

申万宏源证券资产管理有限公司

申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型  
集合资产管理计划  
更新的招募说明书

集合计划管理人：申万宏源证券资产管理有限公司

集合计划托管人：兴业银行股份有限公司

## 重要提示

申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）由申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划变更而来，申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划由管理人依照《证券公司客户资产管理业务试行办法》（证监会令第 17 号）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（证监会公告[2008]26 号）、《申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划资产管理合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准设立。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会 2022 年 5 月 31 日《关于准予申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]1040 号）批准，自 2022 年 10 月 13 日起，《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

根据中国证监会《关于核准申万宏源证券有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2022]2615 号），申万宏源证券资产管理有限公司已成立。申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划管理人由“申万宏源证券有限公司”变更为“申万宏源证券资产管理有限公司”。

管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会批准，但中国证监会对申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划变更为本集合计划的批准，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。

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

投资有风险，投资者在投资本集合计划之前，请仔细阅读本集合计划的招募说明书、集合计划合同和产品资料概要等信息披露文件，全面认识本集合计划的

风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

本集合计划投资于证券市场，集合计划净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本集合计划前，需充分了解本集合计划的产品特性，并承担集合计划投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于集合计划投资人连续大量赎回集合计划份额产生的流动性风险，管理人在集合计划管理实施过程中产生的集合计划管理风险，本集合计划的特定风险等。

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

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

对于投资者依据《申银万国灵通快利7天集合资产管理计划资产管理合同》认购或参与集合计划获得的申银万国灵通快利7天集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划B类计划份额。在本集合计划存续期间，B类份额每两周开放一次赎回，且赎回仅开放1天，不开放申购。管理人有权在B类计划份额开始办理赎回业务后确定开放赎回的首个周三，并在相关公告中公告。此后，每两周后的对应周的周三开

放一次赎回（如遇节假日则当次不开放赎回）。

本集合计划 A 类、C 类计划份额设定锁定持有期，锁定持有期为 6 个月。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份集合计划份额自开放持有期首日起才能办理赎回及转换转出业务。

对于 B 类计划份额，本集合计划采用逐笔计提法提取业绩报酬，每日披露的集合计划份额净值为未扣除集合计划管理人业绩报酬前的集合计划份额净值。由于赎回、转出或者集合计划终止清算时集合计划管理人可能计提业绩报酬，且由于投资者持有时间不同，投资者应承担的业绩报酬金额也不同，投资者实际赎回/转出/清算金额，以登记机构确认数据为准。

本集合计划为债券型集合资产管理计划，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、现金管理型集合计划，低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划。

本集合计划的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本集合计划的过往业绩并不预示其未来表现，管理人管理的其他产品的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。管理人提醒投资者投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，集合计划运营状况与集合计划净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。本次更新的招募说明书主要对集合计划管理人、投资经理、财务数据、净值表现等信息进行修订，更新内容截止日为 2024 年 11 月 14 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2024 年 9 月 30 日（本报告中财务数据未经审计）。

---

---

## 目 录

第一部分 绪言 .....	1
第二部分 释义 .....	2
第三部分 集合计划管理人 .....	8
第四部分 集合计划托管人 .....	22
第五部分 相关服务机构 .....	26
第六部分 集合计划的历史沿革 .....	29
第七部分 集合计划的存续 .....	30
第八部分 集合计划份额的申购与赎回 .....	31
第九部分 集合计划的投资 .....	43
第十部分 集合计划的业绩 .....	55
第十一部分 集合计划的财产 .....	59
第十二部分 集合计划资产估值 .....	61
第十三部分 集合计划的收益与分配 .....	68
第十四部分 集合计划费用与税收 .....	70
第十五部分 集合计划的会计与审计 .....	74
第十六部分 集合计划的信息披露 .....	75
第十七部分 侧袋机制 .....	82
第十八部分 风险揭示 .....	85
第十九部分 集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算 .....	92
第二十部分 集合计划合同的内容摘要 .....	94
第二十一部分 集合计划托管协议的内容摘要 .....	112
第二十二部分 对集合计划份额持有人的服务 .....	130
第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式 .....	131
第二十四部分 备查文件 .....	132

## 第一部分 绪言

《申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)及其他有关规定以及《申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“集合计划合同”或“《集合计划合同》”)编写。

本招募说明书阐述了申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项,投资者在做出投资决策前应仔细阅读招募说明书。

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

本招募说明书依据集合计划合同编写,并经中国证监会批准。集合计划合同是约定集合计划合同当事人之间权利义务的法律文件。投资者自依集合计划合同取得集合计划份额,即成为集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人,其持有集合计划份额的行为本身即表明对集合计划合同的承认和接受,并按照《基金法》、集合计划合同及其它有关规定享有权利,承担义务。

投资者欲了解集合计划份额持有人的权利和义务,应详细查阅集合计划合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合计划或本集合计划：指申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划

2、集合计划管理人或管理人：指申万宏源证券资产管理有限公司

3、集合计划托管人或托管人：指兴业银行股份有限公司

4、集合计划合同：指《申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》及对集合计划合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指集合计划管理人与集合计划托管人就本集合计划签订之《申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

7、产品资料概要：指《申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新

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集合计划合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

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

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

11、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施，并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公

开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于集合资产管理计划（即证券公司设立管理的投资者人数不受200人限制的集合资产管理计划，下同）或证券投资基金的自然人

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

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的集合资产管理计划或证券投资基金的中国境外的机构投资者

20、人民币合格境外机构投资者：指按照《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人

21、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买集合资产管理计划或证券投资基金的其他投资人的合称

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

23、集合计划销售业务：指集合计划管理人或销售机构宣传推介集合计划，



办理集合计划份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指申万宏源证券资产管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与集合计划管理人签订了集合计划销售服务协议，办理集合计划销售业务的机构。具体以集合计划管理人公告为准

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

26、登记机构：指办理登记业务的机构。集合计划的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司

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

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

29、集合计划合同生效日：指《申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》的生效日，原《申银万国灵通快利7天集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效，生效日期为2022年10月13日

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

31、存续期：指集合计划合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、锁定持有期：对于A类计划份额、C类计划份额，锁定持有期指集合计划份额申购确认日起（即锁定持有期起始日），至集合计划份额申购确认日6个月对日的前一日（即锁定持有期到期日）之间的区间，A类计划份额、C类计划份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务。若该对应月份不存在对应日的，则顺延至该月最后一日，若该对日为非工作日的，则顺延至下一个工作日

34、开放持有期：对于A类计划份额、C类计划份额，自锁定持有期结束后即进入开放持有期，开放持有期首日为锁定持有期到期日下一个工作日。每份集

合计划份额在开放持有期期间的开放日可以办理赎回业务

35、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

36、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

37、开放日：指为投资人办理集合计划份额申购、赎回或其他业务的工作日

38、开放时间：指开放日集合计划接受申购、赎回或其他交易的时间段

39、《业务规则》：指中国证券登记结算有限责任公司发布的适用于集合资产管理计划或证券投资基金的业务规则

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

41、赎回：指集合计划合同生效后，集合计划份额持有人按集合计划合同和招募说明书规定的条件要求将集合计划份额兑换为现金的行为

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

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

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

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

46、元：指人民币元

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

48、收益分配基准日：指期末可供分配利润计算截止日

- 49、除息日：指收益分配方案中确定的将红利从集合计划资产中扣除的日期
- 50、集合计划资产总值：指集合计划拥有的各类有价证券、银行存款本息、集合计划应收申购款及其他资产的价值总和
- 51、集合计划资产净值：指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值
- 52、集合计划份额：指委托人对集合计划享有资产所有权、收益分配权和其他相关权利、并承担相应义务的基本计量单位
- 53、集合计划份额净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划份额总数
- 54、集合计划资产估值：指计算评估集合计划资产和负债的价值，以确定集合计划资产净值和集合计划份额净值的过程
- 55、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括管理人网站、托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介
- 56、A类计划份额：指依据本资产管理合同，在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别计划资产中计提销售服务费的份额。A类计划份额的锁定持有期为6个月
- 57、B类计划份额：指对于投资者依据《申银万国灵通快利7天集合资产管理计划资产管理合同》认购或参与集合计划获得的申银万国灵通快利7天集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划B类计划份额。在本集合计划存续期间，B类份额每两周开放一次赎回，且赎回仅开放1天，不开放申购。管理人有权在B类计划份额开始办理赎回业务后确定开放赎回的首个周三，并在相关公告中公告。此后，每两周后的对应周的周三开放一次赎回（如遇节假日则当次不开放赎回）
- 58、C类计划份额：指依据本资产管理合同，在投资者申购时不收取申购费用，但从本类别计划资产中计提销售服务费的份额。C类计划份额的锁定持有期为6个月
- 59、销售服务费：指从集合计划财产中计提的，用于本集合计划市场推广、销售以及集合计划份额持有人服务的费用
- 60、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

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

62、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

63、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

64、不可抗力：指集合计划合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

## 第三部分 集合计划管理人

### 一、管理人概况

名称：申万宏源证券资产管理有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

法定代表人：袁锦

成立日期：2022 年 12 月 20 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2022]2615 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2,500,000,000 元

存续期限：持续经营

联系人：唐玮

联系电话：010-88085035

股权结构：申万宏源证券有限公司持有 100% 的股份

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

李琦，男，1975 年 9 月出生，硕士，历任宏源证券股份有限公司大连金马路证券营业部总经理；宏源证券股份有限公司经纪业务总部营销服务部副总经理兼广西分公司总经理；申万宏源集团股份有限公司多元金融部总经理；申万宏源西部证券有限公司党委书记、法定代表人、总经理；申万宏源证券有限公司资产管理事业部党总支书记、总经理；现任申万宏源证券资产管理有限公司党委书记、董事长。

袁锦，女，1972 年 11 月出生，经济学博士，历任招商银行上海分行计划资金部总经理助理；招商银行上海分行同业银行部兼基金托管部上海分部副总经理（主持工作）；招商银行上海分行公司银行部兼同业银行部总经理；招商银行上海分行公司银行部兼战略客户服务中心总经理；招商银行上海自贸区分行党委委员、行长助理；招商银行总行资产管理部总经理助理；申万宏源证券有限公司资产管理事业部副总经理；现任申万宏源证券资产管理有限公司党委副书记、董事、

总经理、法定代表人，自2024年9月23日起代行申万宏源证券资产管理有限公司合规总监、首席风险官职责，代行时间不超过6个月。

陈勇，男，1974年2月出生，本科，历任申银万国证券股份有限公司固定收益总部总经理；申银万国证券股份有限公司固定收益融资总部联席总经理。现任申万宏源证券有限公司资金运营总部总经理、申万宏源证券资产管理有限公司董事。

王胜，男，博士，上海申银万国证券研究所有限公司副总经理，分管债券研究部、策略研究部、宏观研究部、金融工程部等部门，曾任金融地产研究部负责人。2024年4月19日起任申万宏源证券资产管理有限公司董事。

潘勇，男，1976年1月出生，硕士，历任申银万国证券长沙芙蓉中路营业、申万宏源证券有限公司长沙芙蓉中路营业部总经理；申万宏源证券有限公司财富管理事业部机构金融部总经理助理（主持工作）、副总经理（主持工作）。现任申万宏源证券有限公司财富管理事业部副总经理、申万宏源证券资产管理有限公司董事。

## 2、监事

谈伟军，男，1965年6月出生，硕士，历任申银万国证券股份有限公司稽核总部副经理、经理；申银万国证券股份有限公司计划统筹总部/风险管理办公室副总经理、副主任（主持工作）；申银万国证券股份有限公司风险管理总部总经理；申银万国证券股份有限公司合规与风险管理中心副总经理（总部总经理级）；申银万国证券股份有限公司资产管理事业部产品评审总部总经理；申万宏源证券有限公司评审中心总经理、内核评审总部总经理。现任申万宏源证券有限公司风险管理总部首席顾问、申银万国投资有限公司监事长、申万宏源证券资产管理有限公司监事。

## 3、总经理及其他高级管理人员

袁锦，女，1972年11月出生，经济学博士，历任招商银行上海分行计划资金部总经理助理；招商银行上海分行同业银行部兼基金托管部上海分部副总经理（主持工作）；招商银行上海分行公司银行部兼同业银行部总经理；招商银行上海分行公司银行部兼战略客户服务中心总经理；招商银行上海自贸区分行党委委员、行长助理；招商银行总行资产管理部总经理助理；申万宏源证券有限公司资

产管理事业部副总经理；现任申万宏源证券资产管理有限公司党委副书记、董事、总经理、法定代表人，自 2024 年 9 月 23 日起代行申万宏源证券资产管理有限公司合规总监、首席风险官职责，代行时间不超过 6 个月。

