 1.0150 = 98,522.17 \text{ 份}$$

即：投资人投资 10 万元申购本集合计划 C 类份额，假设申购当日 C 类份额净值为 1.0150 元，则其可获得 98,522.17 份 C 类份额。

（二）赎回金额的计算

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

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

如果投资人赎回集合计划份额，则赎回金额的计算方法如下：

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

$$\text{赎回费用} = (\text{赎回总额} - \text{业绩报酬 (如有)}) \times \text{集合计划份额赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用 (如有)} - \text{业绩报酬 (如有)}$$

例 3：某投资人赎回 1 万份本集合计划 C 类份额，持有时间为 30 天，假设申购当日集合计划 C 类份额净值是 1.0000，赎回当日集合计划 C 类份额净值是 1.2000 元，则其可得到的赎回金额为：

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

$$\text{赎回费用} = 0 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 12,000 - 0 = 12,000 \text{ 元}$$

即：投资人赎回 1 万份本集合计划 C 类份额，持有时间为 30 天，假设赎回当日本集合计划 C 类份额净值是 1.2000 元，则其可得到的赎回金额为 12,000 元。

例 4：某投资人赎回 1 万份本集合计划 B 类份额，持有时间为 180 天，对应的赎回费率为 0，假设申购当日集合计划 B 类份额净值是 1.0000，赎回当日集合计划 B 类份额净值是 1.0200 元，则持有期间年化收益率为 4.06%，该笔集合计划份额未产生业绩报酬(即为 0)，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总额} = 10,000 \times 1.0200 = 10,200 \text{ 元}$$

赎回费用=0 元

赎回金额=10,200-0-0=10,200 元

即：投资人赎回 1 万份本集合计划 B 类份额，持有时间为 180 天，假设赎回当日本集合计划 B 类份额净值是 1.0200 元，则其可得到的赎回金额为 10,200 元。

（三）本集合计划份额净值的计算

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

本集合计划份额净值计算公式如下：

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

T 日的集合计划份额净值在当天收市后计算，并在 $T+1$ 日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本集合计划各类别份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

（四）申购份额、余额的处理方式

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

（五）赎回金额的处理方式

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

九、申购和赎回的注册登记

（一）投资人申购集合计划成功后，登记机构在 $T+1$ 日为投资人增加权益并办理注册登记手续。

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

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

十、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时, 管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请:

- 1、因不可抗力导致本集合计划无法正常运转。
- 2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时, 管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市, 导致管理人无法计算当日集合计划资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有份额持有人利益时。
- 5、本集合计划资产规模过大, 使管理人无法找到合适的投资品种, 或其他可能对集合计划业绩产生负面影响, 或发生其他损害现有份额持有人利益的情形。
- 6、当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时, 经与托管人协商确认后, 管理人应当暂停接受集合计划申购申请。
- 7、管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有本集合计划份额的比例达到或者超过 50%, 或者变相规避 50%集中度的情形。
- 8、管理人、托管人、销售机构或登记机构因技术故障等异常情况导致集合计划销售系统、集合计划登记系统或集合计划会计系统无法正常运行。
- 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、8、9 项暂停申购情形之一且管理人决定拒绝或暂停接受投资人申购申请时, 管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝, 被拒绝的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时, 管理人应及时恢复申购业务的办理。

十一、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时, 管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项:

- 1、因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

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

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

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

7、法律法规规定、中国证监会认定或资产管理合同约定的其他情形。

发生上述情形之一（第 4 项除外）且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按资产管理合同的相关条款处理。份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

十二、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

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

具体分为两种情况：

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

②如果管理人认为仅支付其他投资人的赎回申请也有困难时，则对于所有投资人的赎回申请(包括单个投资人超过集合计划总份额 10% 以上的大额赎回申请和其他投资人的赎回申请)，管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日集合计划总份额的 10% 的前提下，可对其余赎回申请延期办理，具体按照上述“(2) 部分延期赎回”的约定办理。

(4) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如管理人认为有必要，可暂停接受集合计划的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支

付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内依据相关规定在规定媒介上刊登公告。

十三、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

3、如发生暂停的时间超过 1 日，管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在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。

十四、集合计划转换

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

十五、集合计划的非交易过户

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

继承是指份额持有人死亡，其持有的集合计划份额由其合法的继承人继承；捐赠指份额持有人将其合法持有的集合计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将份额持有人持有的集合计划份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供集

合计划登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按集合计划登记机构的规定办理，并按集合计划登记机构规定的标准收费。

十六、集合计划的转托管

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

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

十七、定期定额投资计划

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

十八、集合计划的冻结和解冻

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

十九、集合计划份额转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，管理人可受理份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理份额的过户登记。管理人拟受理份额转让业务的，将提前在规定媒介公告相关的业务规则，份额持有人应根据管理人届时公告的业务规则办理份额转让业务。

二十、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回

本集合计划实施侧袋机制的，本集合计划的申购和赎回安排详见本招募说明书“第十六部分 侧袋机制”章节的规定或相关公告。

二十一、集合计划份额的质押或其他业务

如相关法律法规允许登记机构办理集合计划份额的质押业务或其他集合计划业务，管理人可制定相应的业务规则并开展相关业务，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务

规则另有规定的，从其规定。

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

第九部分 集合计划的投资

一、投资目标

本集合计划在控制风险和保持较高流动性的前提下，追求集合计划资产的稳健增值。

二、投资范围

本集合计划的投资范围包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超短期融资券，中期票据、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具。

本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，但可持有因可转换债券转股和可交换债券换股形成的股票。因上述原因持有的股应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种，管理人在履行适当程序后，本集合计划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资产不低于集合计划资产的 80%。每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

三、投资策略

（一）固定收益类资产投资策略

本集合计划综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，结合国内外宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响，并在严格控制投资组合风险的前提下，对组合中股票、债券、货币市场工

具和法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他品种的投资比例进行配置和调整，力争实现集合计划资产的中长期稳健增值。

1、债券投资策略

本集合计划在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。

(1) 在久期配置方面，本集合计划将对宏观经济走势、经济周期所处阶段和宏观经济政策动向等进行研究，预测未来收益率曲线变动趋势，在力争降低集合计划净值波动的前提下适当调整债券组合的平均久期。

(2) 在类属配置方面，本集合计划将对宏观经济周期、市场利率走势、资金供求变化，以及信用债券的信用风险等因素进行分析，根据各债券类属的风险收益特征，定期对债券类属资产进行优化配置和调整，确定债券类属资产的权重。

(3) 在期限结构配置方面，本集合计划将对市场收益率曲线变动情况进行研判，运用统计和数量分析技术，确定期限结构配置策略以及各期限固定收益品种的配置比例。

(4) 在个券选择方面，对于国债、央行票据等非信用类债券，本集合计划将根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析，预测未来收益率曲线的变动趋势，综合考虑组合流动性决定投资品种；对于信用类债券，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，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的信用风险水平。

本集合计划将投资信用评级不低于 AA+ 级的信用债，其中 AA+级信用债占持仓信用债的比例为 0-50%，AAA 级信用债占持仓信用债的比例为 50%-100%。本集合计划对信用债评级的认定参考管理人选定的评级机构出具的信用评级，依据的评级机构不包括中债资信评估有限责任公司。本集合计划投资的短期融资券、超短期融资券的信用评级参照评级机构出具的主体信用评级；其他信用债的信用评级参照评级机构出具的债项信用评级，无债项信用评级的参照主体信用评级。（因集合计划份额赎回等情形导致被动超标的除外）。

2、资产支持证券投资策略

本集合计划投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策

略。自上而下投资策略指本公司在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对收益率走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本公司运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。

3、可转换债券和可交换债券投资策略

(1) 可转换债券投资策略

① 正股择优策略

紧抓可转债正股作为可转债收益来源的核心要素，选取正股基本面优质、所处行业景气向上的可转债标的，深入分析正股业绩增长、资产质量和偿债能力，平衡控制下跌风险及上涨弹性之间的关系，以期在有良好的风险收益特征下，大幅提升选中优质成长型可转债的概率，增强组合的弹性收益。

