

财达证券股份有限公司

财达证券稳达三个月滚动持有债券型
集合资产管理计划
招募说明书（更新）
（2025 年第 2 号）



管理人：财达证券股份有限公司

托管人：招商银行股份有限公司

二〇二五年九月

重要提示

财达证券稳达三个月滚动持有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”）由财达证券稳达三号集合资产管理计划变更而来，财达证券稳达三号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管理办法》（证监会令第87号）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（证监会公告〔2012〕29号）、《财达证券稳达三号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，财达证券稳达三号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2月21日《【关于准予财达证券稳达三号集合资产管理计划合同变更的回函】》（证监许可【2022】324号）批准，自2022年3月28日起，《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《财达证券稳达三号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会批准，但中国证监会对财达证券稳达三号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、资产管理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，谨慎做出投资决策，并通过管理人或管理人委托的具有基金销售业务资格的其他销售机构购买集合计划。

本集合计划投资于证券市场，集合计划净值会因为证券市场波动等因素产生波动，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。

对于每份集合计划份额，管理人仅在该集合计划份额的每个运作期到期日为持有人办理赎回，在非运作期到期日，管理人不能为持有人办理赎回，且本集合计划不上市交易，因此持有人面临流动性风险。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该计划份额进入下一个运作期。在下一个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能赎回集合计划份额，集合计划份额持有人持有的集合计划份额将面临滚动运作的风险。本集合计划名称为财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划，但是考虑到周末、法定节假日等非工作日原因，每份集合计划份额的每个实际运作期期限或有不同，可能长于或短于三个月。投资者应当在熟悉并了解本集合计划运作规则的基础上，结合自身投资目标、投资期限等情况审慎作出投资决策，及时行使赎回权利。本集合计划的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

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

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。

本次更新招募说明书，更新了集合计划的存续期限。除非另有说明，本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2025 年 1 月 24 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2024 年 12 月 31 日（财务数据未经审计）。

目 录

第一部分 绪言.....	1
第二部分 释义.....	2
第三部分 管理人.....	8
第四部分 托管人.....	36
第五部分 相关服务机构.....	44
第六部分 集合计划的基本情况.....	50
第七部分 集合计划的历史沿革.....	52
第八部分 集合计划的存续.....	53
第九部分 集合计划份额的申购与赎回.....	54
第十部分 集合计划的投资.....	65
第十一部分 集合计划的业绩.....	75
第十二部分 集合计划的财产.....	77
第十三部分 集合计划资产估值.....	78
第十四部分 集合计划的收益与分配.....	85
第十五部分 集合计划费用与税收.....	87
第十六部分 集合计划的会计与审计.....	90
第十七部分 集合计划的信息披露.....	91
第十八部分 侧袋机制.....	98
第十九部分 风险揭示.....	101
第二十部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算.....	108
第二十一部分 资产管理合同的内容摘要.....	110
第二十二部分 集合计划托管协议的内容摘要.....	131
第二十三部分 对集合计划份额持有人的服务.....	148
第二十四部分 其他应披露事项.....	150
第二十五部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	157
第二十六部分 备查文件.....	158

第一部分 绪言

《财达证券稳达三个月滚动持有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《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”或“《资产管理合同》”）编写。

本招募说明书阐述了财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划的投资目标、策略、风险、费率等与投资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。

本招募说明书依据资产管理合同编写，并经中国证监会批准。资产管理合同是约定集合计划当事人之间权利义务的法律文件。投资者自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和资产管理合同的当事人，其持有集合计划份额的行为本身即表明对资产管理合同的承认和接受，并按照《基金法》、资产管理合同及其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，应详细查阅资产管理合同。

第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合计划或本集合计划：指财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

2、管理人：指财达证券股份有限公司

3、托管人：指招商银行股份有限公司

4、资产管理合同、《资产管理合同》：指《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》及对资产管理合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指管理人与托管人就本集合计划签订之《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

7、产品资料概要：指《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新

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

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

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

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

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

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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

19、合格境外机构投资者：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：指依资产管理合同和招募说明书合法取得集合计划份额的投资人

23、集合计划销售业务：指管理人或销售机构宣传推介集合计划，办理集合计划份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指财达证券股份有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与管理人签订了集合计划销售服务协议，办理集合计划销售业务的机构

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财达证券股份有限公司

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、资产管理合同生效日：本《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日，《财达证券稳达三号集合资产管理计划资产管理合同》同日失效

30、资产管理合同终止日：指资产管理合同规定的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：指原《财达证券稳达三号集合资产管理计划资产管理合同》生效至资产管理合同终止之间的期限

32、运作期起始日：对于资产管理合同生效前相应计划份额而言，第一个运作期起始日指资产管理合同生效日；对于每份申购份额而言，第一个运作期起始日指该计划份额申购确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份计划份额的下一运作期起始日，指该计划份额上一运作期到期日后的下一日

33、运作期到期日：对于每份计划份额，第一个运作期到期日指资产管理合同生效日（对资产管理合同生效前相应计划份额而言，下同）或计划份额申购申请日（对申购份额而言，下同）满 3 个月对应的月度对日，第二个运作期到期

日为资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满 6 个月对应的月度对日，第三个运作期到期日为资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满 9 个月对应的月度对日，以此类推

34、月度对日：指资产管理合同生效日（对资产管理合同生效前相应计划份额而言，下同）或计划份额申购申请日（对申购份额而言，下同）在后续日历月中的对应日期，如没有对应日期或该日为非工作日的，则顺延至下一工作日

35、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

36、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

37、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

38、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

39、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

40、《业务规则》：指本集合计划登记机构办理登记业务的相应规则，由集合资产管理计划管理人和投资人共同遵守

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

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

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

44、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

45、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

46、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%

47、元：指人民币元

48、集合计划收益：指集合计划投资所得债券利息、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

49、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

50、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

51、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

52、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

53、计划份额类别：指根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同将本计划份额分为不同的类别，各计划份额类别分别设置代码，并分别计算和公告计划份额净值。其中，A类计划份额指在投资人申购计划份额时收取申购费用，不从本类别计划资产中计提销售服务费的计划份额；C类计划份额指在投资人申购计划份额时不收取申购费用，而是从本类别计划资产中计提销售服务费的计划份额

54、销售服务费：指从计划财产中计提的，用于本计划市场推广、销售以及计划份额持有人服务的费用

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

56、摆动定价机制：指当开放式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，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待

57、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

58、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

59、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

60、不可抗力：指资产管理合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分 管理人

一、管理人概况

名称：财达证券股份有限公司（以下简称“本公司”）

住所：石家庄市自强路 35 号

办公地址：石家庄市自强路 35 号

法定代表人：张明

设立日期：2002 年 4 月 25 日

批准设立机关及批准设立文号：【中国证监会证监机构字[2002]81 号】

组织形式：股份有限公司

注册资本：3,245,000,000 元

存续期限：持续经营

联系电话：【021-60609079】

联系人：【杨玉冰】

股权结构：截止 2024 年 9 月 30 日，公司股权结构如下表所示：

序号	股东名称	持股数量（股）	持股比例（%）
1	唐山钢铁集团有限责任公司	1,052,631,050	32.44
2	河北省国有资产控股运营有限公司	441,780,550	13.61
3	河北港口集团有限公司	340,000,000	10.48
4	唐山港口实业集团有限公司	80,000,000	2.47
5	唐山金海资产开发投资有限公司	67,088,000	2.07
6	河钢集团投资控股有限公司	62,280,000	1.92
7	秦皇岛市财信资产事务中心	58,150,400	1.79
8	保定市财信商贸有限公司	45,910,800	1.41
9	河北建设投资集团有限责任公司	40,000,000	1.23
10	河北国傲投资集团有限公司	34,425,000	1.06
11	其他股东	1,022,734,200	31.52
合计		3,245,000,000	100.00

二、主要人员情况

1、集合计划管理人董事会、监事会成员、高级管理人员

（1）董事会成员

截至 2025 年 1 月 24 日，本公司第四届董事会共有董事 11 名，其中独立董事 4 名，职工董事 1 名。公司现任 11 名董事的基本情况如下表所示：

姓名	职务	本届任期	任职资格批复
张 明	董事长	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案
王陇刚	董事	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案
庄立明	董事	2024 年 12 月-2027 年 12 月	冀证监许可[2017]8 号
孙 鹏	董事	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案
郭爱文	董事	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案
唐建君	董事	2024 年 12 月-2027 年 12 月	冀证监许可[2017]10 号
韩 旭	职工董事	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案
李长皓	独立董事	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案
王慧霞	独立董事	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案
韩永强	独立董事	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案
贺季敏	独立董事	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案