叶枫，男，1980 年 8 月出生，硕士，历任申银万国证券股份有限公司计划统筹总部部门经理；申万宏源证券有限公司计划财务管理总部总经理助理。现任申万宏源证券有限公司计划财务管理总部副总经理（主持工作）、申万宏源证券资产管理有限公司董事会秘书、财务总监。

谢晨，男，1976 年 10 月出生，经济学博士，历任中芯国际集成电路制造（上海）有限公司信息技术部项目组长、上海期货交易所技术部经理助理；中国期货市场监控中心技术部部长、申万宏源证券有限公司总经理助理；现任申万宏源证券有限公司首席信息官、申万宏源证券资产管理有限公司首席信息官。

梁福涛，男，1977 年 8 月出生，经济学博士，历任兴业证券股份有限公司综合及研究部研究员；上海申银万国证券研究所有限公司宏观经济研究员；长江养老保险股份有限公司高级董事总经理兼投资管理部总经理；凯石基金管理有限公司总经理助理；申万宏源证券有限公司资产管理事业部副总经理；现任申万宏源证券资产管理有限公司副总经理。

王伟，男，1972 年 2 月出生，博士，历任申银万国证券国际业务部高级分析师；申银万国证券总裁办业务秘书；申银万国证券收购兼并总部业务一部经理；原申万巴黎基金管理有限公司市场营销总部副总监、总监；申万菱信基金管理有限公司首席市场官兼申万菱信（上海）资产管理有限公司总经理；申万菱信基金管理有限公司副总经理；申万菱信基金管理有限公司总经理助理。现任申万宏源证券资产管理有限公司副总经理。

#### 4、本集合计划投资经理

季程，毕业于新加坡南洋理工大学，金融学硕士，曾任职于申银万国证券股份有限公司资产管理事业部，2015 年起就职于申万宏源证券资产管理事业部，历任交易员、投资助理、投资经理，具有多年资产管理工作经验。2018 年 3 月 29 日至今任申万宏源天天增货币型集合资产管理计划投资经理、2018 年 3 月 29 日至今任申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划投资经理、2018 年 3 月 29 日至今任申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划投资经

理、2019 年 8 月 9 日至今任申万宏源天添利货币型集合资产管理计划投资经理、2019 年 8 月 9 日至今任申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划投资经理<sup>1</sup>。该投资经理已取得投资经理执业证书，证书编号为：S0900817090002，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002664，不存在其他兼职情况，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。

丁杰科，经济学和法学双学士，产业经济学硕士，中级经济师。先后就职于交银施罗德基金、中国农业银行金融市场部、申万菱信基金，先后从事债券交易、债务投资和公募基金管理工作。拥有多年债券交易和投资经验，担任过货币、债券，股债混合等多种类型基金产品的基金经理。2021 年 12 月 6 日至今任申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划投资经理，2020 年 1 月 3 日至今任申万宏源天天增货币型集合资产管理计划投资经理，2020 年 1 月 3 日至今任申万宏源天添利货币型集合资产管理计划投资经理，2020 年 1 月 3 日至今任申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划投资经理，2020 年 1 月 3 日至今任申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划投资经理。该投资经理已取得投资经理执业证书，证书编号为：S0900819110001，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000003495，不存在其他兼职情况，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。

秦庆，工学硕士，曾任职于益名基金公司、泰康资管权益投资部，从事通信、电子、计算机、传媒等行业研究工作。2013 年 6 月加入原宏源证券北京资管分公司权益投资部，先后历任宏源证券宏源 10 号股债双鑫集合资产管理计划（现已变更为“申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划”）、宏源证券股债双丰集合资产管理计划投资主办人，2019 年 4 月 15 日至今任申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划投资经理，2022 年 10 月 13 日至今任申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划投资经理。拥有丰富的投资运营管理经验，不存在其他兼职情况；已取得投资主办人执业证书，证书编号为：S1180814050001，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002689，

<sup>1</sup>鉴于所列集合计划均由证券公司大集合资产管理计划变更而来，若投资经理在变更生效日（即集合计划合同生效日）前已担任该集合计划投资经理的，则任职日期为该投资经理首次担任该集合计划投资经理之日，下同。



且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。

#### 5、公募资产管理业务投资决策委员会

王伟，公募资产管理业务投资决策委员会主任，男，1972 年 2 月出生，博士，历任申银万国证券国际业务部高级分析师；申银万国证券总裁办业务秘书；申银万国证券收购兼并总部业务一部经理；原申万巴黎基金管理有限公司市场营销总部副总监、总监；申万菱信基金管理有限公司首席市场官兼申万菱信（上海）资产管理有限公司总经理；申万菱信基金管理有限公司副总经理；申万菱信基金管理有限公司总经理助理。现任申万宏源证券资产管理有限公司副总经理。

丁杰科，公募资产管理业务投资决策委员会副主任，申万宏源证券资产管理有限公司投资经理，经济学和法学双学士，产业经济学硕士，中级经济师。先后就职于交银施罗德基金、中国农业银行金融市场部、申万菱信基金，先后从事债券交易、债务投资和公募基金管理工作。拥有多年债券交易和投资经验，担任过货币、债券，股债混合等多种类型的基金产品基金经理。2023 年 10 月至今就职于申万宏源证券资产管理有限公司。现为本集合计划投资经理。

张长江，申万宏源证券资产管理有限公司风险管理部经理，公募资产管理业务投资决策委员会委员、产品评审委员会委员、金融学硕士，证券从业二十余年，多年的证券公司各业务内部审计工作经验，最近七年担任固定收益业务合规风控负责人。2021 年 3 月加入申万宏源证券资产管理事业部，主要负责风险管理等工作。

马方园，公募资产管理业务投资决策委员会委员，申万宏源证券资产管理有限公司集中交易部负责人，南开大学金融学硕士，2012 年加入申万宏源资管事业部，历任产品经理、债券交易员，集中交易部负责人。

秦庆：工学硕士，曾任职于基金公司、泰康资管权益投资部，从事通信、电子、计算机、传媒等行业研究工作。2013 年 6 月加入原宏源证券北京资管分公司权益投资部，先后历任宏源证券宏源 10 号股债双鑫集合资产管理计划（现已变更为“申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划”）、宏源证券股债双丰集合资产管理计划投资主办人，拥有丰富的投资运营管理经验。

陈旻，工商管理硕士，经济师职称，25 年证券从业经验。曾任申银万国证券股份有限公司证券投资总部投资经理、客户资产管理总部定向理财投资部投资

经理、“申万 1 号”和“宝鼎一期”投资经理助理、“申万 3 号”投资经理以及“宝鼎优选定增系列”“宝鼎稳盈系列”“宝鼎系列”等产品投资经理，拥有丰富的投资运营管理经验。

季程，公募资产管理业务投资决策委员会委员，申万宏源证券资产管理有限公司投资经理，毕业于新加坡南洋理工大学，金融学硕士，曾任职于申银万国证券股份有限公司资产管理事业部，2015 年起就职于申万宏源证券资产管理事业部，历任交易员、投资助理、投资经理，具有多年资产管理工作经验。目前管理申万宏源天天增货币型集合资产管理计划、申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划、申万宏源灵通快利短期债券型集合资产管理计划、申万宏源天添利货币型集合资产管理计划、申万宏源季季优选 3 个月滚动持有债券型集合资产管理计划等产品。现为本集合计划投资经理。

姚紫东，公募资产管理业务投资决策委员会委员，从业 7 年，厦门大学数学系学士，美国新泽西州立大学金融学硕士，2023 年 6 月加入申万宏源证券有限公司，曾先后任国泰基金风险管理经理助理、信用研究员，中银基金信用研究员，2023 年 10 月至今就职于申万宏源资产管理有限公司，担任信用研究员。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、管理人的职责

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

2、办理集合计划备案手续；

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

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

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

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

- 7、依法接受集合计划托管人的监督；
- 8、采取适当合理的措施使计算集合计划份额申购、赎回和注销价格的方法符合集合计划合同等法律文件的规定，按有关规定计算并公告集合计划净值信息，确定集合计划份额申购、赎回的价格；
- 9、进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；
- 10、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 11、严格按照《基金法》、集合计划合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
- 12、保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、集合计划合同及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- 13、按集合计划合同的约定确定集合计划收益分配方案，及时向集合计划份额持有人分配集合计划收益；
- 14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- 15、依据《基金法》、集合计划合同及其他有关规定召集集合计划份额持有人大会或配合集合计划托管人、集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；
- 16、按规定保存集合计划财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；
- 17、确保需要向集合计划投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照集合计划合同规定的时间和方式，随时查阅到与集合计划有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- 18、组织并参加集合计划财产清算小组，参与集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- 19、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知集合计划托管人；
- 20、因违反集合计划合同导致集合计划财产的损失或损害集合计划份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- 21、监督集合计划托管人按法律法规和集合计划合同规定履行自己的义务，

集合计划托管人违反集合计划合同造成集合计划财产损失时，集合计划管理人应为集合计划份额持有人利益向集合计划托管人追偿；

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

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

24、执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

25、建立并保存集合计划份额持有人名册；

26、法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他义务。

#### 四、管理人承诺

1、集合计划管理人将遵守《基金法》、《中华人民共和国证券法》等法律法规的相关规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的

发生。

2、集合计划管理人不得从事下列行为：

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待其管理的不同集合计划财产；

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

(4) 向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

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

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

#### 3、投资经理承诺

(1) 依照有关法律法规和集合计划资产管理合同的规定，本着谨慎的原则为集合计划份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人牟取不当利益；

(3) 不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，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 五、管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的原则

(1) 全面性原则。内部控制应当贯穿决策、执行和监督全过程，覆盖公司及其所属单位的各种业务和事项。

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

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

(4) 适应性原则。内部控制与公司经营规模、业务范围、竞争状况和风险水平等相适应，并随着情况的变化及时加以调整。

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

### 2、内部控制的主要内容

#### (1) 基本要求

1) 公司依法建立健全法人治理结构。明确决策、执行、监督等方面的职责权限，建立科学的决策程序与议事规则，高效、严谨的业务运作系统，健全、有效的内部监督和反馈系统以及有效的激励约束机制。

2) 公司与股东、实际控制人、关联方之间保持资产、财务、人事、业务、机构等方面的独立性，确保公司独立运作。

3) 公司加强法人统一管理，建立具体、明确、合理的授权、检查和逐级问责制度，明确界定各单位的目标、职责和权限，各岗位应有明确的岗位职责说明和清晰的报告关系，确保其在授权范围内行使经营管理职能。

4) 公司建立完善的风险管理体系，将风险管理工作渗透至各项业务过程和每一个操作环节，各业务部门对所辖范围内的风险负直接责任，各职能管理部门在职权范围内分别负责各类风险的监测、报告和控制。

5) 公司建立信息沟通机制, 确保董事会、监事、经理层及监督检查部门及时了解公司的经营和风险状况, 确保各类投诉、可疑事件和内控缺陷得到妥善处理。

6) 公司建立重大风险预警机制和突发事件应急处理机制, 明确风险预警标准, 对可能发生的重大风险或突发事件, 制定应急预案、明确责任人员、规范处置程序, 确保突发事件得到及时妥善处理。

7) 公司建立科学、有效的内部控制考核机制, 对内部控制的有效实施进行约束和激励, 促使公司各单位加强内部控制建设并有效执行内部控制措施。各单位的负责人是本部门内部控制工作的第一责任人, 有义务向公司报告内部控制的缺陷并及时加以纠正; 相关人员对违反职责范围内的内部控制导致的风险和损失承担首要责任。

8) 公司建立内部控制评价机制, 定期评价内部控制的有效性, 并根据评价结果及市场、技术、法律环境的变化对公司的内部控制进行适时调整和完善。

## (2) 控制环境

1) 公司董事会负责内部控制的建立健全和有效实施。监事对董事会建立与实施内部控制进行监督。

2) 公司经理层负责组织领导公司内部控制的日常运行, 在职权范围内, 根据内外部情况的变化对公司内部控制进行适时的调整和完善。

公司各单位履行本单位职能范围以内的内部控制职责, 并对本单位内部控制的有效性承担责任。

公司经理层下设风险管理委员会负责牵头内部控制实施的相关工作。负责稽核工作的职能部门对内部控制的实施情况进行监督检查。

3) 公司结合业务特点和内部控制要求设置内部机构, 明确职责权限, 将权利与责任落实到各责任单位。

4) 公司制定和实施适合行业经营特点, 支持公司可持续发展和战略实现的人力资源政策, 不断优化人力资源整体布局, 实现人力资源的合理配置。

5) 公司加强文化建设, 培育积极向上的价值观和社会责任感, 倡导诚实守信、爱岗敬业、开拓创新和团队协作精神, 树立现代管理理念, 强化风险意识。董事、监事、高级管理人员及各级管理人员应在公司文化建设中发挥主导作用。