寻找价格处于债底附近和到期收益率较高，且正股具备一定弹性和中长期向好趋势的可转债标的，把握其困境反转的机会。

② 条款博弈策略

深入研究可转债发行人的转股意愿，通过提前预判回售、下修、赎回等事件，以控制信用风险为前提，抓住存在事件驱动投资机会的潜在可转债标的。

③ 转债质押策略

动态结合市场情况，结合转债及其他债券品种的可质押特性，买入并通过回购适当放大，以增强组合回报。

(2) 可交换债券投资策略

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

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

4、杠杆投资策略

本集合计划将对资金面进行综合分析的基础上，比较债券收益率和融资成

本，判断利差空间，适当运用杠杆方式来获取主动管理回报。

5、银行存款、同业存单投资策略

本集合计划根据宏观经济指标分析各类资产的预期收益率水平和预期波动率水平，并据此制定和调整资产配置策略。本集合计划将在法律法规和资产管理合同允许的范围内，以控制组合波动，谋求集合计划资产稳健增值为目标确定和调整银行存款、同业存单的投资比例。

（二）衍生产品投资策略

1、国债期货投资策略

本集合计划可投资国债期货。若本集合计划投资国债期货，将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的系统性风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

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

2、本集合计划将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许集合计划投资前述衍生工具，本集合计划将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本集合计划投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。

（三）未来，随着市场的发展和集合计划管理运作的需要，管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，履行适当程序后，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

四、投资限制

1、组合限制

本集合计划的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本集合计划投资于债券资产不低于集合计划资产的 80%；
- （2）本集合计划每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- （3）本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净

值的 10%；

(4) 本集合计划管理人管理的全部大集合产品持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，金融监督管理部门另有规定的除外；

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

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

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

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

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

(13) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(14) 本集合计划参与国债期货交易，应当遵守下列要求：在任何交易日日终，本集合计划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%；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%；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%；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；

(15) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述(2)、(9)、(11)、(12)情形之外,因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的,管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的,管理人在履行适当程序后,按变更后的规则执行。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本集合计划,管理人在履行适当程序后,则本集合计划投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护份额持有人的合法权益,集合计划财产不得用于下列投资或者活动:

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

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合集合计划的投资目标和投资策略,遵循份额持有人

利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

五、业绩比较基准

本集合计划业绩比较基准：中债综合财富（1 年以下）指数收益率*85%+一年期定期存款基准利率（税后）*15%。

中债综合财富（1 年以下）指数是中债金融估值中心有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的短期债券指数，旨在反映短期债券的整体价格和投资回报情况，本集合计划资产配置以一年内到期的信用债为主，与该指数的期限相匹配；银行一年期定期存款税后利率为中国人民银行公开发布，具有较强的权威性和市场影响力。

基于本集合计划的投资范围和投资比例限制，该业绩比较基准能够较好地反映本集合计划的风险收益特征。

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。

六、风险收益特征

本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平低于股票型集合资产管理计划和混合型集合资产管理计划，高于货币型集合资产管理计划及货币市场基金。

七、管理人代表集合计划行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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

- 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，在符合法律法规及资产管理合同的约定的前提下，集合计划管理人经与集合计划托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以启用侧袋机制。

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

侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见本招募说明书“第十六部分侧袋机制”章节的规定。

九、本集合计划投资组合报告

本投资组合报告所载数据取自兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告，投资组合报告所载数据截至 2024 年 3 月 31 日（财务数据未经审计）。

1 报告期末集合计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占集合计划总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	294,600,987.97	96.43
	其中：债券	259,762,732.85	85.03
	资产支持证券	34,838,255.12	11.40
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	9,811,991.81	3.21
	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	751,194.83	0.25

	合计		
8	其他资产	329,813.99	0.11
9	合计	305,493,988.60	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有境内股票。

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

3 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本集合计划本报告期末未持有股票。

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例（%）
1	国家债券	16,163,707.10	6.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	172,941,771.05	64.76
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	43,839,917.27	16.42
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	26,817,337.43	10.04
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	259,762,732.85	97.27

5 报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例（%）
1	1923004	19 平安财险	180,000	18,817,524.59	7.05
2	1920046	19 宁波银行二级	180,000	18,675,678.69	6.99

3	1928019	19 交通银行二级 01	180,000	18,578,754.10	6.96
4	1928022	19 兴业银行二级 01	180,000	18,576,334.43	6.96
5	1920066	19 上海银行二级	180,000	18,484,259.02	6.92

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

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例（%）
1	199070	周口 02 优	170,000	17,588,749.59	6.59
2	261646	G 恒信 2A1	80,000	8,045,972.60	3.01
3	261635	工瑞 5 优	70,000	7,037,713.70	2.64
4	260552	恒信 70A1	80,000	2,165,819.23	0.81

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国债期货交易情况说明

9.1 本期国债期货投资政策

本集合计划可投资国债期货。若本集合计划投资国债期货，将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的系统性风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

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

9.2 报告期末本集合计划投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

9.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

10 投资组合报告附注

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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到监管部门处罚。上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

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

本报告期内，本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,893.90
2	应收证券清算款	120,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	207,920.09
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	329,813.99

10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

10.5 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。

10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十部分 集合计划的业绩

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

一、 集合计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2022.5.30-2022.12.31	1.22%	0.02%	1.01%	0.01%	0.21%	0.01%
2023.1.1-2023.12.31	3.24%	0.01%	2.47%	0.01%	0.77%	0.00%
2024.1.1-2024.3.31	0.74%	0.01%	0.65%	0.01%	0.09%	0.00%

兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 B

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
2022.5.30-2022.12.31	1.40%	0.02%	1.08%	0.01%	0.32%	0.01%
2023.1.1-2023.12.31	3.54%	0.02%	2.47%	0.01%	1.07%	0.01%
2024.1.1-2024.3.31	0.81%	0.01%	0.65%	0.01%	0.16%	0.00%

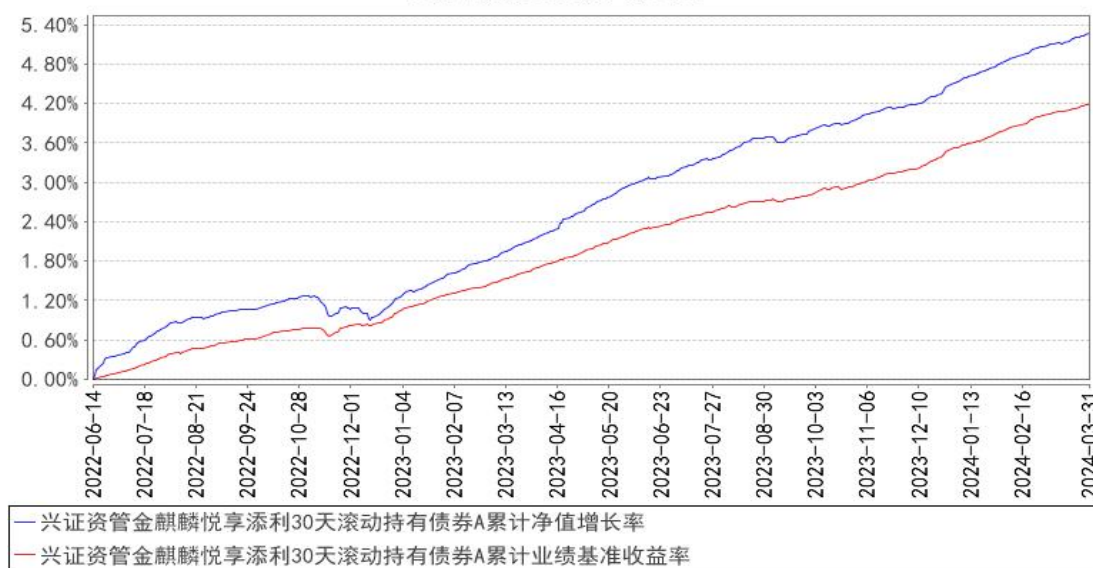
兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④