本公司各董事的简历如下：

张明先生，1968 年 8 月出生，硕士研究生，中级经济师，中国国籍，无境外永久居留权

1993 年 8 月至 1996 年 8 月，任河北新兴铸管石家庄公司办公室主任；1996 年 8 月至 2002 年 3 月，历任河北财达证券公司办公室职员、石家庄和平东路证券营业部经理、公司总经理助理、经纪业务部经理；2002 年 4 月至 2010 年 2 月，历任河北财达证券经纪有限责任公司总经理助理、经纪业务部经理、业务总监、副总经理、董事会秘书；2010 年 2 月至 2016 年 7 月，历任财达证券有限责任公司副总经理、董事会秘书、总经理、董事、党委常委；2016 年 7 月至 2021 年 8 月，任财达证券股份有限公司总经理、副董事长、董事、董事会秘书、党委常委；2021 年 8 月至 2022 年 2 月，任财达证券股份有限公司总经理、副董事长、董事、党委常委；2022 年 2 月至 2024 年 2 月，任财达证券股份有限公司党委副书记、副董事长、董事、总经理；2024 年 3 月至 2024 年 3 月，任财达证券股份有限公司党委书记、副董事长、董事、总经理；2024 年 3 月至 2024 年 7 月，任财达证

券股份有限公司党委书记、副董事长、董事、总经理、合规负责人（代为履职）；2024年7月至今，任财达证券股份有限公司党委书记、董事长、董事、总经理。张明先生目前还担任上海证券交易所理事会会员自律管理委员会委员、深圳证券交易所理事会会员自律管理委员会委员、河北省证券期货业协会会长。

王陇刚，男，1985年2月出生，大学本科学历，学士学位，正高级会计师、中国注册会计师、注册税务师、资产评估师，中国国籍，无境外永久居留权

2009年7月至2010年2月，河钢矿业公司庙沟铁矿财务科科员；2010年2月至2016年5月，历任河钢矿业公司资产财务部科员、利税科副科长、利税科科长；2016年5月至2017年8月，任河钢融资租赁有限公司、河钢商业保理有限公司业务运营部副经理（主持工作）；2017年8月至2019年4月，任河钢融资租赁有限公司业务运营部经理（主持工作）；2019年4月至2019年12月，河钢集团供应链管理有限公司市场部副部长（主持工作）；2019年12月至2020年4月，河钢集团供应链管理有限公司市场部副部长（主持工作）、铁铁智慧物流(天津)有限公司副总经理；2020年4月至2020年11月，河钢集团投资控股有限公司总经理、河钢集团供应链管理有限公司市场部副部长（主持工作）、铁铁智慧物流(天津)有限公司副总经理；2020年11月至2021年3月，河钢集团投资控股有限公司总经理、铁铁智慧物流(天津)有限公司副总经理；2021年3月至2021年7月，河钢集团资产财务部副总经理、河钢集团供应链管理有限公司二级专家（公司副职级）、河钢集团投资控股有限公司总经理、铁铁智慧物流(天津)有限公司副总经理；2021年7月至2021年11月，河钢集团资产财务部副总经理、河钢集团供应链管理有限公司二级专家（公司副职级）、河钢集团投资控股有限公司总经理；2021年11月至2022年12月，河钢集团资产财务部副总经理、河钢集团供应链管理有限公司二级专家（公司副职级）、河钢集团投资控股有限公司执行董事（法定代表人）、总经理；2022年12月至今，河钢集团资产财务部总经理，河钢集团投资控股有限公司执行董事（法定代表人）、总经理，河钢集团供应链管理有限公司外部董事、二级专家（公司副职级），河北张宣高科科技有限公司外部董事；2024年9月，任财达证券股份有限公司董事。

庄立明先生，1966年3月出生，大学本科学历，会计师，中国国籍，无境外永久居留权

1986年7月至1993年7月，任河北省商业厅审计处外派审计科员；1993年7月至1999年7月，任河北华联商厦深州商场副经理；1999年7月至2000年12月，任河北省贸易厅财审处会计；2000年12月至2004年3月，任河北省商贸集团财审处主任科员；2004年3月至2007年1月，任河北省工贸资产经营有限公司财务监督处副处长、财务监督部副部长；2007年1月至2016年11月，历任河北省国有资产控股运营有限公司财务监督部部长、副总会计师、董事；2016年11月至2022年1月，任河北省国有资产控股运营有限公司董事、总会计师；2022年1月至今，任河北省国有资产控股运营有限公司总会计师；2017年9月至今任财达证券股份有限公司董事。

孙鹏先生，1975年11月出生，大学本科学历，硕士学位，中国国籍，无境外永久居留权

1998年7月至1998年10月，任秦皇岛港六分公司科员；1998年11月至2003年3月，任秦港集团经营处科员；2003年4月至2008年5月，任秦港集团投资中心科员、副科长；2008年6月至2010年7月，任秦港集团企发部副科长、科长；2010年8月至2011年11月，任河北港口集团投资发展部处长；2011年12月至2013年9月，任河北港口集团战略发展部处长、科长；2013年10月至2016年4月，任河北港口集团投资管理中心副主任；2016年5月至2020年9月，任河北港口集团投资管理有限公司副总经理；2017年10月至2019年9月，兼任河北港口集团资本运营部副部长；2020年11月至今，任河北港口集团（天津）投资管理有限公司总经理；2021年6月至今，任财达证券股份有限公司董事。孙鹏先生目前还担任河北省资产管理有限公司、池州中安招商股权投资管理有限公司董事。

郭爱文，男，1967年7月出生，硕士研究生，正高级会计师，中国国籍，无境外永久居留权

1989年8月至1993年6月，任石家庄市食品公司职员；1993年6月至1995年12月，任石家庄市食品集团公司批发经营公司财务科长；1995年12月至2002年4月，历任河北财达证券公司华西营业部主管会计、河北财达证券公司财务部经理、总经理助理；2002年4月至2010年2月，历任河北财达证券经纪有限责任公司财务负责人、合规负责人；2010年2月至2016年7月，历任财达证券有

限责任公司合规负责人、副总经理；2016年7月至2024年7月，任财达证券股份有限公司副总经理；2024年7月至2024年8月，任财达证券股份有限公司董事、副总经理；2024年9月至今，任财达证券股份有限公司党委常委、董事、副总经理。郭爱文先生目前还担任财达期货有限公司董事长。

唐建君女士，1973年6月出生，大学本科学历，正高级会计师，中国注册会计师，中国国籍，无境外永久居留权

1995年9月至2000年10月，历任保定天威集团有限公司内审部审计员、资产财务部会计、党群工作部党务干事；2000年10月至2006年2月，任唐山钢铁股份有限公司财务处会计；2006年2月至2008年8月，历任唐钢集团资产财务部会计、高级主办；2008年8月至2014年6月，历任河钢集团资产财务部资金管理处副处长、处长、资产财务部主任会计师、河钢集团财务有限公司财务总监；2014年6月至2017年8月，任河钢集团财务有限公司董事、总经理；2017年8月入职财达证券并于2017年12月任财达证券股份有限公司董事；2018年1月至2024年8月，任财达证券股份有限公司董事、副总经理、财务负责人；2024年9月至今，任财达证券股份有限公司党委常委、董事、副总经理、财务负责人。唐建君女士目前还担任财达资本管理有限公司董事。

韩旭先生，1985年11月出生，大学本科学历，学士学位，中国国籍，无境外永久居留权

2009年7月至2014年10月，石家庄钢铁有限责任公司财务部职员；2014年11月至2015年4月，石钢京城装备技术有限公司财务部资金科副科长；2015年5月至2016年5月，河钢集团有限公司借调；2016年6月至2020年6月，河钢融资租赁有限公司、河钢商业保理有限公司风险控制部副经理、总经理；2020年7月至2021年5月，河钢融资租赁有限公司董事、副总经理；2021年6月至2024年7月，财达证券股份有限公司职工董事、固定收益融资总部副总经理；2024年8月至今，财达证券股份有限公司职工董事、投资银行业务委员会副主任兼战略客户部总经理。韩旭先生目前还担任财达企管咨询总经理、达盛贸易总经理。