6) 公司树立合法合规经营的理念, 强化风险控制优先的意识, 增强董事、监事、高级管理人员及各级管理人员和员工的法制观念, 严格依法决策、依法办事、依法监督, 建立健全公司制度体系, 健全公司行为准则和员工道德规范。

7) 公司建立反洗钱机制, 坚持惩防并举、重在预防的原则, 明确反洗钱工作的重点领域、关键环节和有关机构在反洗钱工作中的职责权限, 规范洗钱案件的举报、调查、处理、报告和补救程序。

### (3) 风险评估

公司根据设定的控制目标, 全面系统持续地收集相关信息, 结合实际情况, 逐步建立风险识别、评估的完整体系。

公司准确识别与实现控制目标相关的内部风险和外部风险, 确定相应的风险承受度。

公司运用多种手段, 对信用风险、市场风险、流动性风险、操作风险、法律风险、合规风险、声誉风险和道德风险等进行持续监控, 明确风险管理流程和风险化解方法。

公司采取定性与定量相结合的方法, 按照风险发生的可能性及其影响程度等, 对识别的风险进行分析和排序, 确定关注重点和优先控制的风险。公司风险管理部门会同相关部门负责组织风险评估和分析工作。风险管理部门组织相关部门专业人员, 组成风险分析团队, 按照公司风险管理的相应规范开展工作, 确保风险分析结果的准确性。

公司根据风险分析的结果, 结合风险承受度, 权衡风险与收益, 确定风险应对策略, 并适时调整。公司在制定风险应对策略过程中应合理分析和掌握公司董事、高级管理人员及关键员工的风险偏好, 采取适当的控制措施, 避免因个人风险偏好给公司带来重大损失。

公司综合运用风险规避、风险降低、风险分担和风险承受等风险应对策略, 实现对风险的有效控制。

### (4) 控制活动

1) 公司结合风险评估结果, 通过手工控制与自动控制、预防性控制与发现性控制相结合的方法, 运用相应的控制措施, 将风险控制在可承受度之内。

2) 公司内部控制活动包括: 不相容职务分离控制、授权审批控制、会计系

统控制、财产保护控制、预算控制、运营分析控制和绩效考评控制等。

①公司建立不相容职务分离控制，全面系统分析、梳理业务流程中所涉及的不相容职务，实施相应的分离措施，形成各司其职、各负其责、相互制约的工作机制。

②公司建立授权审批控制，根据常规授权和特别授权的规定，明确各岗位办理业务和事项的权限范围、审批程序和相应责任。

公司编制常规授权的权限文件，规范特别授权的范围、权限、程序和责任，严格控制特别授权。公司各级管理人员应在授权范围内行使职权和承担责任。

公司对于重大的业务和事项，实行集体决策审批或者联签制度，任何个人不得单独进行决策或者擅自改变集体决策。

③公司建立会计系统控制，依法设置会计机构，配备会计从业人员，严格执行国家统一的会计准则制度，加强会计基础工作，明确会计凭证、会计账簿和财务会计报告的处理程序，保证会计资料真实完整。

④公司建立财产保护控制，建立财产日常管理机制和定期清查机制，采取财产记录、实物保管、定期盘点、账实核对等措施，确保财产安全。公司严格限制未经授权的人员接触和处置财产。

⑤公司建立预算控制，实施全面预算管理，明确各责任单位在预算管理中的职责权限，规范预算的编制、审定、下达和执行程序，强化预算约束。

⑥公司建立运营分析控制，综合运用业务、财务、风险等方面的信息，通过因素分析、对比分析、趋势分析等方法，定期开展运营情况分析，发现存在的问题，及时查明原因并加以改进。

⑦公司建立绩效考评控制，制定和实施绩效考评制度，科学设置考核指标体系，对公司内部各责任单位和全体员工的业绩进行定期考核和客观评价，将考评结果作为确定员工薪酬以及职务晋升、评优、降级、调岗、辞退等的依据。

3) 公司重点加强对关联交易、重大投资等活动的控制，并建立相应的控制政策和程序。

公司明确股东、董事会关于关联交易、重大投资的审批权限，严格执行相应的审议程序。

4) 公司关联交易的内部控制应遵循诚实信用、平等自愿、公平公开公允的



原则，确保交易行为规范；重大投资的内部控制应遵循合法、审慎、安全、有效的原则，控制投资风险、注重投资效益。

#### （5）信息与沟通

1) 公司建立信息与沟通制度，明确内部控制相关信息的收集、处理和传递程序，确保信息及时沟通，促进内部控制有效运行。

2) 公司建立畅通、高效的信息交流渠道和重大事项报告机制，明确内部控制相关信息的收集、处理和传递程序，确保信息在公司内部各管理级次、责任单位、业务环节之间，以及公司与外部投资者、债权人、客户、供应商、中介机构和监管部门等有关方面之间进行沟通和反馈。信息沟通过程中发现的问题，应及时报告并加以解决。

3) 公司严格履行监管部门规定的对外信息披露义务，按照规定的形式和渠道，全面、真实、及时地依法披露有关的信息内容。

4) 公司真实、全面、及时地记载各项业务，充分发挥会计的核算监督职能，确保信息资料的真实与完整；建立完备的业务台账系统，并通过业务台账系统和会计核算系统交叉印证，防止出现账外经营、账目不清等问题。

5) 公司利用信息技术促进信息的集成与共享，充分发挥信息技术在信息与沟通中的作用。公司加强对信息系统开发与维护、访问与变更、数据输入与输出、文件储存与保管、网络安全等方面的控制，保证信息系统安全稳定运行。

#### （6）内部控制的监督检查

1) 公司制定风险管理、监察稽核的规章制度，明确各部门在内部监督中的职责权限，规范内部监督的程序、方法和要求。

内部监督分为日常监督和专项监督。日常监督是指公司对建立与实施内部控制的情况进行常规、持续的监督检查；专项监督是指在公司发展战略、组织结构、经营活动、业务流程、关键岗位员工等发生较大调整或变化的情况下，对内部控制的某一或者某些方面进行有针对性的监督检查。

专项监督的范围和频率根据风险评估结果以及日常监督的有效性等予以确定。

2) 公司明确内部控制缺陷认定标准，建立健全内部控制缺陷的纠正与处理机制，对内部控制监督检查中发现的缺陷，分析缺陷的性质和产生原因，提出整

---

---

改方案，督促相关单位落实，并对落实情况进行跟踪检查，就内部监督中发现的重大缺陷，追究相关责任单位或者责任人的责任。

3) 各监督部门对监督检查中发现的内部控制缺陷，按照公司的相关工作程序进行报告；经理层对监督检查中发现的内部控制重大缺陷，向董事会、监事报告。

4) 公司负责稽核工作的职能部门结合内部监督情况，定期对内部控制的健全性和有效性进行跟踪评价。

5) 公司以书面或者其他适当的形式，妥善保存内部控制建立与实施过程中的相关记录或者资料，确保内部控制建立与实施过程的可验证性。

## 第四部分 集合计划托管人

### 一、托管人情况

#### (一) 托管人概况

名称：兴业银行股份有限公司(简称：“兴业银行”)

住所：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市银城路 167 号

法定代表人：吕家进

成立时间：1988 年 8 月 22 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

联系人：李润

联系电话：021-52629999-213107

#### (二) 发展概况及财务状况

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

开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。截至 2020 年 12 月 31 日，兴业银行资产总额达 7.89 万亿元，实现营业收入 2031.37 亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润 666.26 亿元。

#### (三) 托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、产品管理处、稽核监察处、运行管理处、养老金管理中心等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

#### (四) 基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业

务批准文号：证监基金字[2005]74号。截至2021年9月30日，兴业银行共托管证券投资基金486只，托管基金的基金资产净值合计20121.17亿元，基金份额合计19181.86亿份。

## 二、集合计划托管人的内部控制制度

### 1、内部风险控制目标

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

### 2、内部风险控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。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) 全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一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。

(2) 独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3) 相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

(5) 防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

(6) 有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何

人不得拥有不受内部控制约束的权力,内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正;

(7) 审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险,审慎经营,保证托管资产的安全与完整为出发点;托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则,在新设机构或新增业务时,做到先期完成相关制度建设;

(8) 责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人,并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

### 三、内部风险控制措施实施

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

2、建立健全的组织管理结构:前后台分离,不同部门、岗位相互牵制。

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

4、相对独立的业务操作空间:业务操作区相对独立,实施门禁管理和音像监控。

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

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

### 四、集合计划托管人对管理人运作基金进行监督和管理的方法和程序

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

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

---

---

人通知的违规事项未能在限期内纠正的,集合计划托管人应报告中国证监会。集合计划托管人发现管理人有重大违规行为,立即报告中国证监会,同时,通知管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

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

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

---

---

## 第五部分 相关服务机构

### 一、集合计划销售机构

#### 1、直销机构

申万宏源证券资产管理有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 40 层

联系人：罗奂萌、沈维婧

联系电话：010-88013646；010-88013650

客户服务电话：95523

传真：021-33388224

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

#### 2、其他销售机构：

(1) 申万宏源证券有限公司

公司网站：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

服务热线：95523

(2) 申万宏源西部证券有限公司

公司网站：[www.swhysc.com](http://www.swhysc.com)

服务热线：95523

(3) 上海天天基金销售有限公司

公司网站：<https://www.1234567.com.cn/>

服务热线：95021

(4) 上海攀赢基金销售有限公司

公司网站：<http://www.pytz.cn/>

服务热线：021-68889082

(5) 奕丰基金销售有限公司

公司网站：[www.ifastps.com.cn](http://www.ifastps.com.cn)

服务热线：400-684-0500

(6) 深圳市前海排排网基金销售有限责任公司

公司网站：[www.ppwfund.com](http://www.ppwfund.com)

服务热线：400-666-7388

(7) 大连网金基金销售有限公司

公司网站：[www.yibaijin.com](http://www.yibaijin.com)

服务热线：4000-899-100

(8) 贵州省贵文文化基金销售有限公司

公司网站：[www.gwcaifu.com](http://www.gwcaifu.com)

服务热线：0851-85407888

(9) 南京苏宁基金销售有限公司

公司网站：[www.snjjjin.com](http://www.snjjjin.com)

服务热线：95177

(10) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

公司网站：[www.antfortune.com](http://www.antfortune.com)

服务热线：95188

(11) 上海联泰基金销售有限公司

服务热线：400-118-1188

公司网站：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

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

## 二、集合计划登记机构

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号恒奥中心A座

办公地址：北京市西城区锦什坊街26号

法定代表人：于文强

联系人：赵亦清

全国统一客户服务电话：4008058058

网址：<http://www.chinaclear.cn>

## 三、出具法律意见的律师事务所



名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陈颖华

经办律师：黎明、陈颖华

#### 四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称：上会会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市静安区威海路 755 号 25 层

办公地址：上海市静安区威海路 755 号 25 层

执行事务合伙人：张健

联系电话：021-52920000

联系传真：021-52921369

经办注册会计师：陈大愚、江嘉炜

联系人：杨伟平

---

---

## 第六部分 集合计划的历史沿革

申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划由申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划变更而来。

申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，于 2012 年 7 月 4 日经中国证监会许可【2012】891 号文核准设立，自 2012 年 10 月 24 日起开始募集，于 2012 年 10 月 29 日结束募集工作，并于 2012 年 10 月 30 日正式成立。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，自 2022 年 10 月 13 日起，《申万宏源双季增享 6 个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

---

---

## 第七部分 集合计划的存续

变更为本集合计划后，本集合计划存续期限自集合计划合同生效之日起 3 年。

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

对于本集合计划 A 类、C 类计划份额设定锁定持有期，锁定持有期为 6 个月。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份集合计划份额自开放持有期首日起才能办理赎回及转换转出业务。

锁定持有期指集合计划份额申购确认日起（即锁定持有期起始日），至集合计划份额申购确认日 6 个月对日的前一日（即锁定持有期到期日）之间的区间，若该对应月份不存在对应日的，则顺延至该月最后一日，若该对日为非工作日的，则顺延至下一个工作日。A 类、C 类计划份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务。