		准差②	基 准 收 益 率③	基 准 收 益 率 标 准 差 ④		
2022.5.30-2022.12.31	1.11%	0.02%	1.01%	0.01%	0.10%	0.01%
2023.1.1-2023.12.31	3.04%	0.01%	2.47%	0.01%	0.57%	0.00%
2024.1.1-2024.3.31	0.69%	0.01%	0.65%	0.01%	0.04%	0.00%

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

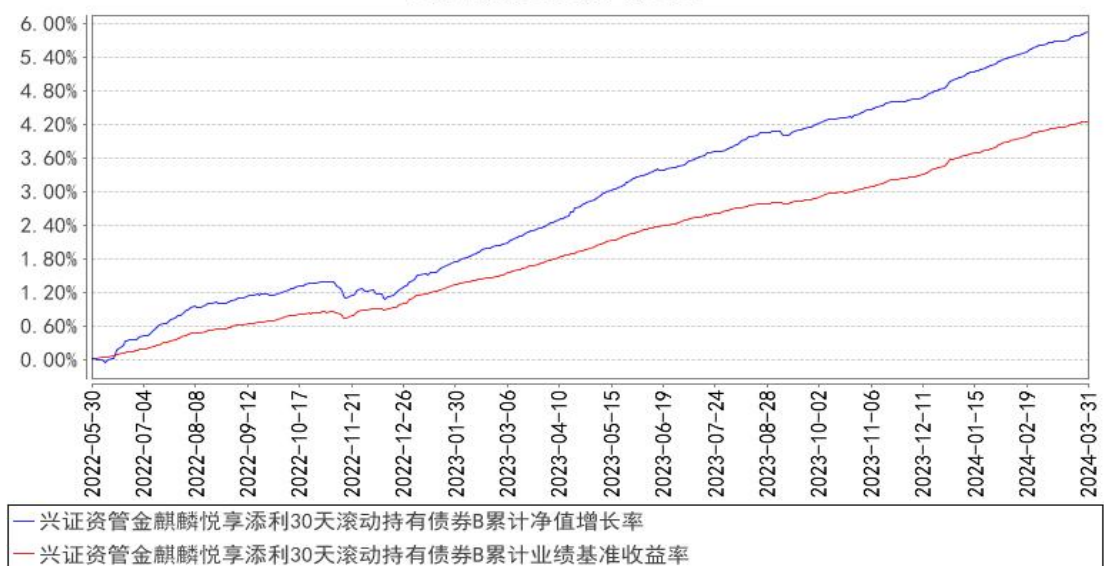
兴证资管金麒麟悦享添利30天滚动持有债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2024 年 3 月 31 日。

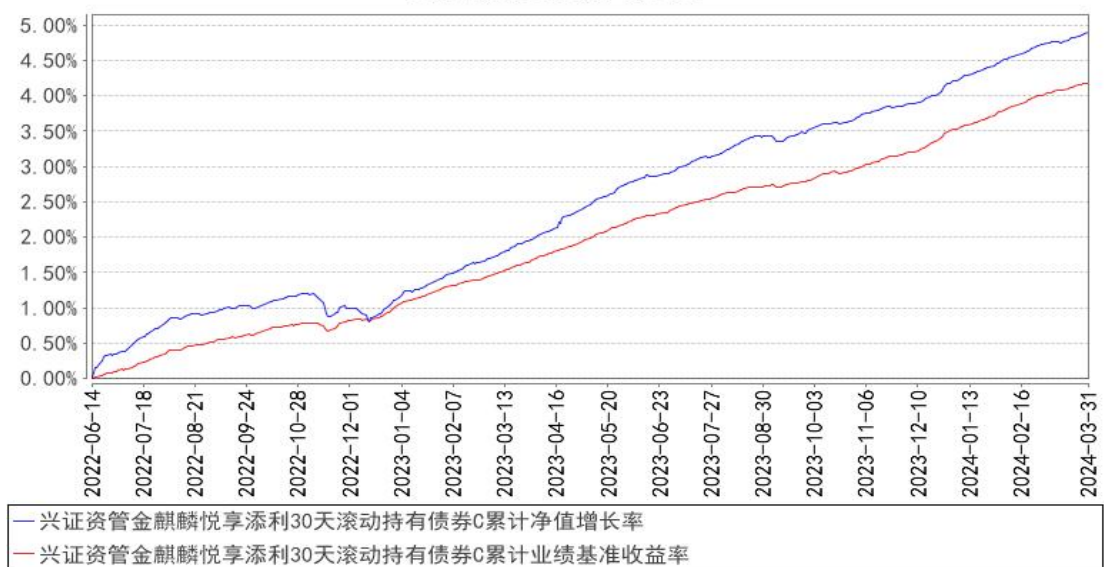
2、集合计划的过往业绩不代表未来表现。

兴证资管麒麟悦享添利30天滚动持有债券B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2024 年 3 月 31 日。
2、集合计划的过往业绩不代表未来表现。

兴证资管麒麟悦享添利30天滚动持有债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2024 年 3 月 31 日。
2、集合计划的过往业绩不代表未来表现。

第十一部分 集合计划的财产

一、集合计划资产总值

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

二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。

三、集合计划财产的账户

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

四、集合计划财产的保管和处分

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

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

第十二部分 集合计划资产估值

一、估值日

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

二、估值对象

集合计划所拥有的债券、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

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

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

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

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

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

四、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市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；

(2) 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；

(3) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

(4) 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；

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

6、国债期货合约以估值当日结算价进行估值。估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

7、银行存款、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

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見，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。

五、估值程序

1、集合计划各类别份额净值是按照每个工作日闭市后，集合计划该类别份额资产净值除以当日集合计划该类别份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

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

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

六、估值错误的处理

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

资产管理合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

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

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

（4）估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，管理人与托管人应本着平等和保护份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

七、暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4、法律法规规定、中国证监会和资产管理合同认定的其它情形。

八、集合计划净值的确认

资产净值和各类别份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的资产净值和各类别份额净值并发送给

托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。

九、特殊情况的处理

1、管理人或托管人按“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/期货交易所及登记结算公司发送的数据错误或第三方估值机构提供的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的集合计划资产估值错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

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份额净值信息，暂停披露侧袋账户的集合计划份额净值信息。

第十三部分 集合计划费用与税收

一、集合计划费用的种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、本集合计划从 C 类份额的集合计划财产中计提的销售服务费；
- 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审计费、律师费、诉讼费、仲裁费和公证费；
- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券账户等相关账户的开户费用；
- 8、集合计划的证券/期货交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、相关账户费用及其他类似性质的费用等）；
- 9、集合计划的银行汇划费用、银行账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理人的管理费

（1）固定管理费

本集合计划 A 类份额和 C 类份额的固定管理费分别按 A 类份额和 C 类份额前一日集合计划资产净值的 0.30% 年费率计提。B 类份额不收取固定管理费。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类份额的年固定管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为各类份额每日应计提的集合计划管理费

E 为各类份额前一日的集合计划资产净值

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

（2）业绩报酬

本集合计划只有 B 类份额收取业绩报酬，A 类份额和 C 类份额不收取业绩报酬。

① 业绩报酬计提原则

符合业绩报酬计提条件时，在投资者退出日或本集合计划分红日或终止日计提业绩报酬。

② 业绩报酬计提方法

业绩报酬计提日为集合计划投资人退出日或本集合计划分红日或终止日。从前一次业绩报酬计提日（若无，则为份额参与本集合计划日）至本次业绩报酬计提日，若 B 类份额年化收益率 R 小于或等于 4.2% 时，管理人不提取业绩报酬；若 B 类份额年化收益率 R 大于 4.2%，管理人对超过 4.2% 以上的部分提取 20% 作为业绩报酬。B 类份额的年化收益率的计算公式如下：