李长皓先生，1982年7月出生，硕士研究生学历，律师，中国国籍，无境外永久居留权

2008年7月至2010年9月，任北京市中闻律师事务所律师助理；2010年10月至2012年7月，任北京市炜衡律师事务所律师；2012年8月至今，任国浩律师（北京）事务所律师、合伙人；2020年8月至今，任财达证券股份有限公司独立董事。

王慧霞女士，1963年10月出生，博士研究生，教授职称，中国国籍，无境外永久居留权

1984年7月至1998年10月，任河北财经学校教师；1998年11月至2009年9月，任河北经贸大学会计学院教师；2009年10月至2023年10月，任河北经贸大学经济管理学院教师；2022年6月至今，任财达证券股份有限公司独立董事。

韩永强先生，1972年9月出生，硕士研究生，高级会计师、中国注册会计师，中国国籍，无境外永久居留权

1994年9月至1997年8月，任河北省国际信托投资公司内审；2000年4月至2002年3月，任河北省国际信托投资公司建华大街证券营业部副经理；2002年4月至2005年3月，任中国民族证券石家庄建华大街营业部副总经理；2005年4月至2005年9月，任明天控股有限公司合规专员；2005年10月至2006年9月，任河北先河科技发展有限公司总裁财务助理；2006年10月至2011年3月，任河北省国有资产控股运营有限公司资本运营部副部长；2011年4月至2011年10月，任廊坊市国土土地开发建设投资有限公司副总经理；2011年11月至2015年4月，任廊坊发展股份有限公司常务副总、总经理、副董事长；2015年5月至2016年10月，任廊坊市投资控股集团有限公司董事兼常务副总；2016年11月至今，任玖峰管理咨询有限公司董事长兼总经理；2019年2月至今，兼任河北云为网络科技有限公司董事长兼总经理；2022年6月至今，任财达证券股份有限公司独立董事。韩永强先生目前还担任石家庄万信达会计师事务所有限公司注册会计师、河北经贸大学硕士研究生导师。

贺季敏女士，1976年11月出生，硕士研究生，副教授，中国国籍，无境外永久居留权

1996年8月至2003年8月，任河北省肥乡县屯庄营中心校教师（期间：于1998年9月至2000年6月在河北大学法学专业学习，取得本科学历、学士学位）；

2003年9月至2006年6月，在中国政法大学法学专业学习，取得研究生学历、硕士学位；2006年9月至今任河北地质大学教师（期间：于2020年9月至今在华东政法大学法学专业学习，在读博士）；2023年11月至今，任财达证券股份有限公司独立董事。贺季敏女士目前还担任北京盈科（石家庄）律师事务所律师。

（2）监事会成员

截止到2025年1月24日，本公司第四届监事会共有监事5名，其中职工监事2名。公司现任5名监事的基本情况如下表所示：

姓名	职务	本届任期	任职资格批复
苏东淼	监事会主席 职工监事	2024年12月-2027年12月	任职备案
苏 动	监事	2024年12月-2027年12月	冀证监许可[2017]4号
李建海	监事	2024年12月-2027年12月	冀证监许可[2018]3号
苏新娣	监事	2024年12月-2027年12月	任职备案
苑俊婷	职工监事	2024年12月-2027年12月	任职备案

苏东淼先生，1981年9月出生，大学本科学历，硕士学位，中国国籍，无境外永久居留权

2005年9月至2009年9月，保定市供水总公司员工；2009年9月至2012年9月，保定市公用事业局工程建设管理处副处长、团委书记；2012年9月至2013年10月，财达证券有限责任公司党委办公室主任；2013年10月至2014年3月，财达证券有限责任公司总经理办公室主任、党委办公室主任；2014年3月至2016年7月，财达证券有限责任公司党委常委、纪委书记；2016年7月至2023年9月，财达证券股份有限公司党委常委、纪委书记（其间：2019年1月至2019年7月在中国雄安集团挂职，任纪检审计部副部长）；2023年9月至2023年9月，财达证券股份有限公司党委副书记、纪委书记；2023年10月至2024年6月，财达证券股份有限公司党委副书记、纪委书记、监事会主席、职工监事；2024年7月至2024年8月，财达证券股份有限公司党委副书记、监事会主席、职工监事；2024年8月至今，财达证券股份有限公司党委副书记、监事会主席、职工监事、工会主席。

苏动先生，1969年2月出生，大学专科学历，会计师，中国国籍，无境外永久居留权

1987年9月至1998年9月，任石家庄轴承设备股份有限公司财务主管；1998

年9月至2000年9月，任浙江帅康电器公司石家庄分公司财务部部长；2000年9月至2004年1月，任河北新兴格力电器销售有限公司财务部部长；2004年1月至2013年1月，任保定京海房地产开发有限公司副总经理；2013年1月至2017年10月，任石家庄鹏泰置业投资有限公司副总经理；2013年1月至今，任国傲投资监事、副总经理；2017年7月至今，任财达证券股份有限公司监事。苏动先生目前还担任河北电机股份有限公司等11家公司董事、中科宇能科技发展有限公司等9家公司监事。

李建海先生，1971年12月出生，大学本科学历，律师，经济师，中国国籍，无境外永久居留权

1995年11月至2004年11月历任石家庄建工集团有限公司三分公司合同预算科科长、办公室主任；2004年11月至2005年8月任石家庄建工集团有限公司法律事务部副部长；2005年8月至2022年4月，历任河北省国有资产控股运营有限公司资产管理中心项目经理、法律事务部副部长、部长；2022年4月至今，任河北省国有资产控股运营有限公司总法律顾问；2023年6月至今，任河北省国有资产控股运营有限公司首席合规官；2018年6月至今，任财达证券股份有限公司监事。李建海先生目前还担任邢台钢铁有限责任公司监事、石家庄仲裁委员会仲裁员。

苏新娣女士，1980年3月出生，本科学历，高级会计师，注册税务师，中国国籍，无境外永久居留权

2000年3月至2003年3月，京唐港务局财务处出纳；2003年3月至2003年6月，唐山港口投资有限公司投资管理部管理员；2003年6月至2009年4月，唐山港集团股份有限公司计划财务部会计；2009年4月至2018年2月，唐山港集团股份有限公司财务部副部长；2018年2月至今，唐山港口实业集团有限公司财务部部长；2023年11月至今，任财达证券股份有限公司监事。苏新娣女士目前还担任华电蓝科科技股份有限公司监事。

苑俊婷女士，1974年9月出生，大学本科学历，硕士学位，经济师，中国国籍，无境外永久居留权

1997年7月至2007年2月，河北证券有限责任公司先后任石家庄北合街营业部职员、人事劳资部人事专员、人事劳资部总经理助理（期间于

2004.4-2006.12 北京航空航天大学 MPA 学习）；2007 年 3 月至 2010 年 1 月，河北财达证券经纪有限责任公司先后任人力资源部总助级绩效专员、人力资源部四级专家；2010 年 2 月至 2016 年 6 月，财达证券有限责任公司先后任人力资源部四级专家、人力资源部副总经理、人力资源部副总经理（三级专家）；2016 年 7 月至 2022 年 2 月，财达证券股份有限公司先后任人力资源部副总经理（三级专家）、考核办主任兼人力资源部副总经理；2022 年 3 月至 2022 年 7 月，财达证券股份有限公司工会副主席、工会办主任；2022 年 8 月至 2024 年 2 月，财达证券股份有限公司工会副主席、群众工作部（信访、工会、团委）部长兼信访办主任；2024 年 3 月至今，财达证券股份有限公司工会副主席、群众工作部（信访、工会、团委）部长兼信访办主任、职工监事。

（3）高级管理人员

截止到 2025 年 1 月 24 日，本公司高级管理人员共 10 名，其中总经理 1 名，副总经理 6 名（其中 1 名兼任财务负责人），首席风险官、合规负责人 1 名，董事会秘书 1 名，首席信息官 1 名。公司现任 10 名高级管理人员的基本情况如下表所示：