A 类、C 类计划份额的锁定持有期结束后即进入开放持有期，期间可以办理赎回及转换转出业务，每份集合计划份额的开放持有期首日为锁定持有期到期日的下一个工作日。

对于投资者依据《申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划资产管理合同》认购或参与集合计划获得的申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划 B 类计划份额。在本集合计划存续期间，B 类份额每两周开放一次赎回，且赎回仅开放 1 天，不开放申购。管理人有权在 B 类计划份额开始办理赎回业务后确定开放赎回的首个周三，并在相关公告中公告。此后，每两周后的对应周的周三开放一次赎回（如遇节假日则当次不开放赎回）。

### 二、申购与赎回场所

申购与赎回应当在本集合计划的销售机构办理。本集合计划的销售机构包括集合计划管理人和管理人委托的销售机构，具体在集合计划招募说明书或其他相关公示中列明。集合计划管理人可根据实际情况变更或增减集合计划销售机构，并在集合计划管理人网站公示。

投资人应该在销售机构指定的营业场所按照指定的方式和程序办理申购、赎回等业务。销售机构也可以提供其他方式为投资人办理申购、赎回等业务。

### 三、申购与赎回的开放日及时间

### 1、开放日及开放时间

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

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

### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

集合计划管理人自集合计划合同生效之日起不超过 3 个月开始办理 A 类、C 类计划份额申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。此后的每个工作日为本集合计划的申购业务开放日。集合合同剩余存续期限不足 6 个月时，份额的申购及其锁定持有期届时根据管理人公告办理。

B 类份额每两周开放一次赎回，且赎回仅开放 1 天，不开放申购。管理人有权在 B 类计划份额开始办理赎回业务后确定开放赎回的首个周三，并在相关公告中公告。此后，每两周后的对应周的周三开放一次赎回（如遇节假日则当次不开放赎回）。

对于 A 类、C 类计划份额，集合计划份额的锁定持有期到期后，管理人开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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

集合计划管理人不得在集合计划合同约定之外的日期或者时间办理集合计划份额的申购、赎回或者转换。投资人在集合计划合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其集合计划份额申购、赎回价格为下一开放日集合计划份额申购、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的集合计划份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在集合计划管理人规定的时间以内按约定方

式撤销，具体规定参见招募说明书；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照登记机构份额登记时间的先后次序进行顺序赎回；

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

6、本集合计划份额分为多个类别，适用不同的申购费或销售服务费，投资者在申购时可自行选择A类或C类集合计划份额。

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

## 五、申购与赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

集合计划投资人必须根据集合计划销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向集合计划销售机构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，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。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。

集合计划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，集合计划管理人将在T+7日（包括该日）内支付赎回款项。如遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或集合计划合同约定的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照集合计划合同有关条款处理。

### 3、申购和赎回申请的确认

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

及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成立，则申购款项本金退还给投资人。管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并在调整实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上提前公告。

集合计划销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询。

## 六、申购和赎回的数量限制

1、投资人单笔申购及后续追加的最低金额为 1000 元（含申购费），投资者通过销售机构申购本集合计划时，除需满足管理人最低申购金额限制外，当销售机构设定的最低金额高于上述金额限制时，投资者应遵循相关销售机构的业务规定。

2、投资者可将其账户中持有的全部或部分份额赎回，持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 10 份。持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的份额余额不足 10 份的，在赎回时需一次全部赎回。

3、单个投资人累计持有的集合计划份额不设上限，但单个投资人持有集合计划份额占集合计划份额总数的比例上限不超过 50%（在集合计划运作过程中因份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外）。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

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

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

## 七、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、申购费用

B类计划份额只开放赎回，不开放申购。管理人仅办理A类、C类计划份额的申购业务。

投资者申购A类计划份额，需交纳申购费用。申购费用由申购A类计划份额的投资人承担，在投资人申购时收取，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、登记结算等各项费用。

投资者申购本集合计划A类计划份额的申购费率如下：

申购金额 (M)	适用申购费率
M < 100万元	0.5%
100万 ≤ M < 500万元	0.3%
M ≥ 500万元	1000元/笔

本集合计划C类计划份额不收取申购费，收取销售服务费。

## 2、赎回费用

本集合计划不收取赎回费用。本集合计划A类、C类计划份额设置6个月锁定持有期，6个月后方可赎回，赎回时不收取赎回费。本集合计划B类计划份额赎回时不收取赎回费。

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

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

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

## 八、申购份额、赎回金额的计算方式

### 1、集合计划申购份额的计算

#### (1) A类计划申购份额的计算：



当投资者选择申购本集合计划 A 类计划份额时，申购份额的计算方法如下：

① 申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下：

净申购金额=申购金额/（1+申购费率）

申购费用=申购金额-净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类计划份额的份额净值

② 申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类计划份额的份额净值

例：某投资人投资 10,000 元申购 A 类计划份额，申购费率为 0.5%，假设申购当日 A 类计划份额的份额净值为 1.0500 元，则其可得到的申购份额为：

净申购金额=10,000/（1+0.5%）=9,950.25 元

申购费用=10,000-9,950.25=49.75 元

申购份额=9,950.25/1.0500=9,476.43 份

即：该投资人投资 10,000 元申购 A 类计划份额，假定申购当日 A 类计划份额的份额净值为 1.0500 元，可得到 9,476.43 份 A 类计划份额。

（2）C 类计划申购份额的计算：

本集合计划 C 类计划份额不收取申购费，当投资者选择申购本集合计划 C 类份额时，申购份额的计算方法如下：

申购份额=申购金额/申购当日 C 类计划份额的份额净值

例：某投资人投资 10,000 元申购 C 类计划份额，假设申购当日 C 类计划份额的份额净值为 1.0500 元，则其可得到的申购份额为：

申购份额=10,000.00/1.0500=9,523.81 份

即：该投资人投资 10,000 元申购 C 类计划份额，假定申购当日 C 类计划份额的份额净值为 1.0500 元，可得到 9,523.81 份 C 类计划份额。

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。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。

2、业绩报酬及赎回金额的计算

本集合计划的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的该类集合计划份额净值为基准进行计算，本集合计划的赎回金额为赎回总额扣减业绩报酬（如有）。

当投资者赎回集合计划份额时，赎回金额的计算方法如下：

赎回总额=赎回份额×赎回当日该类计划份额净值

赎回金额=赎回总额－业绩报酬（如有）

上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

例：某投资者依据《申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划资产管理合同》认购或参与集合计划获得的申银万国灵通快利 7 天集合资产管理计划份额，自资产管理合同生效之日 2022 年 7 月 7 日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划 B 类计划份额，生效日 B 类计划份额净值为 1.0100 元，份额累计净值为 1.0200 元，转换份额数为 10,000 份；并于 2022 年 12 月 21 日赎回其持有的 B 类计划份额 10,000 份，赎回申请日 B 类计划份额净值为 1.0300 元，持有期间本集合计划未进行分红，赎回申请日 B 类计划份额累计净值为 1.0400 元，赎回确认日为 2022 年 12 月 22 日。该投资者持有 B 类计划份额期间为 2022 年 7 月 7 日（含）至 2022 年 12 月 22 日（不含），共计 168 日。

$$\text{业绩报酬} = \max \left\{ 10,000.00 \times 1.0100 \times \left( \frac{1.0400 - 1.0200}{1.0100} \times \frac{365}{168} - 4\% \right) \times 20\% \times \frac{168}{365}, 0 \right\} = 2.81 \text{ 元}$$

赎回总额=10,000×1.0300=10,300.00 元

赎回金额=10,300.00－2.81=10,297.19 元

即：持有人赎回 1 万份 B 类计划份额，持有期为 168 日，假设生效日 B 类计划份额净值为 1.0100 元，赎回当日 B 类计划份额净值为 1.0300 元，则扣除相应业绩报酬后其可得到 10,297.19 元。

### 3、集合计划份额净值计算

T 日集合计划份额净值=T 日集合计划资产净值/T 日发行在外的集合计划份额总数。

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

#### 九、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，集合计划管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致集合计划无法正常运转；
- 2、发生集合计划合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，集合计划管理人可暂停接受投资人的申购申请；
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致集合计划管理人无法计算当日集合计划资产净值；
- 4、集合计划管理人接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有集合计划份额持有人利益时；
- 5、集合计划资产规模过大，使集合计划管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对集合计划业绩产生负面影响，或发生其他损害现有集合计划份额持有人利益的情形；
- 6、当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，集合计划管理人应当暂停接受集合计划申购申请；
- 7、集合计划管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有集合计划份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形；
- 8、集合计划管理人、托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致集合计划销售系统、集合计划注册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集合计划管理人决定暂停接受投资人申购申请时，集合计划管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7 项情形时，管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，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，集合计划管理人应及时恢复申购业务的办理。

## 十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

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

- 1、因不可抗力导致集合计划管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生集合计划合同规定的暂停集合计划资产估值情况时,集合计划管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市,导致集合计划管理人无法计算当日集合计划资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、发生继续接受赎回申请将损害现有集合计划份额持有人利益的情形时,集合计划管理人可暂停接受集合计划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,集合计划管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受集合计划赎回申请。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

(3) 如发生单个开放日内单个集合计划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 20%时，管理人有权先行对该单个集合计划份额持有人超出 20%以上的部分赎回申请实施延期办理，管理人只接受其集合计划总份额 20%部分作为当日有效赎回申请，而对该单个集合计划份额持有人 20%以内（含 20%）的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”条款处理。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该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。

(4) 暂停赎回：连续 2 个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如集合计划管理人认为有必要，可暂停接受集合计划的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在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，集合计划管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在规定媒介上刊登公告。

## 十二、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

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

## 十三、集合计划转换

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

## 十四、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。

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

办理非交易过户必须提供集合计划登记机构要求提供的相关资料，对于符合

条件的非交易过户申请按集合计划登记机构的规定办理,并按集合计划登记机构规定的标准收费。

#### 十五、集合计划的转托管

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

#### 十六、定期定额投资计划

集合计划管理人可以为投资人办理定期定额投资计划,具体规则由管理人另行规定。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。

#### 十七、集合计划份额的冻结和解冻

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

集合计划账户或集合计划份额被冻结的,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,法律法规另有规定的除外。

#### 十八、集合计划份额的转让

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

#### 十九、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回

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

## 第九部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

本集合计划在追求本金安全、严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，力求为持有人提供超越业绩比较基准的稳健回报，实现集合计划资产长期稳健增值。

### 二、投资范围及资产配置比例

#### 1、投资范围

本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

#### 2、集合计划的投资组合比例

本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划总资产的80%；投资于股票、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划总资产的20%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种或对投资比例要求发生变更，集合计划管理人在履行适当程序后，可以相应调整本集合计划的投资范围和投资比例规定。

### 三、投资策略

坚持稳健投资，在严格控制风险的基础上，追求长期持续稳定的合理回报。



## 1、债券投资策略

### (1) 久期偏离策略

基于对未来利率水平的预测，对组合的期限和品种进行合理配置，将市场利率变化对于债券组合的影响控制在一定的范围之内。在预期利率进入上升周期时段，通过缩短债券组合的期限或增加浮动利率债券配置来达到降低利率风险的目的。在预期利率进入下降周期时段，通过增加债券组合的期限或减少浮动利率债券配置来达到降低利率风险的目的。

### (2) 类别选择策略

在固定收益品种板块配置时，将依据流动性管理的要求，来确定不同的类属配置。具体表现为：信用债板块收益率高，但流动性弱，而利率产品收益率低，但流动性强。因此，在债券整体配置上应当考虑信用债的获利能力和利率产品的流动性，实现平衡综合配置。

### (3) 相对价值策略

相对价值策略包括研究国债与金融债之间的信用利差、交易所与银行间的市场利差等。金融债与国债的利差由税收因素形成，利差的大小主要受市场资金供给充裕程度决定，资金供给越紧张上述利差将越大。交易所与银行间的联动性随着市场改革势必渐渐加强，两市之间的利差能够提供一些增值机会。

### (4) 个券选择策略

考虑到集合计划的流动性和收益要求，在配置固定收益证券时，将依照成交频率、成交频率波动率、月度平均成交金额、每日平均成交金额等指标，选择具有良好流动性和获利能力的个券进行投资。

### (5) 信用债投资策略

本计划综合分析宏观经济、利率市场、行业基本面和企业基本面等方面的数据，判断信用债（包含资产支持证券，下同）相对于利率产品的信用溢价，并结合市场情绪动态调整信用债的投资比例，以获得信用债的超额收益。

具体在信用债的个券选择上，本计划在风险控制的前提下，重点关注实际信用状况高于信用评级、预期信用评级上升、具备某些特殊优势条款、经风险调整后的收益率与市场收益率曲线相比具有相对优势的信用债。出于更为审慎的流动性及信用风险管理目的，本集合计划投资债券的信用评级不低于 AA 级，本集合