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

A = 该类份额本次业绩报酬计提日累计单位净值；

B = 该类份额上一个业绩报酬计提日（若无，则为份额参与本集合计划日）的累计单位净值；

C = 该类份额上一个业绩报酬计提日（若无，则为份额参与本集合计划日）的单位净值；

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

年化收益率 (R)	计提 比例	业绩报酬 (H) 计算方法
$R \leq 4.2\%$	0	$H = 0$
$R > 4.2\%$	20%	$H = (R - 4.2\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{N}{365}$

（其中 F 为 B 类份额参与计提业绩报酬的份额数）

如投资者退出的份额为多笔参与，则采用“先进先出”法分别对每笔参与的份额计算业绩报酬。红利再投资的参与价格为红利转份额当日份额净值。

③ 业绩报酬的支付

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，由管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令从集合计划资产中一次性支付给管理人。

2、托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

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

3、C 类份额的销售服务费

本集合计划 A 类份额与 B 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.20%。

本集合计划销售服务费按前一日 C 类份额的集合计划资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付至管理人，若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、集合计划费用的种类”中第 4—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

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

- 2、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；
- 3、《资产管理合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目。

四、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，详见本招募说明书“第十七部分 侧袋机制”章节或相关公告的规定。

五、集合计划税收

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

第十四部分 集合计划的收益与分配

一、集合计划利润的构成

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

二、集合计划可供分配利润

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

三、集合计划收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，管理人根据实际情况进行收益分配，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对应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划各类份额默认的收益分配方式是现金分红。若投资者选择现金红利转换为对应类别集合计划份额进行再投资的，再投资份额需满足对应类别份额持有期的规定。本集合计划不同份额类别份额，其分红相互独立、互不影响；投资者不同交易账户设置的分红相互独立、互不影响；

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

4、除法律法规另有规定或资产管理合同另有约定外，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；

6、由于本集合计划 A 类份额与 B 类份额不收取销售服务费，且 B 类份额不收取固定管理费，而 C 类份额收取销售服务费，各类别份额对应的可供分配利润将有所不同。

在不违反法律法规且对份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，管理人、登记机构和托管人协商一致后可对集合计划收益分配原则进行调整，不需召

开集合计划份额持有人大会。

四、收益分配方案

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

五、收益分配方案的确定、公告与实施

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，并由托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

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份额持有人的现金红利自动转为集合计划份额。红利再投资的计算方法，依照登记机构相关业务规则执行。

七、实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见本招募说明书“第十七部分 侧袋机制”章节的规定。

第十五部分 集合计划的会计与审计

一、集合计划会计政策

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

二、集合计划的年度审计

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

第十六部分 集合计划的信息披露

一、本集合计划的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《资产管理合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本集合计划从其最新规定，无需经集合计划份额持有人大会审议。

二、信息披露义务人

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

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

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

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

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

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

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

五、公开披露的集合计划信息

公开披露的集合计划信息包括：

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

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

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

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

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

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

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

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

管理人、托管人应当将《资产管理合同》、集合计划托管协议登载在网站上。

（二）集合计划净值信息

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

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

管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度

和年度最后一日集合计划各类别份额净值和份额累计净值。

（三）集合计划份额申购、赎回价格

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

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

管理人应当在每年结束之日起 3 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。

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。

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。

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

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

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

（五）临时报告

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

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

- 1、集合计划份额持有人大会的召开；
- 2、《资产管理合同》终止、集合计划清算；
- 3、转换集合计划运作方式、集合计划合并；
- 4、更换管理人、托管人、集合计划份额登记机构、集合计划改聘会计师事务所；
- 5、管理人委托服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；
- 6、管理人、托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更管理人的实际控制人；
- 8、管理人高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门公募证券投资基金（含大集合产品）托管部门负责人发生变动；
- 9、管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十；
- 10、管理人、托管人专门公募证券投资基金（含大集合产品）托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 11、涉及集合计划财产、集合计划管理业务、集合计划托管业务的诉讼或仲裁；
- 12、管理人或其高级管理人员、集合计划投资经理因集合计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，托管人或其专门公募证券投资基金托管部门负责人因公募证券投资基金（含大集合产品）托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 13、管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外；
- 14、集合计划收益分配事项；
- 15、管理费、托管费、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、某一类别集合计划份额净值计价错误达集合计划该类别份额净值百分之零点五；
- 17、本集合计划开始办理申购、赎回；

- 18、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；
- 19、本集合计划连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 20、本集合计划暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 21、发生涉及集合计划申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 22、管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 23、本集合计划推出新业务或服务；
- 24、集合计划变更份额类别设置；
- 25、集合计划信息披露义务人认为可能对份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会或资产管理合同规定的其他事项。

（六）澄清公告

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

（七）集合计划份额持有人大会决议

集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（八）清算报告

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

（九）投资资产支持证券的相关公告

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

（十）投资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。

（十一）实施侧袋机制期间的信息披露

本集合计划实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、资产管理合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见本招募说明书“第十七部分 侧袋机制”章节的规定。

（十二）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

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

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

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

管理人、托管人应当在规定报刊中选择披露信息的报刊。

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

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

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

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

七、信息披露文件的存放与查阅

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

八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，管理人和托管人可暂停或延迟披露集合计划相关信息：

- 1、不可抗力；
- 2、集合计划投资所涉及的证券/期货市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 3、出现资产管理合同约定的暂停估值的情形；
- 4、法律法规、资产管理合同或中国证监会规定的其他情况。

第十七部分 侧袋机制

一、侧袋机制的实施条件、实施程序

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，在符合法律法规及资产管理合同的约定的前提下，集合计划管理人经与集合计划托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以启用侧袋机制。管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及管理人所在地中国证监会派出机构备案。

启用侧袋机制当日，管理人和服务机构应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。

二、实施侧袋机制期间集合计划份额的申购与赎回

1、侧袋账户

侧袋机制实施期间，集合计划管理人不办理侧袋账户的申购、赎回和转换，集合计划份额持有人申请申购、赎回或转换侧袋账户集合计划份额的，该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

2、主袋账户

侧袋机制实施期间，资产管理合同及本招募说明书“集合计划份额的申购与赎回”部分的申购、赎回、巨额赎回、转换、定期定额投资等约定仅适用于主袋账户份额，集合计划管理人将按照资产管理合同和本招募说明书的约定，依据主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购与赎回。

此外，在依法保障主袋账户份额持有人享有资产管理合同约定的赎回权利的前提下，集合计划管理人依照法律法规及资产管理合同的约定，并根据主袋账户运作情况合理确定、调整申购政策，具体事项届时将由集合计划管理人在相关公告中规定。

3、集合计划份额的登记

侧袋机制实施期间，集合计划管理人和登记机构应对侧袋账户份额实行独立管理，主袋账户沿用原集合计划代码，侧袋账户使用独立的集合计划代码。

4、侧袋机制实施期间，相关证券交易所和/或中国证券登记结算有限责任公司对本集合计划份额的申购、赎回及份额登记另有规定的，从其最新规定。具体安排请见集合计划管理人届时发布的相关公告。

三、实施侧袋机制期间集合计划的投资及业绩

侧袋机制实施期间，本集合计划的各项投资运作指标和集合计划业绩指标应当以主袋账户资产为基准，资产管理合同及本招募说明书“集合计划的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。

集合计划管理人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，但因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

集合计划管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

侧袋机制实施期间，集合计划管理人、集合计划服务机构在计算集合计划业绩相关指标时仅考虑主袋账户资产，分割侧袋账户资产导致的集合计划净资产减少在计算集合计划业绩相关指标时按投资损失处理。集合计划管理人、集合计划服务机构在展示集合计划业绩时，应当就前述情况进行充分的解释说明，避免引起投资者误解。