姓名	职务	本届任期	任职资格批复
张 明	总经理	2024 年 12 月-2027 年 12 月	证监机构字[2004]160 号
郭爱文	副总经理	2024 年 12 月-2027 年 12 月	证监机构字[2002]81 号
唐建君	副总经理、财务负责人	2024 年 12 月-2027 年 12 月	冀证监许可[2017]10 号
赵景亮	副总经理	2024 年 12 月-2027 年 12 月	冀证监许可[2020]1 号
桂洋洋	副总经理	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案
胡恒松	副总经理	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案
康云龙	副总经理	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案
刘 丽	首席风险官、合规负责人	2024 年 12 月-2027 年 12 月	冀证监许可[2018]5 号
张 磊	董事会秘书	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案
谢井民	首席信息官	2024 年 12 月-2027 年 12 月	任职备案

张明先生，请参见本节“（1）董事会成员”简历

郭爱文先生，请参见本节“（1）董事会成员”简历

唐建君女士，请参见本节“（1）董事会成员”简历

赵景亮先生，1978 年 12 月出生，硕士研究生，特许金融分析师，中国国籍，

无境外永久居留权

2005年8月至2015年9月历任中信银行金融市场部资金业务部交易员、金融市场部投资管理部投资经理、总经理助理；2015年9月至2019年11月历任民生加银基金管理有限公司专户理财一部副总监、总监；2019年11月入职财达证券，2020年2月至今，财达证券股份有限公司副总经理。

桂洋洋先生，1979年9月出生，硕士研究生，中国国籍，无境外永久居留权

2005年7月至2005年12月，UT斯达康(中国)有限公司软件开发工程师。2006年1月至2015年9月，历任深圳证监局稽查一处科员、副主任科员；深圳证监局机构监管处主任科员、副处级干部。2015年10月至2021年8月，历任第一创业证券合规总监助理、零售经纪部负责人、网络营销部兼市场研究部负责人、经纪业务发展委员会副主任兼渠道发展部负责人，同时于2017年10月至2021年8月期间，任第一创业证券纪委书记、党委委员；2021年9月至2022年3月，华林证券拟任高管(其中自2022年1月任公司总裁助理)；2022年3月至今，财达证券股份有限公司副总经理。

胡恒松先生，1979年10月出生，博士研究生学历，中国国籍，无境外永久居留权

2007年7月至2015年1月，历任原宏源证券股份有限公司团委副书记、固定收益融资总部发行销售中心高级经理等（期间：2014年9月至2016年8月，在中国人民大学经济学院从事博士后研究）；2015年1月至2016年8月，任申万宏源证券有限公司固定收益融资总部运营管理部副总经理（期间：2015年6月至2016年6月，挂职广西壮族自治区钦州市金融工作办公室副主任(副处级)）；2016年8月至2018年6月，兴业证券股份有限公司固定收益业务总部三部总经理；2018年6月至2022年4月，财达证券股份有限公司总经理助理兼固定收益融资总部总经理；2022年4月至今，财达证券股份有限公司副总经理。胡恒松先生目前还担任财达资本管理有限公司监事、上海证券交易所第五届理事会债券发展委员会委员、国家发改委PPP专家库专家成员。

康云龙先生，1988年2月出生，硕士研究生，中国国籍，无境外永久居留权

2012年11月至2015年4月，方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司研究员、投资助理、投资主办人；2015年5月至2016年6月，九州证券股份有限公司资产管理委员会固收投资负责人；2016年7月至2017年9月，中航证券有限公司资管业务部副总经理；2017年9月至2022年3月，中航证券有限公司资管业务部总经理；2022年5月至今，财达证券股份有限公司副总经理；2024年6月至今，财达资本管理有限公司董事长。

刘丽女士，1974年4月出生，大学本科学历，中国国籍，无境外永久居留权

1995年7月至1996年7月，石家庄市化工厂职员；1996年7月至2002年4月，历任河北财达证券公司华西营业部职员、资产管理部职员、网络部职员；2002年4月至2010年2月，历任河北财达证券经纪有限责任公司总经理办公室文秘、副主任；2010年2月至2016年7月，历任财达证券有限责任公司总经理办公室副主任、董事会办公室主任、经纪业务管理总部总经理、总经理助理；2016年7月至2018年6月，任财达证券股份有限公司总经理助理、经纪业务管理总部总经理；2018年6月至2018年9月，任财达证券股份有限公司首席风险官、总经理助理、内核负责人；2018年9月至2022年7月，任财达证券股份有限公司首席风险官、总经理助理、内核负责人、风险管理部总经理；2022年8月至2024年6月，任财达证券股份有限公司首席风险官、总经理助理、内核负责人；2024年7月至今，任财达证券股份有限公司首席风险官、总经理助理、内核负责人、合规负责人。刘丽女士目前还担任财达期货有限公司董事。

张磊先生，1973年3月出生，大学本科学历，硕士学位，中国国籍，无境外永久居留权

1996年9月至2000年10月，河北证券有限责任公司石家庄翟营大街证券营业部员工、机构管理部员工、石家庄北合街证券营业部员工；2000年11月至2007年3月，河北证券有限责任公司机构管理部员工、总经理助理；2007年4月至2008年5月，河北财达证券经纪有限责任公司经纪业务部员工；2008年6月至2010年1月，河北财达证券经纪有限责任公司经纪业务部副总经理；2010年2月至2010年11月，财达证券有限责任公司经纪业务部副总经理；2010年12月至2014年1月，财达证券有限责任公司廊坊新华路证券营业部总经理；2014

年2月至2016年6月，财达证券有限责任公司董事会办公室主任；2016年7月至2021年7月，财达证券股份有限公司董事会办公室主任；2021年8月至今，财达证券股份有限公司董事会秘书、董事会办公室主任。张磊先生目前还担任中国上市公司协会董事会秘书专业委员会委员、声誉管理工作委员会委员；河北省上市公司协会董事会秘书专业委员会委员。

谢井民先生，1972年8月出生，本科学历，学士学位，中国国籍，无境外永久居留权

1995年7月至1999年7月任河北汽车贸易总公司职员；1999年8月至2002年3月历任河北财达证券公司职员、信息技术中心主管、副总经理；2002年4月至2010年2月历任河北财达证券经纪有限责任公司信息技术中心主管、副总经理；2010年2月至2016年7月历任财达证券有限责任公司信息技术中心主管、副总经理、首席工程师、总经理；2016年7月至2021年8月任财达证券股份有限公司信息技术中心总经理；2021年8月至2022年1月，财达证券股份有限公司首席信息官、信息技术中心总经理；2022年1月至今，财达证券股份有限公司首席信息官。

2、集合计划投资经理

本集合计划的投资经理为孔雀女士。

孔雀女士，1984年10月出生，中国国籍，无境外永久居留权

硕士研究生学历。2010年7月至2011年5月在国海证券总部财富管理中心任投资顾问，2011年5月至2015年3月在上海申银万国证券研究所任机构销售，2015年4月至2016年7月在天津滨海农商行任债券交易员，2016年7月至2017年12月在江西银行资产管理部任投资经理，2017年12月加入财达证券，担任财达证券稳达一号集合资产管理计划（2022年3月28日起转型为财达证券稳达中短债债券型集合资产管理计划）、财达证券稳达三号集合资产管理计划（2022年3月28日起转型为财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划）投资经理。

3、投资决策委员会成员

本集合计划采取集体投资决策制度，财达证券股份有限公司资产管理业务公募业务投资决策委员会的成员包括：康云龙、孙宇轩、段宝栋、马辉、韩彦斌、

贺日峰、蒋婷。

康云龙先生，1988年2月出生，中国国籍，无境外永久居留权

硕士研究生学历。2012年11月至2015年4月，方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司研究员、投资助理、投资主办人；2015年5月至2016年6月，九州证券股份有限公司资产管理委员会固收投资负责人；2016年7月至2017年9月，中航证券有限公司资管业务部副总经理；2017年9月至2022年3月，中航证券有限公司资管业务部总经理；2022年5月至今，财达证券股份有限公司副总经理；2024年6月至今，财达资本管理有限公司董事长。

孙宇轩先生，1993年5月出生，中国国籍，无境外永久居留权

硕士研究生学历。2017年2月至2022年7月，在中航证券有限公司资管业务部历任投资助理，投资主办人；2022年8月入职财达证券股份有限公司；2022年8月至今先后担任资产管理业务委员会销售团队负责人、投资研究部总经理。