计划投资信用债将遵循以下比例限制，因信用债评级下降等原因导致不符合下列比例时，应当在 3 个月内调整至符合约定：

信用债的信用等级	各等级信用债资产占信用债总资产的比例
AA 级	0%-20%
AA+级	0%-50%
AAA 级	50%-100%

注：以上信用评级以债项评级为准，如无债项评级则参照主体评级。

针对可转债，本计划通过深入综合研究市场上的可转债，选取基本面优秀、股性和债性适中的标的投资，力求达到下跌风险有限，而上升收益可观的投资效果。

## 2、国债期货投资策略

本集合计划对国债期货的投资根据风险管理原则，以套期保值为目的。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。

## 3、股票投资策略

本集合计划管理人判断市场出现明显的趋势性投资机会时，本计划可以直接参与股票市场投资，努力获取超额收益。在股票市场投资过程中，本集合计划主要采取自下而上的投资策略，利用数量化投资技术与基本面研究相结合的研究方法，对以下三类上市公司进行投资：

- ①现金流充沛、行业竞争优势明显、具有良好的现金分红记录或现金分红潜力的优质上市公司；
- ②投资价值明显被市场低估的上市公司；
- ③未来盈利水平具有明显增长潜力且估值合理的上市公司。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

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

(2) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或

者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，前述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) 本管理人管理的全部公募证券投资基金及大集合产品持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金及大集合产品可以不受此条款规定的比例限制；

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

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

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

(8) 本管理人管理的全部公募证券投资基金及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) 本集合计划参与新股申购的金额不超过本集合计划的总资产，所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

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

(11) 本管理人管理的全部开放式基金及大集合产品持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金、大集合产品以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(12) 本集合计划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；

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

(14) 本集合计划参与国债期货交易,应当遵守下列要求:

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

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

3) 本集合计划所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合集合计划合同关于债券投资比例的有关约定;

4) 本集合计划在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 30%;

(15) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%;

(16) 法律法规及中国证监会规定的和集合合同约定的其他投资限制;

除第(2)、(12)、(13)条外,因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等集合计划管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的,集合计划管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本集合计划,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。

## 2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益,本集合计划禁止从事下列行为:

(1) 承销证券;

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

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本集合计划，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

本集合计划的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率\*90%+ 沪深 300 指数收益率\*10%。

本集合计划为债券型集合资产管理计划，本集合计划主要投资于债券，以中债综合全价（总值）指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%作为业绩比较基准，符合本集合计划的风险收益特征。中债综合全价（总值）指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成份券种包括除资产支持债券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势。沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、

流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

如果今后由于本集合计划业绩比较基准中所使用的指数更改名称、暂停或终止发布、或今后法律法规发生变化，或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用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，经集合计划管理人和托管人协商一致后，本集合计划可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开集合计划份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本集合计划为债券型集合资产管理计划，在通常情况下其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金、现金管理型集合计划，低于股票型基金、股票型集合计划、混合型基金和混合型集合计划。

## 七、集合计划管理人代表集合计划行使相关权利的处理原则及方法

- 1、有利于集合计划资产的安全与增值；
- 2、不谋求对上市公司的控股；
- 3、集合计划管理人按照国家有关规定代表集合计划独立行使相关权利，保护集合计划份额持有人的利益；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

## 九、集合计划的投资组合报告

集合计划管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导

性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

托管人兴业银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2024年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2024年9月30日，本报告所列财务数据未经审计。

#### 1、报告期末本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	24,326,401.12	10.21
	其中：股票	24,326,401.12	10.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	204,180,591.48	85.72
	其中：债券	194,177,632.58	81.52
	资产支持证券	10,002,958.90	4.20
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	7,255,784.82	3.05
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,930,991.78	0.81
8	其他资产	514,217.67	0.22
9	合计	238,207,986.87	100.00

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占集合计划资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	27,232.00	0.01
B	采矿业	489,393.00	0.21
C	制造业	14,677,055.04	6.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	467,502.00	0.20
E	建筑业	422,773.00	0.18
F	批发和零售业	319,405.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	498,568.00	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,666,599.08	0.72

J	金融业	5,264,302.00	2.26
K	房地产业	277,579.00	0.12
L	租赁和商务服务业	82,829.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	62,293.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	23,108.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,447.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	35,316.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	24,326,401.12	10.46

## (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本集合计划本报告期末未持有港股通投资股票。

## 3、期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占集合计划资产净值比例(%)
1	000725	京东方A	168,600	753,642.00	0.32
2	601688	华泰证券	40,700	716,320.00	0.31
3	601318	中国平安	12,100	690,789.00	0.30
4	601108	财通证券	78,200	681,904.00	0.29
5	600372	中航机载	51,561	668,230.56	0.29
6	000776	广发证券	29,100	485,970.00	0.21
7	000738	航发控制	19,500	428,025.00	0.18
8	000100	TCL科技	92,300	422,734.00	0.18
9	000001	平安银行	34,600	422,466.00	0.18
10	600030	中信证券	14,600	397,120.00	0.17

## 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占集合计划资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,571,350.68	8.85
	其中：政策性金融债	20,571,350.68	8.85
4	企业债券	34,764,212.32	14.95
5	企业短期融资券	5,103,460.38	2.20
6	中期票据	26,034,234.57	11.20
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	19,655,066.52	8.45



9	其他	88,049,308.11	37.87
10	合计	194,177,632.58	83.53

#### 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	101901358	19 港兴港投 MTN003	200,000	20,911,885.25	9.00
2	242400005	24 农行永续债 01	200,000	20,515,178.08	8.82
3	112414188	24 江苏银行 CD188	200,000	19,655,066.52	8.45
4	092280108	22 中行二级资本债 02A	150,000	15,722,057.38	6.76
5	242380028	23 绍兴银行永续债 01	100,000	11,065,792.35	4.76

#### 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	263355	24 华发 5A	100,000	10,002,958.90	4.30

#### 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

注：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

注：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

##### (1) 本期国债期货投资政策

无

##### (2) 报告期末本集合计划投资的国债期货持仓和损益明细

注：本报告期本集合计划无国债期货交易。

##### (3) 本期国债期货投资评价

注：本报告期本集合计划无国债期货交易。

#### 10、投资组合报告附注

(1) 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中,中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、国家开发银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及集合计划合同的要求。

除此之外,本集合计划投资的其他前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚的情形。

(2) 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本集合计划投资的前十名股票未出现超出集合计划合同规定的备选股票库的情形。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,180.01
2	应收证券清算款	510,037.66
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	514,217.67

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本报告期末本集合计划未持有可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本报告期末本集合计划前十名股票中不存在流通受限情况。

(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,投资组合报告中市值占净值比例的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

集合计划业绩截止日为2024年9月30日。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

### 1、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

申万宏源双季增享6个月债券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
过去三个 月	1.49%	0.15%	1.81%	0.13%	-0.32%	0.02%
过去六个 月	2.38%	0.12%	2.58%	0.11%	-0.20%	0.01%
过去一年	3.54%	0.12%	4.20%	0.10%	-0.66%	0.02%
自集合计 划合同生 效起至今	6.39%	0.10%	4.75%	0.10%	1.64%	0.00%

申万宏源双季增享6个月债券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
过去三个 月	1.57%	0.15%	1.81%	0.13%	-0.24%	0.02%
过去六个 月	2.52%	0.12%	2.58%	0.11%	-0.06%	0.01%
过去一年	3.84%	0.12%	4.20%	0.10%	-0.36%	0.02%

自集合计划合同生效起至今	7.06%	0.10%	4.48%	0.10%	2.58%	0.00%
--------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

申万宏源双季增享6个月债券C

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.44%	0.15%	1.81%	0.13%	-0.37%	0.02%
过去六个月	2.27%	0.12%	2.58%	0.11%	-0.31%	0.01%
过去一年	3.30%	0.12%	4.20%	0.10%	-0.90%	0.02%
自集合计划合同生效起至今	5.90%	0.10%	4.75%	0.10%	1.15%	0.00%

注：本集合计划合同变更生效日为2022年10月13日，申万宏源双季增享6个月债券A类份额和申万宏源双季增享6个月债券C类份额首次确认日是2022年10月27日。

2、自集合计划合同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

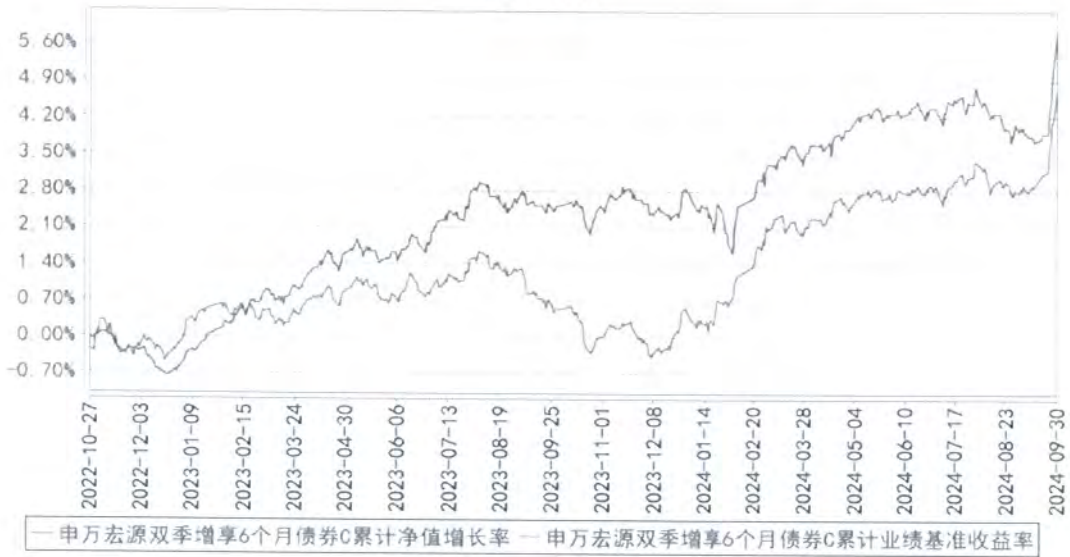
申万宏源双季增享6个月债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



申万宏源双季增享6个月债券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



### 申万宏源双季增享6个月债券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：申万宏源双季增享6个月债券A类份额和申万宏源双季增享6个月债券C类份额首次确认日是2022年10月27日。

## 第十一部分 集合计划的财产

### 一、集合计划资产总值

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

其构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、清算备付金及其应收利息；
- 3、根据有关规定缴纳的保证金；
- 4、应收证券交易清算款；
- 5、应收申购款；
- 6、债券投资及其估值调整 and 应计利息；
- 7、股票投资及其估值调整；
- 8、其他投资及其估值调整；
- 9、其他资产等。

### 二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

### 三、集合计划财产的账户

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

### 四、集合计划财产的保管和处分

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



---

---

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

## 第十二部分 集合计划资产估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

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

### 三、估值原则

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

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

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

2、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。

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

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券，以估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日可转换债券收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券以及交易所上市的资产支持证券品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。若第三方估值机构无估值数据，且估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

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

##### 2、处于未上市期间的有价证券，应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌

的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

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

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

3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对银行间市场未上市，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、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

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

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

7、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。

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集合计划合同

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

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

## 五、估值程序

1、各类集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，该类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。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。

管理人于每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。本集合计划 B 类计划份额的计划份额净值和集合计划份额累计净值为未扣除集合计划管理人业绩报酬前的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值，集合计划份额持有人实际赎回/转出/清算金额以登记机构确认数据为准。

2、集合计划管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但集合计划管理人根据法律法规或集合计划合同的规定暂停估值时除外。集合计划管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将集合计划份额净值结果发送集合计划托管人，经集合计划托管人复核无误后，由集合计划管理人对外公布。

## 六、估值错误的处理

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

集合计划合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

损失按下述“估值错误处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

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

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

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

七、暂停估值的情形

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

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

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

4、中国证监会和集合计划合同认定的其它情形。

八、集合计划净值的确认

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

九、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

十、特殊情况的处理

---

---

1、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，或国家会计政策变更、市场规则变更等原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划份额净值计算错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。



## 第十三部分 集合计划的收益与分配

### 一、集合计划利润的构成

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

### 二、集合计划可供分配利润

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

### 三、集合计划收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若资产管理合同当年生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式仅现金分红一种方式；

3、集合计划收益分配后，收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值；

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

5、当日申购成立的集合计划份额自下一个工作日起享有本集合计划的分配权益；当日赎回成立的集合计划份额自下一工作日起，不享有本集合计划的分配权益；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 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，并须经托管人复核，在 2 日内在规定媒介公告。