四、实施侧袋机制期间集合计划的费用

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，详见届时发布的相关公告。

主袋账户仍按照资产管理合同及本招募说明书“集合计划费用与税收”部分的约定列支相关费用。

因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由集合计划管理人承担。

五、实施侧袋机制期间集合计划的收益分配

侧袋机制实施期间，资产管理合同及本招募说明书“集合计划的收益与分配”部分的收益分配原则等约定适用于主袋账户，集合计划管理人可据此确定主袋账户的收益分配方案、对主袋账户份额进行收益分配；侧袋账户不进行收益分配。

六、特定资产的处置清算

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，集合计划管理人将按照集合计划份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应款项。无论侧袋账户资产是否全部完成变现，管理人都将及时向侧袋账户份额持有人支付已变现部分对应的款项。

侧袋账户资产完全清算后，集合计划管理人应注销侧袋账户。

七、实施侧袋机制期间的信息披露

1、集合计划净值信息

侧袋机制实施期间，集合计划管理人应当暂停披露侧袋账户的集合计划份额净值信息，并按照法律法规及资产管理合同与本招募说明书约定的披露方式和频率披露主袋账户的集合计划份额净值信息。

2、定期报告

侧袋机制实施期间，管理人应当按照法律法规的规定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。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露。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，执行适当程序并发表审计意见。

3、临时报告

集合计划管理人在启用侧袋机制、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应及时发布临时公告。

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。侧袋机制实施期间；若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，集合计划管理人在每次处置变现后均应按法律、法规要求及时发布临时公告。

八、侧袋机制的审计

集合计划管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，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。

九、本部分关于侧袋机制的相关规定，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，或将来法律法规或监管规则针对侧袋机制的内容有进一步规定的，或相关证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司新增相关业务规则且适用于本集合计划的，管理人经与托管人协商一致并履行适当程序后，在对份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开份额持有人大会审议。

第十八部分 风险揭示

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

集合计划分为股票型集合资产管理计划、混合型集合资产管理计划、债券型集合资产管理计划等不同类型，投资人投资不同类型的集合资产管理计划将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平低于股票型集合资产管理计划和混合型集合资产管理计划，高于货币型集合资产管理计划及货币市场基金。

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

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

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

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

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

管理人提醒投资人在作出投资决策后，须了解并自行承担以下风险：

一、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的

影响，导致本集合计划收益水平变化而产生风险，主要包括：

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

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，从而引起债券价格波动，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。利率风险是债券投资所面临的主要风险。

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

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

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

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

8、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。

二、流动性风险

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

（1）集合计划申购、赎回安排

本集合计划对于每份 A 类、C 类份额，设定 30 天的滚动运作期，如果投资人多次申购本集合计划 A 类、C 类份额，则其持有的份额的赎回开放时间可能不同。投资人具体请参见资产管理合同“第六部分 集合计划份额的申购与赎回”和本招募说明书“第八部分 集合计划份额的申购与赎回”，详细了解本集合计划的申购以及赎回安排。

（2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本集合计划的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，同时本集合计划基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征。此外，本集合计划每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于集合计划资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。综上所述，本集合计划拟投资市场、行业及资产的流动性良好，流动性风险相对可控。

（3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

（4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

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

三、管理风险

1、在集合计划管理运作过程中管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响集合计划收益水平。

2、管理人和托管人的管理水平、管理手段和管理技术等因素的变化也会影响集合计划收益水平。

四、操作和技术风险

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

此外，在集合计划的后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

五、合规性风险及法律风险

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

法律风险指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。

六、本集合计划特有风险

1、滚动持有运作方式的风险

(1) 每个运作期到期日前，A 类、C 类份额持有人不能赎回集合计划份额的风险

对于每份 A 类、C 类份额，管理人仅在 A 类、C 类份额的每个运作期到期日为 A 类、C 类份额持有人办理赎回，在非运作期到期日，管理人不能为 A 类、C 类份额持有人办理赎回，且本集合计划不上市交易，A 类、C 类份额持有人面临流动性风险。

(2) 运作期到期日，A 类、C 类份额持有人未申请赎回或赎回被确认失败，到期的 A 类、C 类份额自动进入下一个运作期风险

如果 A 类、C 类份额持有人在每份 A 类、C 类份额的当期运作期到期日未申

请赎回或赎回被确认失败，则该份额将在该运作期到期后自动进入下一个运作期。在下一个运作期到期日前，A 类、C 类份额持有人不能赎回该笔份额，A 类、C 类份额持有人持有的的份额将面临滚动运作的风险。

(3) 每份 A 类、C 类份额每个实际运作期可能长于或短于 30 天的风险

本集合计划名称为兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划，但是考虑到周末、法定节假日等非工作日原因，每份 A 类、C 类份额的每个实际运作期期限或有不同，可能长于或短于 30 天。

投资者应当在熟悉并了解本集合计划运作规则的基础上，结合自身投资目标、投资期限等情况审慎作出投资决策，及时行使赎回权利。本集合计划的运作期和申购赎回安排请参见招募说明书第八部分的相关约定。

2、可转换债券投资风险

(1) 可转换债券收益不确定的风险

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

(2) 转股风险

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

(3) 偿付风险

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

(4) 资信风险

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

(5) 债券持有人回售债券导致发行人集中兑付的风险。

(6) 流动性风险

公司债券由监管部门批准的证券登记机构负责托管、登记及结算工作，发行

结束后，转换债交易市场的交易活跃程度受到宏观经济环境、投资者分布、投资者交易意愿等因素的影响，发行人无法保证转换债券的持有人能够随时并足额交易其所持有的债券，由此可能产生由于无法及时完成交易带来的流动性风险。

（7）周期性风险

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

3、可交换债券投资风险

（1）可交换债券的收益波动风险

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

（2）股票质押担保风险

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

（3）换股风险

主要包括：①换股期内标的股票价格可能低于换股价格而影响投资收益的风险；②债券的赎回条款可能导致债券提前兑付或换股期缩短而影响投资收益的风险；③换股价格向下修正条款触发时，董事会未同意修正换股价格的风险；④预备可交换的股票被限售、冻结，或因标的股票重大事项导致暂停换股时间超过债券存续期等导致投资者无法换股的风险。

（4）发行人资信风险

若由于发行人自身的相关风险或不可控制的因素，发行人的财务状况发生不

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

4、国债期货投资风险

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

5、次级债券的投资风险

（1）次级性风险

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

（2）利率风险

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

（3）流动性风险

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

（4）偿付风险

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

债券本息的能力，使投资者面临一定的偿付风险。

6、资产支持证券投资风险

本集合计划可能投资于资产支持证券。本集合计划所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，可能造成集合计划财产损失。此外，受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对集合计划收益造成影响。

七、启用侧袋机制的风险

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。当本集合计划启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，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。因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的集合计划净值信息，即便集合计划管理人在集合计划定期报告中披露特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，集合计划管理人不承担任何保证和承诺的责任。

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

启用侧袋机制后，集合计划管理人计算各项投资运作指标和集合计划业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，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。

八、其他风险

- 1、在符合本集合计划投资理念的新型投资工具出现和发展后，如果投资于这些工具，集合计划可能会面临一些特殊的风险；
- 2、因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；
- 3、因集合计划业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方

面不完善而产生的风险；

4、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

5、对主要业务人员如投资经理的依赖可能产生的风险；

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

7、其他意外导致的风险。

第十九部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算

一、《资产管理合同》的变更

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

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

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

三、集合计划财产的清算

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

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、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财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告，集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存，保存年限不低于法律法规规定的最低年限。

第二十部分 资产管理合同内容摘要

一、份额持有人、管理人和托管人的权利、义务

（一）份额持有人的权利与义务

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

除法律法规另有规定或资产管理合同另有约定外，同一类别集合计划份额具有同等的合法权益。

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

- （1）分享集合计划财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余集合计划财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的集合计划份额；