段宝栋先生，1988年7月出生，中国国籍，无境外永久居留权

硕士研究生学历，FRM持证人。2012年4月至2021年2月，历任中国工商银行总行业务研发中心金融产品经理、悉尼分行风险管理部金融市场风控团队负责人；2021年3月至2023年1月，中信建投证券股份有限公司总公司信息技术部风险量化工程师；2023年2月至2024年9月，中国国际金融股份有限公司风险管理部高级经理；2024年12月入职财达证券股份有限公司。

马辉先生，1970年10月出生，中国国籍，无境外永久居留权

大学本科学历。1989年8月至1996年6月华联河北饭店员工；1996年7月至2007年3月河北证券裕华路营业部交易主管；2007年3月至2009年12月任河北财达证券石家庄裕华路营业部服务部负责人；2009年12月至2011年10月任财达证券石家庄井陉建设南路营业部负责人；2011年11月至2018年11月财达证券经纪业务部主管；2018年12月至2024年1月任财达证券沧州分公司合规风控总监；2024年2月至今任合规管理部总经理助理。

韩彦斌先生，1977年6月出生，中国国籍，无境外永久居留权

2003年6月至2008年9月任中教国际教育交流中心上海分中心总经理助理；2008年9月至2010年9月任河北财达资管管理有限公司综合处经理；2010年9月至2015年2月任财达证券有限责任公司研发中心证券分析师；2015年2月至

2018年11月任财达证券股份有限公司研发中心总经理助理；2018年11月至2021年5月任财达证券股份有限公司总办公室主任助理；2021年5月至2022年1月任财达证券股份有限公司总办公室副主任；2022年1月至今，任财达证券股份有限公司研发中心总经理。

贺日峰先生，1975年9月出生，中国国籍，无境外永久居留权

工商管理硕士，中级经济师。1996年7月至1999年7月河北财达证券公司石家庄华西路营业部员工；1999年7月至2012年12月历任财达证券有限责任公司华西路营业部总经理助理、邯郸水院路营业部副总经理、上海斜土路营业部总经理、上海浦东大道营业部总经理；2013年1月至2019年4月，任财达证券股份有限公司证券投资一部总经理；2019年4月至今，财达证券股份有限公司上海资管部总经理。

蒋婷女士，1992年5月出生，中国国籍，无境外永久居留权

硕士研究生学历。2017年7月至2018年6月，在上海华信证券有限责任公司（现甬兴证券）任资产管理部交易员；2018年7月至2022年7月，在中航证券有限公司资管业务部历任投资经理助理、投资主办、市场负责人；2022年7月入职财达证券股份有限公司。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、管理人的职责

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

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

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

（6）除依据《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定外，不得利用

集合计划财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作集合计划财产；

（7）依法接受集合计划托管人的监督；

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

（9）进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

（10）编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

（14）按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

（20）因违反《资产管理合同》导致集合计划财产的损失或损害集合计划份

额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

（21）监督集合计划托管人按法律法规和《资产管理合同》规定履行自己的义务，集合计划托管人违反《资产管理合同》造成集合计划财产损失时，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）当管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关集合计划事务的行为承担责任；

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

（24）执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

（25）建立并保存集合计划份额持有人名册；

（26）法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

四、管理人承诺

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

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

（1）将集合计划管理人固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资；

（2）不公平地对待管理的不同集合计划财产；

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

（4）向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

（5）侵占、挪用集合计划财产；

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

（7）玩忽职守，不按照规定履行职责；

（8）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、集合计划管理人承诺严格遵守资产管理合同，并承诺建立健全内部控制

制度，采取有效措施，防止违反资产管理合同行为的发生；

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

5、集合计划管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

五、集合计划投资经理承诺

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

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；

3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密，尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

六、管理人的内部控制制度

1、内部控制和风险管理制度的综述

为加强公司内部控制和风险管理，防范和化解风险，促进公司诚信、合法、有效经营，保障产品投资者的合法权益，公司已经建立健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度有公司基本管理制度、部门业务规章组成，其中公司基本管理制度包括公司的风险管理制度、公司合规管理制度、稽核审计制度，从公司层面全面建立、健全风险管理制度体系和风险管理要求；部门业务规章包括部门专门针对资产管理业务的风险管理制度、流动性风险管理、合规管理制度、集合计划会计制度、信息披露制度、关联交易制度等，针对资产管理业务进行具体规范。

2、风险管理

（1）风险管理的目标和原则

公司开展全面风险管理的目标主要包括：

1）通过有效的风险管理，保障公司持续经营且不发生对公司持续经营造成重要影响的重大风险事件，促进公司发展战略及经营目标的实现；

2）形成公司良好的风险管理文化，强化全体员工的风险管理意识和责任意

识；

3) 全面管理公司经营过程中面临的各种风险，形成具有公司特色和有效的风险管理能力，实现风险管理创造价值，打造风险管理核心竞争力；

4) 合理优化风险资源配置，在不突破风险承受能力的基础上促进最佳效率的风险资本收益。

公司开展全面风险管理工作主要遵循以下原则：

1) 全面性原则：风险管理覆盖公司所有业务、部门、分支机构、子公司及全体人员，贯穿决策、执行、监督、反馈全部过程。

2) 适应性原则：公司风险管理应与公司发展战略、经营目标、业务实际、管理模式、风险状况相适应，根据市场环境及业务发展变化情况，持续动态地进行调整完善。

3) 有效性原则：公司全面风险管理体系及工作机制、管理流程应能够有效管理公司面临的风险，并促进公司业务健康、快速发展。

4) 制衡性原则：公司组织架构及岗位设置应权责分明，相互分离，前中后台相互独立并能够有效制衡和监督。

5) 独立性原则：清晰界定业务部门和风险管理部门的职责和报告路线，并确保风险管理部门的独立性。

6) 重要性原则：公司应当在对风险进行全面管理的基础上，对重要业务、重大事项、重点操作环节和高风险领域实施重点管理。

（2）风险管理组织架构

公司风险管理组织架构包括五个主要部分：董事会及风险管理委员会，监事会，总经理办公会及风险控制委员会，风险管理部及各类专业风险管理部门，其他各部门、分支机构及子公司。

1) 董事会及风险管理委员会

公司董事会承担公司全面风险管理的最终责任，主要负责：推进风险文化建设；审议批准公司全面风险管理的基本制度；审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额；审议公司定期风险评估报告；任免、考核首席风险官，确定其薪酬待遇；建立与首席风险官的直接沟通机制等。

公司董事会下设风险管理委员会，主要负责：对风险管理的总体目标、基本

政策进行审议并提出意见；对需董事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见；对需董事会审议的风险评估报告进行审议并提出意见等。

2) 监事会

公司监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和总经理办公会在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

3) 总经理办公会及风险控制委员会

公司总经理办公会根据董事会的授权和批准，结合公司经营目标，具体负责实施风险管理工作，对全面风险管理承担主要责任。公司总经理办公会主要负责：制定风险管理基本制度，并适时调整；建立健全公司全面风险管理的经营管理架构，明确全面风险管理职能部门、业务部门以及其他部门在风险管理中的职责分工，建立部门之间有效制衡、相互协调的运行机制；制定风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额等的具体执行方案，确保其有效落实，对其进行监督，对突破规定要求的情况及时分析原因，并根据董事会的授权进行处理；定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况，解决风险管理中存在的问题并向董事会报告；建立涵盖风险管理有效性的全员绩效考核体系；建立完备的信息技术系统和数据质量控制机制等。

公司总经理办公会下设风险控制委员会，主要负责：对公司业务进行风险授权，明确业务风险底线、管理授权及审批程序、风险报告及处置程序；拟定公司总体年度风险额度、各项业务年度风险额度及调整；审核公司经营层面及各业务风险管理政策；审核公司重大风险事件处置方案；平衡各业务风险与收益，对业务经营计划提出意见，对重大新业务开展前的风险和收益进行评估和决策；对公司各部门、分支机构及子公司风险管理工作提出评价考核意见；拟定公司资本管理方案及年度配置计划，对资本管理有关事项进行决策；审议公司定期和临时风险报告，指导风险管理相关部门工作；审议公司投资银行类业务内核委员会基本制度和流程等。