#### 六、集合计划收益分配中发生的费用

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。

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

## 第十四部分 集合计划费用与税收

### 一、集合计划费用的种类

- 1、集合计划管理人的固定管理费；
- 2、集合计划托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、集合计划管理人的业绩报酬；
- 5、集合计划合同生效后与集合计划相关的信息披露费用，法律法规另有规定的除外；
- 6、集合计划合同生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 7、集合计划份额持有人大会费用；
- 8、集合计划的证券、期货等交易费用；
- 9、集合计划的银行汇划费用；
- 10、账户开户费用、账户维护费用；
- 11、按照国家有关规定和集合计划合同约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

本集合资产管理计划终止清算时所发生费用，按实际支出额从集合计划资产总值中扣除。

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、集合计划管理人的固定管理费

本集合计划 A 类、C 类计划份额的固定管理费按前一日集合计划资产净值的 0.5% 年费率计提，B 类计划份额的固定管理费按前一日集合计划资产净值的 0.2% 年费率计提。各类计划份额的固定管理费的计算方法如下：

$$H = E \times \text{各类计划份额年固定管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类计划份额应计提的集合计划固定管理费

E 为前一日该类计划份额的集合计划资产净值

集合计划固定管理费每日计提，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，由托管人于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中一

次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## 2、集合计划托管人的托管费

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

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

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## 3、销售服务费

销售服务费可用于本集合计划市场推广、销售以及份额持有人服务等各项费用。本集合计划 A、B 类计划份额不收取销售服务费，C 类计划份额的销售服务费年费率为 0.3%。C 类计划份额的销售服务费按前一日 C 类计划份额资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div 365$$

H 为 C 类集合计划份额应计提的销售服务费

E 为 C 类集合计划份额前一日的集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，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，由托管人于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人，集合计划管理人收到后按照相关协议支付给各销售机构。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## 4、集合计划管理人的业绩报酬

集合计划管理人对本集合计划 B 类计划份额提取业绩报酬，A 类、C 类计划份额不提取业绩报酬。

对于 B 类计划份额，本集合计划采用逐笔计提法提取业绩报酬，若单个集合计划份额持有人的单笔份额在其持有期间的年化收益率超过业绩报酬计提基准（4%）时，按照超过业绩报酬计提基准部分的 20% 提取业绩报酬。本集合计划业绩报酬在集合计划份额持有人赎回/转出集合计划份额或集合计划合同终止

清算时收取。

(1) 计提起始日

业绩报酬计提起始日为集合计划合同生效日。

(2) 计提基准日

集合计划份额持有人申请赎回或转出集合计划份额时，计提基准日为集合计划份额持有人提出申请赎回或转出集合计划份额的工作日；集合计划合同终止时，计提基准日为集合计划最后运作日。

(3) 计提基准及比例

本集合计划业绩报酬计提基准为 4%，业绩报酬计提比例为超过业绩报酬计提基准部分的 20%。因法律法规、监管政策调整而需要修订业绩报酬计提基准和计提比例的，无需召开集合计划份额持有人大会。

(4) 计提方式

在集合计划份额持有人申请赎回或转出集合计划份额时，业绩报酬从赎回款项或转出金额中计提；在集合计划合同终止时，业绩报酬从集合计划合同终止清算资金中计提。

(5) 业绩报酬计算方式

$$\text{业绩报酬} = \max \left\{ Q \times P \times \left( \frac{P_1 - P_0}{P} \times \frac{365}{T} - 4\% \right) \times 20\% \times \frac{T}{365}, 0 \right\}$$

其中：

Q：应计提业绩报酬的集合计划份额数量

P<sub>1</sub>：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提基准日的集合计划份额累计净值

P<sub>0</sub>：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提起始日的集合计划份额累计净值

P：应计提业绩报酬的集合计划份额在计提起始日的集合计划份额净值

T：应计提业绩报酬的集合计划份额在业绩报酬计提周期内的实际持有自然天数（即集合计划合同生效日（含）至赎回/转出/终止清算确认日（不含）间的自然天数）

业绩报酬按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位。因取值精度原因，实际业绩报酬计提结果以登记机构计算结果为准。因涉及相关数据，集合计划管理人的业绩报酬的计算和复核工作由集合计划管理人完成，相关信息以登记机构计算结果为准。

### （6）业绩报酬的支付

在集合计划份额持有人赎回/转出集合计划份额、集合计划合同终止清算时，集合计划管理人依据上述公式计算业绩报酬，业绩报酬从赎回/转出/清算资金中计提，由赎回/转出/清算资金承担。集合计划托管人根据集合计划管理人指令支付给集合计划管理人业绩报酬，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延；业绩报酬以集合计划管理人提供的数据为准。

上述“一、集合计划费用的种类”中第5—11项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由集合计划托管人从集合计划财产中支付。

### 三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

- 1、集合计划管理人和集合计划托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划财产的损失；
- 2、集合计划管理人和集合计划托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；
- 3、集合计划合同生效前的相关费用，前述费用根据《申银万国灵通快利7天集合资产管理计划资产管理合同》的约定执行；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目。

### 四、实施侧袋机制期间的集合计划费用

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

### 五、集合计划税收

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

## 第十五部分 集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

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

### 二、集合计划的年度审计

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

## 第十六部分 集合计划的信息披露

一、本集合计划的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、集合计划合同及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

- 1、虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2、对证券投资业绩进行预测；
- 3、违规承诺收益或者承担损失；
- 4、诋毁其他集合计划管理人、集合计划托管人或者集合计划销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 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、集合计划合同、集合计划托管协议、产品资料概要

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

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

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

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

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

(二) 集合计划合同生效公告

集合计划管理人应当在规定媒介上登载集合计划合同生效公告。

### （三）集合计划净值信息

集合计划合同生效后，在开始办理申购或者赎回前，集合计划管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

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

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

集合计划管理人披露的B类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值为未扣除集合计划管理人业绩报酬前的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值，集合计划份额持有人实际赎回/转出/清算金额以登记机构确认数据为准。

### （四）集合计划份额申购、赎回价格

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

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

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

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

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

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

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

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

#### (六) 临时报告

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

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

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

裁；

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

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

13、集合计划收益分配事项；

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

15、任一类集合计划份额净值估值错误达该类集合计划份额净值百分之零点五；

16、本集合计划开始办理申购、赎回；

17、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；

18、本集合计划连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

19、本集合计划暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

20、发生涉及集合计划申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

21、集合计划管理人采用摆动定价机制进行估值；

22、集合计划延长集合计划合同期限等相关事宜；

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

#### （七）澄清公告

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

#### （八）集合计划份额持有人大会决议

集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （九）投资资产支持证券的信息披露

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

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

#### （十）投资国债期货的信息披露

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

#### （十一）业绩报酬提取情况

管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告中披露业绩报酬收取情况，包括业绩报酬提取总金额等。

#### （十二）实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### （十三）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

集合计划托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和集合计划合同的约定，对集合计划管理人编制的集合计划资产净值、各类集合计划份额净值、

集合计划份额申购赎回价格、集合计划定期报告、更新的招募说明书、产品资料概要、清算报告等公开披露的相关集合计划信息进行复核、审查，并向集合计划管理人进行书面或电子确认。

集合计划管理人、集合计划托管人应当在规定的报刊中选择一家报刊披露本资产管理计划信息。集合计划管理人、集合计划托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的集合计划信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

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

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

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

依法必须披露的信息发布后，集合计划管理人、集合计划托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，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信息：

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

2、因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

3、发生暂停集合计划估值的情形时；

4、法律法规规定、中国证监会或资产管理合同认定的其他情形。

九、本集合计划信息披露事项以法律法规规定及本章节约定的内容为准。

## 第十七部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

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

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

### 二、实施侧袋机制期间集合计划份额的申购与赎回

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

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

3、除管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“集合计划份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的 10% 认定。

### 三、实施侧袋机制期间的集合计划投资

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

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

管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### 四、实施侧袋机制期间的集合计划估值

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

#### 五、实施侧袋账户期间的集合计划费用

1、本集合计划实施侧袋机制的，集合计划固定管理费、集合计划托管费、销售服务费及业绩报酬按主袋账户集合计划资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取集合计划固定管理费及业绩报酬（如有）。

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

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

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

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

#### 七、侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

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

##### 2、集合计划净值信息

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

##### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，管理人应当在定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信



---

---

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

八、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，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，管理人经与托管人协商一致并履行适当程序后，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。

## 第十八部分 风险揭示

### 一、投资本集合计划的风险

#### 1、市场风险

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

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

(2) 经济周期风险。证券市场是国民经济的晴雨表，随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，集合计划投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

(3) 利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。集合计划投资于债券，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

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

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

(6) 公司经营风险。公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果集合计划所投资的公司经营不善，其证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使集合计划投资收益下降。虽然集合计划可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

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

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

### (9) 衍生品风险

金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

## 2、管理风险

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

管理人和托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响集合计划收益水平。

## 3、流动性风险

集合计划的流动性风险主要表现在两方面：一是在某种情况下因市场交易量不足，某些投资品种的流动性不佳，可能导致证券不能迅速、低成本地转变为现金，进而影响到集合计划投资收益的实现；二是在本集合计划的开放期内投资人的连续大量赎回将会导致集合计划的现金支付出现困难，或迫使集合计划以不适当的价格大量抛售证券，使集合计划的净值增长率受到不利影响。

### (1) 集合计划申购、赎回安排

本集合计划申购、赎回安排详见集合计划合同“第六部分 集合计划份额的申购与赎回”章节及本招募说明书“第八部分 集合计划份额的申购与赎回”章节。

### (2) 拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本集合计划的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所；从投资品种来看，本集合计划大部分投资标的都是在证券交易所上市的有价证券，或是在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，这些标的往往存在公开交易市场、具有活跃的交易特性、估值政策清晰，因此，可以在一定程度上保障投资品种的流动性。

### （3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

根据《流动性风险管理规定》的相关要求，管理人对本集合计划实施流动性风险管理，并针对性制定流动性风险管理措施，尽量避免或减小因发生流动性风险而导致的投资者损失，最大程度的降低巨额赎回情形下的可能出现的流动性风险。

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：当集合计划管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

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

③如发生单个开放日内单个集合计划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20%时，管理人有权先行对该单个集合计划份额持有人超出20%以上的部分赎回申请实施延期办理，管理人只接受其集合计划总份额20%部分作为当日有效赎回申请，而对该单个集合计划份额持有人20%

以内(含20%)的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述“(1)全额赎回”或“(2)部分延期赎回”条款处理。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该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。延期部分如选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。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。

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

(4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响  
在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时,管理人将以保障投资者合法权益为前提,严格按照法律法规及集合计划合同的规定,谨慎选取暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、延期办理巨额赎回申请、暂停集合计划估值、摆动定价、实施侧袋机制等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用,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,管理人将密切关注市场资金动向,提前调整投资和头寸安排,尽可能的避免出现不得不实施上述流动性风险管理工具的流动性风险,将对投资者可能出现的潜在影响降至最低。

#### (5) 实施侧袋机制对投资者的影响

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

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

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

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

#### 4、本集合计划特有风险

(1) 本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划总资产的80%；投资于股票、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划总资产的20%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、公司基本面和资产的深入研究，坚持稳健投资，在严格控制风险的基础上，持续优化组合配置，以控制特定风险。

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

(3) 本集合计划投资资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。价格波动风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券市场规模及

交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。信用风险指的集合计划所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成集合计划财产损失。

(4) 本集合计划对于 A 类计划份额、C 类计划份额设置 6 个月锁定持有期，集合计划份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务。自锁定持有期结束后即进入开放持有期，可以办理赎回及转换转出业务。因此 A 类计划份额、C 类计划份额集合计划份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回集合计划份额的风险。

(5) 本集合计划 B 类计划份额采用逐笔计提法提取业绩报酬，其每日披露的集合计划份额净值为未扣除集合计划管理人业绩报酬前的集合计划份额净值。由于赎回/转出或者集合计划终止清算时集合计划管理人可能计提业绩报酬，投资者实际赎回/转出/清算金额，以登记机构确认数据为准。此外，B 类计划份额每两周开放一次赎回，且赎回仅开放 1 天，如遇节假日则当次不开放赎回，故投资者在其余时间内还将不能赎回集合计划份额的风险。

#### 5、操作或技术风险

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

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

#### 6、合规性风险

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

#### 7、其他风险

- (1) 因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- (2) 因集合计划业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等