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

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

（6）查阅或者复制公开披露的集合计划信息资料；

（7）监督管理人的投资运作；

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

（9）法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

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

（1）认真阅读并遵守《资产管理合同》、招募说明书等信息披露文件；

（2）了解所投资集合计划产品，了解自身风险承受能力，自主判断集合计

划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳集合计划申购款项及法律法规和《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) 管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

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

(3) 依照《资产管理合同》收取管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；

(4) 销售集合计划份额；

(5) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；

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

(7) 在托管人更换时，提名新的托管人；

(8) 选择、更换销售机构，对销售机构的相关行为进行监督和处理；

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任登记机构办理集合计划登记业务并获得《资产管理合同》规定的费用；

(10) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；

(11) 在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使股东权利，为集合

计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为集合计划的利益依法为集合计划进行融资；

(14) 以管理人的名义，代表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、转换和非交易过户的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

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

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

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

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

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

(6) 依法接受托管人的监督；

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

(8) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(9) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

(10) 严格按照《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定，履行信

息披露及报告义务；

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

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

(13) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

(22) 以管理人名义，代表份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(23) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(24) 建立并保存份额持有人名册；

(25) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

(三) 托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

(6) 在管理人更换时，提名新的管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

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

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

产；

(5) 保管由管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 建立并保存份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《资产管理合同》的规定监督管理人的投资运作；

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

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

(19) 因违反《资产管理合同》导致集合计划财产损失时，应承担赔偿责任，

其赔偿责任不因其退任而免除；

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

(21) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(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。

二、集合计划份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

集合计划份额持有人大会由份额持有人组成，份额持有人的合法授权代表有权代表份额持有人出席会议并表决。除法律法规另有规定或资产管理合同另有约定外，份额持有人持有的同一类别每份集合计划份额拥有平等的投票权。

(一) 召开事由

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

- (1) 终止《资产管理合同》；
- (2) 更换管理人；
- (3) 更换托管人；
- (4) 转换集合计划运作方式；
- (5) 调整管理人、托管人的报酬标准或者调高 C 类份额的销售服务费率；
- (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) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；

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

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

- (13) 对集合计划当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

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

(二) 会议召集人及召集方式

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

2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集。

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

4、代表集合计划份额 10%以上（含 10%）的份额持有人就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会，应当向管理人提出书面提议。管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的集合计划份额

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

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

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

（三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开集合计划份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在规定媒介公告。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份额持有人的权益登记日；

（4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、授权方式（包括但不限于纸质授权、电话授权、短信授权及网络授权方式等）、送达时间和地点；

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次集合计划份额持有人大会所采取的具体通讯方式及投票方式（包括但不限于以纸质表决票投票、网络投票及短信投票等）、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

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

（四）份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《资产管理合同》约定公布会议通知后，在 2 个工作日

内连续公布相关提示性公告；

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

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

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

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

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

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系份额持有人利益的重大事项，如《资产管理合同》的重大修改、决定终止《资产管理合同》、更换管理人、更换托管人、与其他集合计划合

并、法律法规及《资产管理合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交集合计划份额持有人大会讨论的其他事项。

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第(七)条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为管理人授权出席会议的代表,在管理人授权代表未能主持大会的情况下,由托管人授权其出席会议的代表主持;如果管理人授权代表和托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的份额持有人和代理人所持表决权的50%以上(含50%)选举产生一名份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人。管理人和托管人拒不出席或主持集合计划份额持有人大会,不影响集合计划份额持有人大会作出的决议的效力。

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

(2) 通讯开会

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

(六) 表决

份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

2、特别决议,特别决议应当经参加大会的份额持有人或其代理人所持表决

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在托管

人授权代表（若由托管人召集，则为管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。管理人或托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

（八）生效与公告

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

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

（九）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均需符合该等比例，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、当参与集合计划份额持有人大会投票的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额小于在权益登记日相关集合计划份额的二分之一，召集人在原公告的集合计划份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的集合计划份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相

关集合计划份额的持有人参与或授权他人参与集合计划份额持有人大会投票；

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

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

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

侧袋机制实施期间，集合计划份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的集合计划份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内同一类别的每份集合计划份额具有平等的表决权；表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。

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

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

（十一）法律法规或监管部门对集合计划份额持有人大会另有规定的，从其规定。

三、集合计划收益分配原则、执行方式

（一）集合计划利润的构成

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

（二）集合计划可供分配利润

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

（三）集合计划收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，管理人根据实际情况进行收益分配，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对应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划各类份额默认的收益分配方式是现金分红。若投资者选择现金红利转换为对应类别集合计划份额进行再投资的，再投资份额需满足对应类别份额持有期的规定。本集合计划不同份额类别份额，其分红相互独立、互不影响；投资者不同交易账户设置的分红相互独立、互不影响；

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

4、除法律法规另有规定或资产管理合同另有约定外，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；

6、由于本集合计划 A 类份额与 B 类份额不收取销售服务费，且 B 类份额不收取固定管理费，而 C 类份额收取销售服务费，各类别份额对应的可供分配利润将有所不同。

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

（四）收益分配方案

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

（五）收益分配方案的确定、公告与实施

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，并由托管人复核，依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。

（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份额持有人的现金红利自动转为集合计划份额。红利再投资的计算方法，依照登记机构相关业务规则执行。

（七）实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书“第十七部分侧袋机制”章节的规定。

四、与集合计划财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

（一）集合计划费用的种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、本集合计划从 C 类份额的集合计划财产中计提的销售服务费；
- 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审计费、律师费、诉讼费、仲裁费和公证费；
- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券账户等相关账户的开户费用；
- 8、集合计划的证券/期货交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、相关账户费用及其他类似性质的费用等）；
- 9、集合计划的银行汇划费用、银行账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

（二）集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理人的管理费

（1）固定管理费

本集合计划 A 类份额和 C 类份额的固定管理费分别按 A 类份额和 C 类份额前一日集合计划资产净值的 0.30% 年费率计提。B 类份额不收取固定管理费。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类份额的年固定管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为各类份额每日应计提的集合计划管理费

E 为各类份额前一日的集合计划资产净值

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

(2) 业绩报酬

本集合计划只有 B 类份额收取业绩报酬，A 类份额和 C 类份额不收取业绩报酬。

① 业绩报酬计提原则

符合业绩报酬计提条件时，在投资者退出日或本集合计划分红日或终止日计提业绩报酬。

② 业绩报酬计提方法

业绩报酬计提日为集合计划投资人退出日或本集合计划分红日或终止日。从前一次业绩报酬计提日（若无，则为份额参与本集合计划日）至本次业绩报酬计提日，若 B 类份额年化收益率 R 小于或等于 4.2% 时，管理人不提取业绩报酬；若 B 类份额年化收益率 R 大于 4.2%，管理人对超过 4.2% 以上的部分提取 20% 作为业绩报酬。B 类份额的年化收益率的计算公式如下：

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

A = 该类份额本次业绩报酬计提日累计单位净值；

B = 该类份额上一个业绩报酬计提日（若无，则为份额参与本集合计划日）的累计单位净值；

C = 该类份额上一个业绩报酬计提日（若无，则为份额参与本集合计划日）的单位净值；

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

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法
$R \leq 4.2\%$	0	$H = 0$
$R > 4.2\%$	20%	$H = (R - 4.2\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{N}{365}$

（其中 F 为 B 类份额参与计提业绩报酬的份额数）

如投资者退出的份额为多笔参与，则采用“先进先出”法分别对每笔参与的份额计算业绩报酬。红利再投资的参与价格为红利转份额当日份额净值。

③ 业绩报酬的支付

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，由管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令从集合计划资产中一次性支付给管理人。

2、托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

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

3、C 类份额的销售服务费

本集合计划 A 类份额与 B 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.20%。

本集合计划销售服务费按前一日 C 类份额的集合计划资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付至管理人，若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）、集合计划费用的种类”中第 4—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中