公司设首席风险官，负责领导并推动公司全面风险管理工作的实施，并向管理层报告公司风险状况。公司对首席风险官履职提供充分保障，保障其能够充分行使履行职责所必要的知情权，首席风险官有权参加或者列席与其履行职责相关

的会议，调阅相关文件资料，获取必要信息。公司保障首席风险官的独立性，公司股东、董事不得违反规定的程序，直接向首席风险官下达指令或者干涉其工作。公司各部门、分支机构及其工作人员发现风险隐患时，应当主动、及时向首席风险官报告。

4）风险管理部及各类专业风险管理部门

公司指定风险管理部履行全面风险管理职责，主要负责：牵头建立完善公司全面风险管理体系，分解落实全面风险管理的各项要求；监测、计量、评估、报告公司整体风险水平和风险资本运用，对不同风险类型之间的关联和转化进行整体牵头管理；牵头应对和处置公司层面重大风险事件；协助、指导和检查各部门、分支机构、子公司的风险管理工作等。

各专业风险管理部门对各自牵头管理的专业风险负责，主要负责：制定专业风险管理政策，分解管理和执行责任；进行事前、事中、事后的风险识别、监控、评估、判断、应对、报告的牵头管理；对不同风险类型之间的关联和转化进行预警；接受与之相关风险的管理及执行责任分解和落实等。其中，计划财务部负责牵头管理公司的流动性风险；董事会办公室负责牵头管理公司的声誉风险；信息技术中心负责牵头管理公司的信息技术风险；合规管理部负责牵头管理公司的洗钱风险；指定纪委办公室负责牵头管理公司的廉洁从业风险等。

5）其他各部门、分支机构及子公司

公司其他各部门、分支机构及子公司对各自条线的各类风险管理工作负责，主要负责：落实公司及各类专业风险牵头管理部门制定的各项政策、流程和措施，接受各类风险牵头管理部门的指导以及对各类风险管理、执行责任的分解。

各部门、分支机构及子公司负责人是所辖机构风险管理的第一责任人，全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险，承担风险管理的直接责任，执行所负责业务领域事前、事中、事后的风险识别、监控、评估、判断、应对、报告，以及对不同风险类型之间的关联和转化进行及时预警、控制等。

（3）风险管理制度体系

公司建立并持续完善由公司风险管理基本制度、具体风险管理制度、部门（业务）工作规章（实施细则）三个层面构成的制度体系，针对公司面临的各类风险进行识别和控制，建立了风险导向型风险管理工作机制和全面风险管理制度体

系。

1) 公司风险管理基本制度

基本管理制度是公司全面风险管理制度体系中的基础性制度，对公司全面开展风险管理工作具有指导和规范作用。公司依据各项法律法规和自律监管规则制定的《风险管理办法》是对公司全面风险管理的总体要求。

为健全公司全面风险管理制度体系，提高公司风险管理能力，促进公司规范经营和持续、稳定、健康发展，公司依据《中华人民共和国证券法》《证券公司监督管理条例》《证券公司内部控制指引》《证券公司风险控制指标管理办法》《证券公司全面风险管理规范》《证券公司流动性风险管理指引》等法律法规和自律监管规则，结合公司实际，制定并完善了《公司风险管理办法》，对全面风险管理的定义、总体目标、工作原则、组织体系、风险识别与评估、风险指标的计量与监控、风险应对与管控、风险管理工作评估及风险报告等内容进行了规范，对公司经营中的市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、声誉风险、洗钱风险、廉洁从业风险等各类风险，进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对和全程管理。

2) 具体风险管理制度

具体风险管理制度是对相关行业监管法规和公司基本管理制度的细化和落实，涵盖风险偏好管理体系、风险限额管理、风险控制指标、压力测试、新业务风险管理、应急管理、风险管理考核等方面及各专业风险类型。其中，专业风险管理制度主要包括《流动性风险管理办法》《市场风险管理办法》《信用风险管理办法》《操作风险管理办法》《声誉风险管理办法》《信息技术风险管理办法》《洗钱风险管理办法》《廉洁从业管理制度》。

3) 部门（业务）工作规章（实施细则）

部门（业务）工作规章（实施细则）主要是公司在具体业务层面制定的针对债券投资交易、内部信用评级、信用交易业务、金融工具估值与减值、投资银行类业务等风险管理制度。将全面风险管理工作贯穿落实到公司各项日常业务的工作流程和操作细则当中，确保公司风险管理制度的完整性、合理性、有效性和可操作性。

（4）风险管理运行机制

1) 风险识别与评估

公司按业务、部门和风险类型等对风险进行分类，全面、系统、持续地收集可能影响实现公司经营目标的内外部信息，并结合公司业务特点，识别公司面临的风险点及其来源、特征、形成条件和潜在影响。

公司建立并完善了法人治理结构，制定了各业务、各部门有效的风险监控和管理制度体系，明确了操作流程和风险控制措施。从风险类型角度，公司面临市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险、声誉风险、洗钱风险等风险，建立了相应的风险管理制度，均明确了各类风险识别的具体要求和方法。各单位制定的创新业务方案包含业务部门自身对于创新业务的运作模式、估值方法、风险识别和评估结果以及采取的风险管理措施。公司风险管理部对创新业务方案出具风险评估意见，评估公司是否具有相应的人员、系统及资本开展该业务。

2) 风险计量

公司通过风险价值、信用敞口、敏感性分析、压力测试等手段和方法，对市场风险、信用风险、流动性风险等进行计量。同时，通过建立业务部门、分支机构与风险管理部门、财务部门的协调机制，公司风险管理部门定期对风险计量模型的有效性进行检验和评价，确保相关假设、参数、数据来源和计量程序的合理性与可靠性，并根据检验结果进行调整和改进，确保风险计量基础的科学性。

公司针对年度经营计划、经营环境发生极端变化、出现突发事件、拟开展创新业务、重大业务以及进行利润分配等情形采用压力测试进行风险计量，测算压力情景下公司净资本等各项风险控制指标、流动性指标、财务指标等的变化情况，评估公司风险承受的能力，并制定相应的风险管理方案。

3) 风险指标与监控

公司建立了以净资本和流动性为核心的风险控制体系以及各项业务规模与净资本水平的动态调整机制。同时，基于各业务的风险环节或风险点，建立了包括市场风险、信用风险、流动性风险等主要风控指标在内的，较为完善的风险监控指标阈值体系，以及风险预警监控、报告和处置流程，并在监管规定标准、监管预警标准基础上，制定了更加严格的公司标准。

公司结合自身战略、发展阶段及资本实力，针对不同业务确定关键风险指标，经公司董事会、管理层审批，逐级分解至各单位执行，并对风险指标实施一线控

制、二线监测。即，通过交易系统对重要指标进行前端设置实现公司对业务部门的风险控制，公司风险管理部及相关职能部门通过风险监控系統对公司风险控制指标进行监控。同时，公司建立风控指标预警、处理和报告机制，对超过预警阈值的情形和突发性风险，监控部门按风险的大小或影响程度依次向首席风险官、公司管理层以及董事会进行报告。

4) 主要风险管理措施

公司按风险类别划分，主要包括市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、声誉风险、洗钱风险、信息技术风险、合规风险、廉洁从业风险等。公司通过对主要风险进行及时有效的识别、评估、计量、监测，实现对风险的有效监控与管理，从而确保公司整体风险水平可控、可测、可承受。具体应对主要风险的措施如下：

（a）市场风险管理

市场风险是指由于金融资产价格、利率、汇率及其他市场因素的不利波动使公司发生潜在损失的风险。公司涉及的市场风险主要是指在以自有资金进行各类投资时因利率变动、汇率变动和证券市场价格变动而导致亏损的可能性。

公司制定了风险限额管理办法，建立了风险限额管理分级授权机制，健全了包括投资规模、损失限额、预警限额等风险限额指标体系，同时根据对宏观经济、市场环境、政策变化、监管要求的判断和变化情况，及时调整公司的相关风险限额控制指标。公司通过情景分析、压力测试、敏感性分析等手段，持续对市场风险进行评估、测量与管理。根据对市场的研判，综合分析自营投资业务条线状况，公司适时调整自营证券投资的授权规模，有效控制风险。公司业务部门作为市场风险的直接承担者，负责一线风险管理工作。风险管理部作为风险管理部门，使用 VaR、久期、DV01、敏感性分析等专业风险管理工具和方法，对市场风险进行评估、监测和管理，并将评估、监测结果报送公司经营管理层，为公司决策提供依据。