---

---

方面不完善而产生的风险；

- (3) 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
- (4) 对主要业务人员如集合计划经理的依赖而可能产生的风险；
- (5) 因战争、自然灾害等不可抗力导致的管理人、集合计划其他销售机构等机构无法正常工作，从而影响集合计划的申购、赎回按正常时限完成的风险。

## 二、声明

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

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



## 第十九部分 集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算

### 一、集合计划合同的变更

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

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

### 二、集合计划合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，集合计划合同应当终止：

- 1、集合计划合同期限届满；
- 2、集合计划份额持有人大会决定终止的；
- 3、集合计划管理人、集合计划托管人职责终止，在 6 个月内没有新集合计划管理人、新集合计划托管人承接的；
- 4、集合计划合同约定的其他情形；
- 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：自出现集合计划合同终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，集合计划管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、集合计划财产清算的公告

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

#### 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由集合计划托管人保存，保存期限不少于法律法规的规定。

## 第二十部分 集合计划合同的内容摘要

### 一、集合计划份额持有人、管理人及托管人的权利义务

#### (一) 集合计划管理人的权利与义务

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

(1) 依法募集资金；

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

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

(4) 销售集合计划份额；

(5) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；

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

(7) 在集合计划托管人更换时，提名新的集合计划托管人；

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

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

(10) 依据集合计划合同及有关法律规规定决定集合计划收益的分配方案；

(11) 在集合计划合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(12) 依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使股东权利，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) 以集合计划管理人的名义，代表集合计划份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

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

(16) 在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关集合计划申购、赎回、转换的业务规则；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他权利。

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

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

(2) 办理集合计划备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受集合计划托管人的监督；

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

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

露前应予保密，不向他人泄露；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他义务。

(二) 集合计划托管人的权利与义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

(6) 在集合计划管理人更换时，提名新的集合计划管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

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

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

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

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

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

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与集合计划管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和集合计划合同的规定监督集合计划管理人的投资运作；

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

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

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

(20) 按规定监督集合计划管理人按法律法规和集合计划合同规定履行自己

的义务，集合计划管理人因违反集合计划合同造成集合计划财产损失时，应为集合计划份额持有人利益向集合计划管理人追偿；

(21) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他义务。

### (三) 集合计划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集合计划合同的承认和接受，集合计划投资者自依据集合计划合同取得集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人，直至其不再持有本集合计划的集合计划份额。集合计划份额持有人作为集合计划合同当事人并不以在集合计划合同上书面签章或签字为必要条件。

同一类别每份集合计划份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享集合计划财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余集合计划财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的集合计划份额；

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

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

(6) 查阅或者复制公开披露的集合计划信息资料；

(7) 监督集合计划管理人的投资运作；

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

(9) 法律法规及中国证监会规定的和本集合计划合同约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守本集合计划合同、招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资集合计划产品，了解自身风险承受能力，自主判断集合计划



的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 接受管理人或销售机构要求的风险承受能力调查和评价，如实提供身份信息、投资经验、财产状况、风险认知等相关信息，并保证所提供资料、信息的真实性、准确性、完整性；

(4) 关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；

(5) 交纳集合计划申购款项及法律法规和本集合计划合同所规定的费用；

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

(7) 不从事任何有损集合计划及其他本集合计划合同当事人合法权益的活动；

(8) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(9) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(10) 法律法规及中国证监会规定的和本集合计划合同约定的其他义务。

## 二、集合计划份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

本集合计划份额持有人大会不设日常机构。在本集合计划存续期内，根据本集合计划的运作需要，份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。

### (一) 召开事由

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

(1) 终止集合计划合同；

(2) 更换集合计划托管人或（和）管理人；

(3) 转换集合计划运作方式；

(4) 调整集合计划管理人、集合计划托管人的报酬标准或提高赎回费率、销售服务费率，但法律法规要求调整该等报酬标准或提高赎回费率、销售服务费率的除外；

(5) 变更集合计划类别；

- (6) 本集合计划与其他集合资产管理计划的合并;
- (7) 变更集合计划投资目标、范围或策略;
- (8) 变更集合计划份额持有人大会程序;
- (9) 集合计划管理人或集合计划托管人要求召开集合计划份额持有人大会;
- (10) 单独或合计持有本集合计划总份额10%以上(含10%)集合计划份额的集合计划份额持有人(以管理人或托管人收到提议当日的集合计划份额计算,下同)就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会;
- (11) 对集合计划合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- (12) 法律法规、集合计划合同或中国证监会规定的其他应当召开集合计划份额持有人大会的事项。

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

- (1) 法律法规要求增加的集合计划费用的收取;
- (2) 增加、减少、调整本集合计划份额类别设置或调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或调整收费方式;
- (3) 集合计划管理人、登记机构、销售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;
- (4) 因相应的法律法规发生变动而应当对集合计划合同进行修改;
- (5) 对集合计划合同的修改对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及集合计划合同当事人权利义务关系发生变化;
- (6) 集合计划管理人将本集合计划合同项下权利义务转让给其以独资方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司;
- (7) 公募基金业绩报酬相关法律法规公布后,本集合计划合同约定的业绩报酬相关条款根据法律法规进行调整;
- (8) 按照法律法规和集合计划合同规定不需召开集合计划份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或集合计划合同另有约定外,集合计划份额持有人大会由

集合计划管理人召集。

2、集合计划管理人未按规定召集或不能召开时，由集合计划托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

#### (四) 集合计划份额持有人出席会议的方式

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

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

(1) 亲自出席会议者持有集合计划份额的凭证、受托出席会议者出具的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、集合计划合同和会议通知的规定,并且持有集合计划份额的凭证与集合计划管理人持有的登记资料相符;

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

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

在同时符合以下条件时,通讯开会的方式视为有效:

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

(2)召集人按集合计划合同约定通知集合计划托管人(如果集合计划托管人为召集人,则为集合计划管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在集合计划托管人(如果集合计划托管人为召集人,则为集合计划管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取集合计划份额持有人的表决意见;集合计划托管人或集合计划管理人经通知不参加收取表决意见的,不影响表决效力;

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

(4) 上述第(3)项中直接出具表决意见的集合计划份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人,同时提交的持有集合计划份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的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、集合计划合同和会议通知的规定,并与集合计划登记机构记录相符。

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

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

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### (1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为集合计划管理人授权出席会议的代表,在集合计划管理人授权代表未能主持大会的情况下,由集合计划托管人授权其出席会议的代表主持;如果集合计划管理人授权代表和集合计划托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大

会的集合计划份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名集合计划份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人。集合计划管理人和集合计划托管人拒不出席或主持集合计划份额持有人大会，不影响集合计划份额持有人大会作出的决议的效力。

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

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## （七）计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

### 2、通讯开会

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

## （八）生效与公告

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

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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



文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

#### （九）实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。

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

### 三、集合计划合同的终止事由、程序与集合计划资产的清算

#### (一) 集合计划合同的终止事由

有下列情形之一的,经履行相关程序后,集合计划合同应当终止:

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

#### (二) 集合计划财产的清算

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

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序:

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

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认;

(3) 对集合计划财产进行估值和变现;

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

### (三) 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。

### (四) 集合计划财产清算剩余资产的分配

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

### (五) 集合计划财产清算的公告

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

### (六) 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由集合计划托管人保存，保存期限不少于法律法规的规定。

## 四、争议解决方式

各方当事人同意，因集合计划合同而产生的或与集合计划合同有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方有权将上述争议提交上海仲裁委员会，按照申请仲裁时该会现行有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。争议处理期间，集合计划合同当事人应恪

---

---

守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行集合计划合同规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

集合计划合同受中国法律管辖。

## 五、集合计划合同的存放地及投资者取得方式

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

## 第二十一部分 集合计划托管协议的内容摘要

### 一、集合计划托管协议当事人

#### (一) 集合计划管理人(“管理人”)

名称：申万宏源证券资产管理有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路989号40层

法定代表人：袁锦

设立日期：2022年12月20日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监许可  
[2022]2615号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2,500,000,000元

存续期限：持续经营

股权结构：申万宏源证券有限公司持有100%的股份

经营范围：许可项目：证券业务。(依法须经批准的项目，经相关部门批准  
后方可开展经营活动，具体经营项目以相关部门批准文件或许可证件为准)

#### (二) 集合计划托管人(“托管人”)

名称：兴业银行股份有限公司(简称：兴业银行)

住所：福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦

办公地址：上海市

邮政编码：200120

法定代表人：吕家进

联系方式：021-52629999

成立日期：1988年08月22日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2005】74号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币207.74亿元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；

办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；代理发行股票以外的有价证券；买卖、代理买卖股票以外的有价证券；资产托管业务；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇业务；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；财务顾问、资信调查、咨询、见证业务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务（以上范围凡涉及国家专项专营规定的从其规定）。

## 二、集合计划托管人对集合计划管理人的业务监督和核查

（一）集合计划托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对集合计划投资范围、投资对象进行监督。《集合计划合同》明确约定集合计划投资风格或证券选择标准的，集合计划管理人应按照集合计划托管人要求的格式提供投资品种池，以便托管人运用相关技术系统，对集合计划实际投资是否符合《集合计划合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、央行票据、金融债券（含次级债券）、政策性金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）、证券公司发行的短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据）、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划总资产的80%；投资于股票、可转换债券（含分离交易可转债、可交换债券）等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划总资产的20%；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，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种或对投资比例要求

发生变更，集合计划管理人在履行适当程序后，可以相应调整本集合计划的投资范围和投资比例规定。

(二)集合计划托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对集合计划投资、融资比例进行监督。集合计划托管人按下述比例和调整期限进行监督：

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

(2)每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，前述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发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的10%；

(4)本管理人管理的全部公募证券投资基金及大集合产品持有一家发行的证券，不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金及大集合产品可以不受此条款规定的比例限制；

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

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

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

(8)本管理人管理的全部公募证券投资基金及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)本集合计划参与新股申购的金额不超过本集合计划的总资产，所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

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

(11) 本管理人管理的全部开放式基金及大集合产品持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金、大集合产品以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(12) 本集合计划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；

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

(14) 本集合计划参与国债期货交易，应当遵守下列要求：

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

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

3) 本集合计划所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合集合计划合同关于债券投资比例的有关约定；

4) 本集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的30%；

(15) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的140%；

(16) 法律法规及中国证监会规定的和集合合同约定的其他投资限制；

除第(2)、(12)、(13)条外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等集合计划管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，集合计划管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

集合计划管理人应当自集合计划合同生效之日起6个月内使集合计划的投资



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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本集合计划，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。

(三) 集合计划托管人根据有关法律法规的规定及集合计划合同的约定，对本托管协议项下的集合计划投资禁止行为进行监督。集合计划托管人通过事后监督方式对集合计划管理人集合计划投资禁止行为进行监督。

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本集合计划，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) 集合计划托管人根据有关法律法规的规定及集合计划合同的约定，对集合计划管理人参与银行间债券市场进行监督。

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

集合计划管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷，集合计划托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在集合计划托管人与

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

（五）集合计划托管人对集合计划投资银行存款进行监督。

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

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

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

集合计划管理人对定期存款提前支取的损失由其承担。

（六）集合计划托管人依据有关法律法规的规定、集合计划合同和本托管协议的约定对于集合计划关联交易进行监督。

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

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

根据法律法规有关集合计划从事的关联交易的规定，集合计划管理人和集合计划托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司名单，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。集合计划管理人及集合计划托管人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后集合计划管理人及集合计划托管人应及时发送另一方，另一方于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。一方收到另一方书面确认后，新的关联交易名单开始生效。

(七) 集合计划托管人根据有关法律法规的规定及集合计划合同的约定，对集合计划资产净值计算、各类集合计划份额净值、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。

(八) 集合计划托管人发现集合计划管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、集合计划合同和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知集合计划管理人限期纠正。

集合计划管理人应积极配合和协助集合计划托管人的监督和核查。集合计划管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给集合计划托管人发出回函，就集合计划托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，集合计划托管人有权随时对通知事项进行复查，督促集合计划管理人改正。集合计划管理人对集合计划托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，集合计划托管人应报告中国证监会。如果集合计划托管人未能切实履行监督职责，导致集合计划出现风险或造成集合计划资产损失的，集合计划托管人应承担相应责任。

(九) 集合计划管理人有义务配合和协助集合计划托管人依照法律法规、集

合计划合同和本托管协议对集合计划业务执行核查。

对集合计划托管人发出的书面提示，集合计划管理人应在规定时间内答复并改正，或就集合计划托管人的疑义进行解释或举证；对集合计划托管人按照法律法规、集合计划合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的事项，集合计划管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(十)若集合计划托管人发现集合计划管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反集合计划合同约定的，应当立即以书面或以双方认可的其他方式通知集合计划管理人，由此造成的相应损失由集合计划管理人承担。