支付。

（三）不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

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

2、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；

3、《资产管理合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目。

（四）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，详见招募说明书或相关公告的规定。

（五）集合计划税收

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

五、集合计划财产的投资方向和投资限制

（一）投资目标

本集合计划在控制风险和保持较高流动性的前提下，追求集合计划资产的稳健增值。

（二）投资范围

本集合计划的投资范围包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超短期融资券，中期票据、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具。

本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，

但可持有因可转换债券转股和可交换债券换股形成的股票。因上述原因持有的股应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种，管理人在履行适当程序后，本集合计划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资产不低于集合计划资产的 80%。每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

（三）投资限制

1、组合限制

本集合计划的投资组合应遵循以下限制：

- （1）本集合计划投资于债券资产不低于集合计划资产的 80%；
- （2）本集合计划每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- （3）本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的 10%；
- （4）本集合计划管理人管理的全部大集合产品持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，金融监督管理部门另有规定的除外；
- （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产品投资于同一原始权益人的各

类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

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

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

(13) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(14) 本集合计划参与国债期货交易，应当遵守下列要求：在任何交易日日终，本集合计划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%；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%；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%；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；

(15) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（11）、（12）情形之外，因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

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

法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，管理人在履行适当程序后，按变更后的规则执行。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

(四) 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，在符合法律法规及资产管理合同的约定的前提

下,集合计划管理人经与集合计划托管人协商一致,并咨询会计师事务所意见后,可以启用侧袋机制。

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的规定。

六、集合计划资产净值的计算方法和公告方式

(一) 集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。

(二) 集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额累计净值

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

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

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

七、资产管理合同解除和终止的事由、程序以及集合计划财产清算方式

(一) 《资产管理合同》的变更

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

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

(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、管理人、托管人职责终止,在 6 个月内没有新管理人、新托管人承接的;

- 3、《资产管理合同》约定的其他情形；
- 4、集合计划存续期届满；
- 5、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（三）集合计划财产的清算

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

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、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财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告，集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（七）集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存，保存年限不低于法律法规规定的最低年限。

八、争议解决方式

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

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

《资产管理合同》受中国法律（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

九、《资产管理合同》存放地和投资者取得资产管理合同的方式

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

第二十一部分 托管协议内容摘要

一、托管协议当事人

（一）管理人

名称：兴证证券资产管理有限公司

住所：福建省福州市平潭综合实验区管委会现场指挥部办公大楼一楼

法定代表人：孙国雄

成立日期：2014 年 6 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：证监许可[2014]145 号

组织形式：有限公司

注册资本：8 亿元

存续期限：2014 年 6 月 9 日至长期

联系人：高丹丹

联系电话：021-38565866

（二）托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：陈四清

成立时间：1984 年 1 月 1 日

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

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号

联系人：郭明

联系电话：010-66105799

二、托管人对管理人的业务监督和核查

(一) 托管人对管理人的投资行为行使监督权

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

本集合计划的投资范围包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超短期融资券，中期票据、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券等、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具。

本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，但可持有因可转换债券转股和可交换债券换股形成的股票。因上述原因持有的股应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

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

2、托管人根据有关法律法规的规定及《资产管理合同》的约定对下述集合计划投资比例进行监督：

(1) 本集合计划的投资组合比例为：

本集合计划投资于债券资产不低于集合计划资产的 80%。每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

(2) 根据法律法规的规定及《资产管理合同》的约定，本集合计划投资组合遵循以下投资限制：

1) 本集合计划投资于债券资产不低于集合计划资产的 80%；

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

3) 本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净

值的 10%;

4) 本集合计划管理人管理且由本集合计划托管人托管的全部大集合产品持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%, 金融监督管理部门另有规定的除外;

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

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

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

8) 本集合计划管理人管理且由本集合计划托管人托管的全部大集合产品投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

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

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

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

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

13) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%;

14) 本集合计划参与国债期货交易, 应当遵守下列要求: 在任何交易日日终, 本集合计划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%; 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%；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%；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；

除上述 2）、9）、11）、12）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管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

管理人应当自资产管理合同变更生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。在上述期间内，本集合计划的投资范围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资产管理监督与检查自资产管理合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，管理人在履行适当程序后，按变更后的规则执行。。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制。

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

为维护份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制或以变更后的规定为准。

4、托管人依据以下约定对管理人参与银行间债券市场投资进行监督

管理人参与银行间市场交易，应按照审慎的风险控制原则评估交易对手资信风险，并自主选择交易对手。托管人发现管理人与银行间市场的丙类会员进行债券交易的，可以通过邮件、电话等双方认可的方式提醒管理人，管理人应及时向托管人提供可行性说明。管理人应确保可行性说明内容真实、准确、完整。托管人不对管理人提供的可行性说明进行实质审查。管理人同意，经提醒后管理人仍执行交易并造成集合计划资产损失的，托管人不承担责任。

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

5、关于银行存款投资

本计划投资银行存款的信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。管理人应基于审慎原则评估存款银行信用风险并据此选择存款银行。因管理人违反上述原则给本计划造成的损失，托管人不承担任何责任，相关损失由管理人先行承担。管理人履行先行赔付责任后，有权要求相关责任人进行赔偿。托管人的职责仅限于督促管理人履行先行赔付责任。

6、托管人对本计划投资流通受限证券的监督

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

(2) 管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确本计划投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。托管人对管理人是否遵守相关制

度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

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

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

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

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

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

对于依据交易程序尚未成交的且托管人在交易前能够监控的投资指令，托管

人发现该投资指令违反相关法律法规规定或者违反本协议约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并向中国证监会报告。

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

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

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

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

三、管理人对托管人的业务核查

管理人对托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于托管人安全保管集合计划财产、开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需账户、复核管理人计算的集合计划资产净值和集合计划各类别份额净值、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督集合计划投资运作等行为。

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

管理人发现托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知托管人限期纠正。

托管人应积极配合管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供管

理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复管理人并改正。

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

四、集合计划财产保管

（一）集合计划财产保管的原则

- 1、集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。
- 2、托管人应安全保管集合计划财产。未经管理人的有效指令或法律法规、《资产管理合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何财产。
- 3、托管人按照规定开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。
- 4、托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，与托管人的其他业务和其他集合资产管理计划的托管业务实行严格的分账管理，确保集合计划财产的完整与独立。
- 5、托管人不得利用本协议为自己及任何第三人谋取利益，托管人从事上述违法违规所得利益归入集合计划财产。
- 6、对于因集合计划份额申购、集合计划投资过程中产生的应收财产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日集合计划财产没有到达托管人处的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收。由此给集合计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿集合计划的损失，托管人应当给予必要的协助与配合，但对此不承担责任。
- 7、除依据法律法规和《资产管理合同》的规定外，托管人不得委托第三人托管集合计划财产。

（二）集合计划的银行账户的开立和管理

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

资产托管专户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用集合计划的任何银行账户进行本集合计划业务以外的活动。

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

（三）集合计划证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

托管人接受管理人委托根据相关法律法规在中国证券登记结算有限公司开设证券账户。

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

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

（四）债券托管账户的开设和管理

1、《资产管理合同》生效后，管理人负责以集合计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表集合计划进行交易；托管人负责以集合计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户和资金结算专户，并代表集合计划进行银行间债券市场债券和资金的清算。

2、管理人和托管人应一起负责为集合计划对外签订全国银行间债券市场回购主协议，正本由托管人保管，管理人保存副本。

（五）其他账户的开设和管理

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

（六）集合计划财产投资的有关实物证券、银行存款证实书等有价凭证的保管

集合计划财产投资的有关实物证券根据实际需要,存放于托管人或其他机构的保管库。属于托管人实际有效控制下的实物证券在托管人保管期间的损坏、灭失,由此产生的责任应由托管人承担。托管人对托管人以外机构实际有效控制或保管的证券不承担保管责任。