（b）信用风险管理

信用风险是指因交易对手无法履约或其信用评级、履约能力等改变而给公司带来损失的可能性。公司信用风险主要来源于信用交易业务、债券投资业务等。

在信用交易业务的信用风险管理方面，加强对信用交易业务的主动管控，不

断完善、优化制度和流程，严把项目准入关，严格客户资质审核，并通过风险指标计算表来量化评估项目中可能存在的风险。公司通过建立逐日盯市制度，对达到平仓线的账户进行强制平仓，加强监控和违约项目处理，防范信用风险；公司采取收取保证金、融资抵（质）押物等方式进行信用风险缓释。

在债券投资业务信用风险管理方面，公司逐步构建科学合理的信用风险内部评级体系，制定了内部信用评级管理办法等相关制度，建立了公司级交易对手库、产品库，并根据产品信用评级实施相应的投资限制，通过系统风控指标实现控制或预警，有效防范信用风险；公司业务部门组建了信用研究团队，在公司内部评级体系框架下建立了适用于业务的部门内部评级标准及投资限额管理机制，并不断优化完善。

在交易对手管理方面，公司制定交易对手管理办法，明确交易对手评级方法及联动的授信机制，实时关注交易对手信用状况，及时调整交易对手内部评级及授信额度，对黑名单内交易对手严格禁止交易。

同时，公司搭建了舆情监测系统，实现了业务存续期间舆情监控，为信用风险管理提供了有效手段。

（c）操作风险管理

操作风险是指由不完善的或有问题的内部操作流程或程序、有缺陷的信息技术系统、不当员工行为以及其他外部事件给公司造成损失的风险。

公司通过严格业务系统权限管理、实行重要岗位双人复核等方法，从源头上防范并控制操作风险。公司制定了《操作风险管理办法》及配套的管理规定，明确了操作风险的管理组织架构、职责分工、管理工具、监测与计量、控制与缓释等内容，通过风险与控制自我评估、关键风险指标、损失数据收集等工具，对操作风险进行识别、评估、监测，加强操作风险的管控能力；公司充分发挥合规、风控、稽核等部门的作用，将控制端口前移，通过采取日常合规监督、定期合规检查以及年度稽核等，加强对业务开展过程中所面临的各类操作风险的识别与评估，有效防范操作风险。

（d）流动性风险管理

流动性风险主要是指公司无法以合理成本及时获得充足资金，以偿付到期债务、履行其他支付义务和满足正常业务开展的资金需求的风险。

公司建立以净资本和流动性为核心的风险控制指标体系，健全动态监控系统，完善压力测试工作机制，加强对流动性的监测、分析与报告，及时识别和管理公司在经营过程中的流动性风险。

公司关注并加强资金流动性风险管理，充分考量公司的风险偏好和风险承受，对自营、信用交易、资管等风险业务设定相应的风控指标，如债券评级、单一客户和单一证券集中度、自有资金参与单个资管项目规模等，同时加强该类指标的监控。

同时，公司财务部门统筹安排自有资金的资金调度，加强日间资金流动性管理和监控，在保证安全的前提下，合理优化债务结构，通过监控净稳定资金率、流动性覆盖率、资产负债率等指标对公司流动性风险进行精准管控。

（e）声誉风险管理

声誉风险是指由于证券经营机构行为或外部事件、及其工作人员违反廉洁规定、职业道德、业务规范、行规行约等相关行为，导致投资者、发行人、监管机构、自律组织、社会公众、媒体等对证券公司形成负面评价，从而损害其品牌价值，不利其正常经营，甚至影响到市场稳定和社会稳定的风险。

公司坚持“全程全员、预防第一、审慎管理、快速响应”的声誉风险管理原则，建立常态的声誉风险管理机制，注重事前评估和日常防范。公司已明确声誉风险管理的相关程序，通过发现并解决经营管理中存在的问题，消除影响公司声誉和形象的隐患，提高声誉风险的管理水平。

（f）洗钱风险管理

洗钱风险是指公司在开展业务和经营过程中可能被违法犯罪活动利用而面临的风险。

公司建立了反洗钱组织架构，健全和完善了公司反洗钱内部控制制度体系，高度重视反洗钱合规文化建设，严格落实反洗钱内控制度，加强对违规责任的追究。通过建立反洗钱系统、加强反洗钱人员的培训、组织反洗钱内部监督检查、定期进行洗钱风险评估等管理措施和手段，有效防范洗钱风险。

（g）信息技术风险管理

信息技术风险是指公司经营及业务开展过程中所依赖的电子信息系统可能会面临软硬件故障、通讯线路故障、恶意入侵等不可预料事件带来的信息系统风

险隐患。信息技术风险涉及公司信息技术战略风险、供应商风险、信息系统安全风险、数据安全风险、操作风险、信息系统软硬件缺陷风险、研发风险等。

公司高度重视信息技术风险防范，从组织架构、制度建设、人员配备、运维管理、应急保障等多方面不断完善管理流程，严格同步上线与新业务相匹配的风险管控功能模块，制定《网络与信息安全事件应急预案》，每年由公司各业务部（室）共同参与估评与演练并不断完善。信息技术风险防范已成为公司 IT 治理、创新业务开展的重要保障。

（h）合规风险管理

合规风险是指因经营管理或员工的执业行为违反法律、法规或相关监管部门的规定而使公司受到法律制裁、被采取监管措施，从而造成公司遭受财务或声誉损失的风险。

为应对合规风险，公司主要采取如下措施：（1）建立公司合规管理组织架构，健全并完善公司合规管理制度体系；（2）高度重视合规文化的培育和合规管理制度的严格贯彻执行，落实了各项合规保障，并加强对违规责任的追究；（3）各部门、业务条线和分支机构主动合规，及时报告本部门存在的合规风险；（4）合规负责人、合规管理部、合规专员全面履行合规管理职责，加强与各部门的沟通与联系，通过合规咨询、合规审查、合规检查、合规监测等方法与手段，及时对公司经营管理中的合规风险进行识别与评估，有效防范合规风险。

（i）廉洁从业风险管理

廉洁从业风险是指公司及全体工作人员在开展证券期货业务及相关活动中，未严格遵守法律法规和中国证监会的规定和行业自律规则，不遵守社会公德、商业道德、职业道德和行为规范，在公平竞争，合规经营，忠实勤勉，诚实守信，规范从业中存在不良行为，通过直接或者间接向他人输送不正当利益或者谋取不正当利益，从而产生影响行业声誉和良好职业形象的风险。

公司切实明确廉洁从业管控的主体责任，明确廉洁从业具体要求，从制度机制建设、监督检查、宣传教育等方面积极推动廉洁从业风险管理落实见效，制定《廉洁从业管理制度》和有针对性、可操作性的 6 个业务条线从业人员廉洁从业规范，深化廉洁风险防控工作。

5) 风险报告

公司建立了自下而上的风险报告制度，使公司内部风险信息得到及时有效地沟通，实现公司内部风险控制信息共享，为公司管理风险和制定风险控制措施提供依据。

公司风险管理部及各专业风险管理部门通过专业风险管理工具和方法对归口的各类风险进行分析，按日、月、季度、年度等不同频率生成各类风险报表或分析报告，反映主要风险信息及风控指标超限预警及跟踪反馈等情况，协助公司统筹应对、合理化解现有风险，准确识别、充分预判潜在风险，各业务条线按公司要求对自身运营管理开展风险的评估、分析和报告工作，各专业风险管理部门按要求汇总开展公司各类专业风险的评估、分析和报告工作。

公司风险管理部负责关注风险的相关性，汇总公司层面的风险总量，审慎评估并报告公司面临的总体风险水平，并按程序向首席风险官、风控委员会或公司领导进行报告。

6) 风险评价、考核与问责

公司建立了包含收益和风险在内的风险管理评价机制，合理设计评价指标，每年度通过内控评估、稽核审计等手段进行风险绩效评价工作，逐步开展经济资本管理，提高风险管理绩效，提升经营管理水平。