(十一)集合计划托管人发现集合计划管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知集合计划管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。集合计划管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经集合计划托管人提出警告仍不改正的，集合计划托管人应报告中国证监会。

### 三、集合计划管理人对集合计划托管人的业务核查

(一)集合计划管理人对集合计划托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括集合计划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、复核集合计划管理人计算的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值、根据集合计划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。

(二)集合计划管理人发现集合计划托管人擅自挪用集合计划财产、未对集合计划财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行集合计划管理人资金划拨指令、泄露集合计划投资信息等违反《基金法》、《集合计划合同》、本协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知集合计划托管人限期纠正。集合计划托管人收到通知后应及时核对并以书面形式给集合计划管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，集合计划管理人有权随时对通知事项进行复查，督促集合计划托管人改正。集合计划托管人应积极配合集合计划管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供集合计划管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复集合计划管理人并改

正。

(三) 集合计划管理人发现集合计划托管人有重大违规行为, 应及时报告中国证监会, 同时通知集合计划托管人限期纠正, 并将纠正结果报告中国证监会。集合计划托管人无正当理由, 拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权, 或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督, 情节严重或经集合计划管理人提出警告仍不改正的, 集合计划管理人应报告中国证监会。

#### 四、集合计划财产的保管

##### (一) 集合计划财产保管的原则

1. 集合计划财产应独立于集合计划管理人、集合计划托管人的固有财产。
2. 集合计划托管人应安全保管集合计划财产。
3. 集合计划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. 集合计划托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户, 确保集合计划财产的完整与独立。
5. 集合计划托管人按照《集合计划合同》和本协议的约定保管集合计划财产, 如有特殊情况双方可另行协商解决。集合计划托管人未经集合计划管理人的指令, 不得自行运用、处分、分配本集合计划的任何资产(不包含集合计划托管人依据中国证券登记结算有限责任公司结算数据完成场内交易交收、开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用)。
6. 对于因为集合计划投资产生的应收资产, 应由集合计划管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知集合计划托管人, 到账日集合计划财产没有到达集合计划账户的, 集合计划托管人应及时通知集合计划管理人采取措施进行催收。由此给集合计划财产造成损失的, 集合计划管理人应负责向有关当事人追偿集合计划财产的损失, 集合计划托管人对此不承担任何责任。
7. 除依据法律法规和《集合计划合同》的规定外, 集合计划托管人不得委托第三人托管集合计划财产。

##### (二) 集合计划银行账户的开立和管理

1. 集合计划托管人应以集合计划的名义在其营业机构开立集合计划的银行账户, 并根据集合计划管理人合法合规的指令办理资金收付。本集合计划的银行

预留印鉴由集合计划托管人保管和使用。

2.集合计划银行账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。集合计划托管人和集合计划管理人不得假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户；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。

3.集合计划银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

4.在符合法律法规规定的条件下，集合计划托管人可以通过集合计划托管人专用账户办理集合计划资产的支付。

### （三）集合计划证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1.集合计划托管人在中国证券登记结算有限责任公司为集合计划开立集合计划托管人与集合计划联名的证券账户。

2.集合计划证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本集合计划业务的需要。集合计划托管人和集合计划管理人不得出借或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。

3.集合计划证券账户的开立和证券账户卡的保管由集合计划托管人负责，账户资产的管理和运用由集合计划管理人负责。

4.集合计划托管人以集合计划托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的集合计划完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，集合计划管理人应予以积极协助。

5.账户注销时，在遵守中国证券登记结算公司的相关规定下，由管理人和托管人协商确认主要办理人。账户注销期间，主要办理人如需另一方提供配合的，另一方应予以配合。

6.若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许集合计划从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则集合计划托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

### （四）债券托管专户的开设和管理

《集合计划合同》生效后，集合计划管理人负责以集合计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表集合计划进行交易；集合计划托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市

场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表集合计划进行银行间市场债券的结算。集合计划管理人和集合计划托管人共同代表集合计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （五）其他账户的开立和管理

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

2.法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （六）集合计划财产投资的有关有价凭证等的保管

集合计划财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由集合计划托管人存放于集合计划托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由集合计划托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按集合计划管理人和集合计划托管人双方约定办理。集合计划托管人对由集合计划托管人以外机构实际有效控制或保管的资产不承担任何责任。

#### （七）与集合计划财产有关的重大合同的保管

与集合计划财产有关的重大合同的签署，由集合计划管理人负责。由集合计划管理人代表集合计划签署的、与集合计划财产有关的重大合同的原件分别由集合计划管理人、集合计划托管人保管。除本协议另有规定外，集合计划管理人代表集合计划签署的与集合计划财产有关的重大合同包括但不限于集合计划年度审计合同、集合计划信息披露协议及集合计划投资业务中产生的重大合同，集合计划管理人应保证集合计划管理人和集合计划托管人至少各持有一份正本的原件。集合计划管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给集合计划托管人，并在三十个工作日内将正本送达集合计划托管人处。重大合同的保管期限不少于法律法规规定的期限。

对于无法取得二份以上的正本的，集合计划管理人应向托管人提供加盖公章的合同传真件，未经双方协商一致，合同原件不得转移。

## 五、集合计划资产净值计算与复核

### （一）集合计划资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的金额。各类集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，该类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。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。

每个交易日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计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。本集合计划 B 类份额的计划份额净值和集合计划份额累计净值为未扣除集合计划管理人业绩报酬前的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值，集合计划份额持有人实际赎回/转出/清算金额以登记机构确认数据为准。

2. 集合计划管理人应在每个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对集合计划资产估值。但集合计划管理人根据法律法规或《集合计划合同》的规定暂停估值时除外。集合计划管理人每个交易日对集合计划资产估值后，将各类集合计划份额净值结果发送集合计划托管人，经集合计划托管人复核无误后，由集合计划管理人对外公布。T 日的集合计划份额净值在 T 日收市后计算，并在 T+1 日内进行公告。

### （二）集合计划资产估值方法和特殊情形的处理

#### 1. 估值对象

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

#### 2. 估值方法

##### （1）证券交易所上市的有价证券的估值

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



最近交易市价，确定公允价格；

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

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

④交易所上市交易的可转换债券，以估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日可转换债券收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

⑤交易所上市不存在活跃市场的有价证券以及交易所上市的资产支持证券品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值。若第三方估值机构无估值数据，且估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

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

(2) 处于未上市期间的有价证券，应区分如下情况处理：

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

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

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

(3) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提

供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对银行间市场未上市，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) 国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(5) 存款的估值方法：持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

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

(7) 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。

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

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

### (三) 集合计划份额净值错误的处理方式

1. 当任一类集合计划份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视

为该类集合计划份额净值错误；集合计划份额净值出现错误时，集合计划管理人应当立即予以纠正，通报集合计划托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到该类集合计划份额净值的 0.25% 时，集合计划管理人应当通报集合计划托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类集合计划份额净值的 0.5% 时，集合计划管理人应当公告，并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由集合计划管理人负责处理，由此给集合计划份额持有人和集合计划造成损失的，应由集合计划管理人先行赔付，集合计划管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

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

(1) 本集合计划的集合计划会计责任方由集合计划管理人担任，与本集合计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按集合计划管理人的建议执行，由此给集合计划份额持有人和集合计划财产造成的损失，由集合计划管理人负责赔付。

(2) 若集合计划管理人计算的集合计划份额净值已由集合计划托管人复核确认后公告，而且集合计划托管人未对计算过程提出疑义或要求集合计划管理人书面说明，集合计划份额净值出错且造成集合计划份额持有人损失的，管理人及托管人应根据法律法规的规定对投资者或集合计划支付赔偿金。

(3) 如集合计划管理人和集合计划托管人对集合计划份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布集合计划份额净值的情形，以集合计划管理人的计算结果对外公布，由此给集合计划份额持有人和集合计划造成的损失，由集合计划管理人负责赔付。

(4) 由于集合计划管理人提供的信息错误（包括但不限于集合计划申购或赎回金额等），进而导致集合计划份额净值计算错误而引起的集合计划份额持有人和集合计划财产的损失，由集合计划管理人负责赔付。

3. 由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划份额净值计算错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取

必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

4. 集合计划管理人和集合计划托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以集合计划管理人计算结果为准。

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

#### （四）暂停估值与公告集合计划份额净值的情形

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

2. 因不可抗力致使集合计划管理人、集合计划托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4. 中国证监会和《集合计划合同》认定的其他情形。

#### （五）集合计划会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （六）集合计划账册的建立

集合计划管理人进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告。集合计划管理人、托管人分别独立地设置、记录和保管本集合计划的全套账册。若集合计划管理人和集合计划托管人对会计处理方法存在分歧，应以集合计划管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到集合计划资产净值的计算和公告的，以集合计划管理人的账册为准。

#### （七）集合计划财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

集合计划财务报表由集合计划管理人编制，集合计划托管人复核。

##### 2. 报表复核

集合计划托管人在收到集合计划管理人编制的集合计划财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知集合计划管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

### (1) 报表的编制

集合计划管理人应当在季度结束之日起15个工作日内完成集合计划季度报告的编制；在上半年结束之日起两个月内完成集合计划中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成集合计划年度报告的编制。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。《集合计划合同》生效不足两个月的，集合计划管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

### (2) 报表的复核

集合计划管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供集合计划托管人复核；集合计划托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，集合计划管理人和集合计划托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

集合计划管理人应留足充分的时间，便于集合计划托管人复核相关报表及报告。

(八) 集合计划管理人应在编制季度报告、中期报告或者年度报告之前及时向集合计划托管人提供集合计划业绩比较基准的基础数据和编制结果。

## 五、集合计划份额持有人名册的登记与保管

集合计划份额持有人名册至少应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登记机构根据集合计划管理人的指令编制和保管，集合计划管理人和集合计划托管人应分别保管集合计划份额持有人名册，保存期不少于法律法规的规定。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

集合计划托管人不得将所保管的集合计划份额持有人名册用于集合计划托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 六、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方有权将上述争议提交上海仲裁委员会，按照申请仲裁时该会现行有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对双方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守集合计划管理人和集合计划托管人职责，

---

---

各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《集合计划合同》和本托管协议规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 七、托管协议的修改与终止

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《集合计划合同》的规定有任何冲突。集合计划托管协议的变更报中国证监会备案。

### （二）托管协议终止的情形

- 1.《集合计划合同》终止；
- 2.集合计划托管人解散、依法被撤销、破产或由其他集合计划托管人接管集合计划资产；
- 3.集合计划管理人解散、依法被撤销、破产或由其他集合计划管理人接管集合计划管理权；
- 4.发生法律法规或《集合计划合同》规定的终止事项。

## 第二十二部分 对集合计划份额持有人的服务

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

### （一）交易资料的确认服务

集合计划合同生效后，对T日提交的有效申请，投资人可在T+2个工作日后通过销售机构的网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询和打印交易确认单，对于通过管理人购买本集合计划的客户可在T+1个工作日后通过客户服务电话95523、管理人网站（[www.swhyzcgl.com](http://www.swhyzcgl.com)）查询交易确认情况。集合计划管理人不向投资者寄送交易确认单。

### （二）客服电话服务

客服电话人工座席每个交易日（9：00-17：00）为集合计划投资人提供服务，客服热线服务内容包括业务咨询、服务投诉等专项服务。

客服热线：95523

### （三）电子查询服务

通过管理人购买本集合计划的集合计划投资人可通过集合计划管理人网上查询系统、手机app完成集合计划账户的查询业务。

官方网站：[www.swhyzcgl.com](http://www.swhyzcgl.com)

### （四）投诉受理服务

集合计划投资者可以拨打客服电话，对集合计划管理人及申万宏源证券有限公司、申万宏源西部证券有限公司的销售网点所提供的服务进行投诉。

对于工作日期间受理的投诉，以“及时回复”为处理原则，对于不能及时回复的投诉，集合计划管理人承诺在3个工作日之内对集合计划投资者的投诉做出回复。对于非工作日提出的投诉，集合计划投资者将在顺延到下1个工作日进行回复。

（五）请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

---

---

## 第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式

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



## 第二十四部分 备查文件

(一) 中国证监会准予申银万国灵通快利7天集合资产管理计划变更为申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划的文件

(二) 申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同

(三) 申万宏源双季增享6个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议

(四) 法律意见书

(五) 管理人业务资格批件、营业执照

(六) 托管人业务资格批件、营业执照

(七) 中国证监会要求的其他文件

上述备查文件存放在管理人和其他销售机构的办公场所和营业场所,投资者可免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

洞



申万宏源证券资产管理有限公司

二〇二四年十一月十三日