(七) 与集合计划财产有关的重大合同的保管

由管理人代表集合计划签署的与集合计划有关的重大合同的原件分别应由托管人、管理人保管。除本协议另有规定外,管理人在代表集合计划签署与集合计划有关的重大合同时,应保证集合计划一方持有两份以上的正本,以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件。管理人在合同签署后 5 个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同原件送达托管人处。合同原件应存放于管理人和托管人各自文件保管部门 20 年以上。对于无法取得两份以上正本的,管理人应向托管人提供加盖公章的合同复印件,未经双方协商或未在合同约定范围内,合同原件不得转移。

(八) 特别约定

本协议生效后,针对以兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划的名义已经开立的账户,包括但不限于托管账户、证券账户、银行间账户、集合计划账户、存款账户等,管理人与托管人应互相配合,共同完成账户名称及开户资料的变更。

五、集合计划资产净值计算和会计核算

(一) 集合计划资产净值的计算

1、集合计划资产净值的计算、复核的时间和程序

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。集合计划各类别份额净值是按照每个工作日闭市后,集合计划该类别份额资产净值除以当日集合计划该类别份额的余额数量计算,精确到 0.0001 元,小数点后第 5 位四舍五入,由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的,从其规定。

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

于每个工作日交易结束后计算当日的集合计划各类别份额净值并以双方认可的方式发送给托管人。托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给管理人，由管理人按规定对集合计划各类别份额净值予以公布。

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

（二）集合计划资产估值方法

1、估值对象

集合计划所拥有的债券、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

2、估值方法

（1）证券交易所上市的有价证券的估值

1) 交易所上市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；

2) 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；

3) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

4) 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；

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

（2）首次公开发行未上市的债券，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）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照

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

（4）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

（6）国债期货合约以估值当日结算价进行估值。估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

（7）银行存款、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

（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見，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。

（三）估值差错处理

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

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

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

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。

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。

集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业有通行做法，在不违背法律法规且不损害投资者利益的前提下，管理人与托管人应本着平等和保护份额持有人利益的原则重新协商确定处理原则。

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

由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所及登记结算公司发送的数据错误或第三方估值机构提供的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的集合计划资产估值错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

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

(四) 集合计划账册的建立

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

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

(五) 集合计划定期报告的编制和复核

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

管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成集合计划年度报告，将年度报告登载于规定网站上，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。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。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。《资产管理合同》生效不足 2 个月的，管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

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

管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给托管人复核，托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知管理人。管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给托管人复核，托管人应在收到后 10 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知管理人。管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供托管人复核，托管人应在收到后 15 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知管理人。管理人和托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。托管人在复核过程中，发现相关各方的报表存在不符时，管理人和托管人应共同查明原因，进行调整，调整以相关各方认可的账务处理方式为准。核对无误后，托管人在管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。如果管理人与托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，托管人有权就相关情况报证监会备案。

托管人在对季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，应根据相关法律法规出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

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

（六）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，应根据资产管理合同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份额净值信息，暂停披露侧袋账户的集合计划份额净值信息。

六、集合计划份额持有人名册的保管

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

集合计划份额持有人名册由集合计划的注册登记机构根据管理人的指令编制和保管，管理人和托管人应按照相关规则分别保管集合计划份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。集合计划份额登记机构的保存期限自集合计划账户销户之日起不得少于 20 年。

管理人应当及时向托管人提交下列日期的集合计划份额持有人名册：《资产管理合同》生效日、《资产管理合同》终止日、集合计划份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的集合计划份额持有人名册。集合计划份额持有人名册的内容必须包括集合计划份额持有人的名称和持有的集合计划份额。其中每年 12 月 31 日的集合计划份额持有人名册应于下月前十个工作日内提交；《资产管理合同》生效日、《资产管理合同》终止日等涉及到集合计划重要事项日期的集合计划份额持有人名册应于发生后十个工作日内提交。

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

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

七、争议解决方式

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

争议处理期间，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（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖。

八、托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算

（一）托管协议的变更与终止

1、托管协议的变更程序

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

2、托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）《资产管理合同》终止；
- （2）托管人解散、依法被撤销、破产或有其他托管人接管集合计划资产；
- （3）管理人解散、依法被撤销、破产或有其他管理人接管集合计划管理权；
- （4）发生法律法规或《资产管理合同》、本协议规定的终止事项。

（二）集合计划财产的清算

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

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

3、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、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。

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

5、集合计划财产清算程序：

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

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

6、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。

7、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。

8、集合计划财产清算剩余资产的分配

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

(三) 集合计划财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经符合《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财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告，集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(四) 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存，保存年限不低于法律法规规定的最低年限。

第二十二部分 对份额持有人的服务

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

一、资料寄送

1、份额交易对账单

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

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

2、其他相关的信息资料

其他相关的信息资料指不定期寄送的资讯材料。

二、电子化服务

1、微信服务

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

三、客户服务中心

1、客户服务电话

目前呼叫中心在工作时间提供人工应答服务。

2、网上客户服务

管理人网站为份额持有人提供查询服务和资讯服务。

公司网址：<http://www.ixzzcgl.com/>

客服信箱：zcgl@xyzq.com.cn

四、客户投诉处理

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

的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

五、服务渠道

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

第二十三部分 其他应披露事项

以下信息披露事项已通过中国证监会规定媒介进行公开披露。

序号	法定披露日期	公告事项
1	2023-05-26	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划（A 类份额）产品资料概要更新
2	2023-05-26	兴证资管金麒麟悦享添利 31 天滚动持有债券型集合资产管理计划（B 类份额）产品资料概要更新
3	2023-05-26	兴证资管金麒麟悦享添利 32 天滚动持有债券型集合资产管理计划（C 类份额）产品资料概要更新
4	2023-05-26	兴证证券资产管理有限公司兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书更新（2023 年第 1 号）
5	2023-06-16	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划 2023 年端午节暂停申购业务的公告
6	2023-06-20	关于兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告
7	2023-07-21	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划 2023 年第 2 季度报告
8	2023-08-22	关于兴证证券资产管理有限公司运用固有资金投资旗下集合资产管理计划的公告
9	2023-08-31	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划 2023 年中期报告
10	2023-09-25	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划 2023 年国庆节假期暂停申购业务的公告
11	2023-09-28	关于兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划增加销售机构并参加申购费率优惠活动的公告
12	2023-10-25	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告
13	2023-12-19	兴证证券资产管理有限公司关于旗下部分集合计划参与北京证券交易所股票投资及相关风险提示的公告
14	2023-12-29	兴证证券资产管理有限公司董事变更情况公告
15	2024-01-08	兴证证券资产管理有限公司关于投资经理代为履行职责的公告
16	2024-01-22	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划 2023 年第 4 季度报告
17	2024-01-24	兴证证券资产管理有限公司旗下公募资产管理产品风险评价结果的公告
18	2024-02-02	兴证证券资产管理有限公司关于公司住所变更的公告
19	2024-02-05	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合

		产管理计划 2024 年春节假期暂停申购业务的公告
20	2024-03-29	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划 2023 年年度报告
21	2024-04-01	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划 2024 年清明节假期暂停申购业务的公告
22	2024-04-22	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告
23	2024-04-25	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划 2024 年五一劳动节假期暂停申购业务的公告
24	2024-05-15	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划调整大额申购业务的公告

第二十四部分 招募说明书的存放及查阅方式

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

管理人和托管人保证文本的内容与所公告的内容完全一致。

第二十五部分 备查文件

本集合计划备查文件包括以下文件：

（一）中国证监会准予兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同申请变更合同的文件

（二）兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同

（三）兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议

（四）法律意见书

（五）管理人业务资格批件和营业执照

（六）托管人业务资格批件和营业执照

（七）中国证监会要求的其他文件

兴证证券资产管理有限公司

二〇二四年五月二十七日