公司建立了风险管理内部考核机制，通过设定合理的考核范围、内容、标准和方法，将风险管理考核纳入经营管理综合考核之中，考核结果与部门及员工奖惩激励挂钩。

公司建立了贯穿各个业务领域及部门员工的风险管理问责制度，对违规行为及造成风险损失的单位和责任人给予相应处罚。

7) 重大突发风险事件或危机处理

为有效应对并预防已经发生或可能发生的突发事件，保持业务的连续性，全面提高公司应对各种突发风险事件或危机的能力，公司建立健全了各种应急预案、应急计划和灾难备份计划，

同时，公司建立了应急预案和应急计划演练机制，确保及时有效地处理各种故障和危机，并定期或不定期组织相关部门对应急预案进行修订调整 and 实际演练。

3、内部控制

（1）内部控制的目标

- 1）建立和完善符合现代公司管理要求的内部组织结构，形成科学的决策机制、执行机制和监督机制保证公司经营管理目标的实现；
- 2）建立行之有效的风险控制系统，强化风险管理，保证公司各项经营活动的正常有序运行；
- 3）建立良好的公司内部控制环境，堵塞漏洞、消除隐患，防止并及时发现和纠正错误及舞弊行为，保护公司资产的安全、完整；
- 4）规范本公司会计行为，保证会计资料真实、完整，提高会计信息质量；
- 5）确保国家有关法律法规和本公司内部规章制度的贯彻执行。

（2）内部控制遵循的原则

1）健全性原则

内部控制应做到事前、事中、事后控制相统一，覆盖公司所有业务、部门、人员，贯穿决策、执行、监督、反馈全过程。

2）合理性原则

内部控制应当符合国家有关法律法规和中国证监会的有关规定，与公司经营规模、业务范围、风险状况及公司所处的环境相适应，以合理的成本实现内部控制目标。

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）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。针对重要业务与事项、高风险领域与环节采取更为严格的控制措施，确保不存在重大缺陷。

5）独立性原则

承担内部控制监督检查职能的部门独立于公司其他部门。

（3）内部控制结构

公司制定了公司治理的基本制度、公司基本管理制度和部门业务制度三个层次的内控制度，成立了证券投资业务决策委员会、信用交易决策委员会、资产管理业务决策委员会等专业委员会，对各类业务的开展进行风险评估。公司制定了

《公司风险管理办法》《风险控制指标动态监控管理办法》以及各业务条线风险控制管理制度，建立了有效的风险评估过程，对信用风险、流动性风险、市场风险等进行持续监控，明确风险管理流程和风险化解方法。公司风险管理部与其他职能部门、业务部门相互配合，形成了覆盖事前、事中和事后的风险管理与内部控制体系。根据设定的控制目标，全面、系统、持续地收集相关信息，结合公司实际控制情况及时进行风险评估，为公司进行风险决策提供重要的决策支持，为政策及应对措施制订提供良好的基础。公司将风险管理对于公司生存、发展和战略目标实现的重要性明确地传达给每一位员工，并应用于各种日常管理之中。公司各部门定期根据监管法规的变化，对各类业务开展现状进行风险评估，及时修订完善业务管理制度、操作流程，以加强内部控制。

公司定期对各项内部控制进行评价，一方面建立各种机制使相关人员在履行正常岗位职责时，就能够在相当程度上获得内部控制有效运行的证据；另一方面通过外部沟通来证实内部产生的信息或者指出存在的问题。本公司管理层高度重视内部控制的各职能部门和监管机构的报告及建议，并采取各种措施及时纠正控制运行中产生的偏差。

4、集合计划管理人关于内部合规控制声明书

本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确，并承诺将根据市场变化和公司业务发展不断完善内部控制制度。

第四部分 托管人

一、托管人情况

（一）托管人概况

名称：招商银行股份有限公司（简称“招商银行”）

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：【深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦】

法定代表人：缪建民

成立时间：1987 年 4 月 8 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：25,220,000,000 元

存续期间：持续经营

批准设立文号：证监基金字[2002]83 号

行长：【王良】

联系电话：【4006195555】

传真：【0755-83195201】

客服电话：【9555】

网址：www.cmbchina.com

资产托管部信息披露负责人：张姗

【托管人基本介绍】

招商银行成立于 1987 年 4 月 8 日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于 2002 年 3 月成功地发行了 15 亿 A 股，4 月 9 日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006 年 9 月又成功发行了 22 亿 H 股，9 月 22 日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10 月 5 日行使 H 股超额配售，共发行了 24.2 亿 H 股。截至 2024 年 9 月 30 日，本集团总资产 116,547.63 亿元人民币，高级法下资本充足率 18.67%，权重法下资本充足率 15.33%。

2002 年 8 月，招商银行成立基金托管部；2005 年 8 月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，现下设基金券商团队、银保信托团队、养老金团队、业务管理团队、产品研发团队、风险管理团队、系统与数据团队、项目支持团队、运营管理团队、基金外包业务团队 10 个职能团队，现有员工 249 人。2002 年 11 月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003 年 4 月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行之一，拥有证券投资基金托管资格、基本养老保险基金托管机构资格、受托投资管理托管业务托管资格、保险资金托管业务资格、企业年金基金托管业务资格、合格境外机构投资者托管（QFII）资格、合格境内机构投资者托管（QDII）资格、私募基金业务外包服务资格、存托

凭证试点存托业务等业务资格。

招商银行资产托管结合自身在托管行业深耕 22 年的专业能力和创新精神，推出“招商银行托管+”服务品牌，以“践行价值银行战略，致力于成为服务更佳、科技更强、协同更好的客户首选全球托管银行”品牌愿景为指引，以“值得信赖的专家、贴心服务的管家、让价值持续增加、客户的体验更佳”的“4+目标”，以创新的“服务产品化”为方法论，全方位助力资管机构实现可持续的高质量发展。招商银行资产托管围绕资管全场景，打造了“如风运营”“大观投研”“见微数据”三个服务子品牌，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系统和“6S”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，推出国内首个托管大数据平台，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，近年来获得业内各类奖项荣誉。2016 年 5 月“托管通”荣获《银行家》2016 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；6 月荣获《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获得该奖项的托管银行；7 月荣获中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”、《21 世纪经济报道》“2016 最佳资产托管银行”。2017 年 5 月荣获《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；6 月荣获《财资》“中国最佳托管银行奖”；“全功能网上托管银行 2.0”荣获《银行家》2017 中国金融创新“十佳金融产品创新奖”。2018 年 1 月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度优秀资产托管机构”奖；同月，托管大数据平台风险管理系统荣获 2016-2017 年度银监会系统“金点子”方案一等奖，以及中央金融团工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖；3 月荣获《中国基金报》“最佳基金托管银行”奖；5 月荣获国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12 月荣获 2018 东方财富风云榜“2018 年度最佳托管银行”、“20 年最值得信赖托管银行”奖。2019 年 3 月荣获《中国基金报》“2018 年度最佳基金托管银行”奖；6 月

荣获《财资》“中国最佳托管机构”“中国最佳养老金托管机构”“中国最佳零售基金行政外包”三项大奖；12月荣获2019东方财富风云榜“2019年度最佳托管银行”奖。2020年1月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2019年度优秀资产托管机构”奖项；6月荣获《财资》“中国境内最佳托管机构”“最佳公募基金托管机构”“最佳公募基金行政外包机构”三项大奖；10月荣获《中国基金报》第二届中国公募基金英华奖“2019年度最佳基金托管银行”奖。2021年1月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2020年度优秀资产托管机构”奖项；同月荣获2020东方财富风云榜“2020年度最受欢迎托管银行”奖项；2021年10月，《证券时报》“2021年度杰出资产托管银行天玑奖”；2021年12月，荣获《中国基金报》第三届中国公募基金英华奖“2020年度最佳基金托管银行”；2022年1月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2021年度优秀资产托管机构、估值业务杰出机构”奖项；9月荣获《财资》“中国最佳托管银行”“最佳公募基金托管银行”“最佳理财托管银行”三项大奖；12月荣获《证券时报》“2022年度杰出资产托管银行天玑奖”；2023年1月荣获中央国债登记结算有限责任公司“2022年度优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司“2022年度优秀托管机构”、全国银行间同业拆借中心“2022年度银行间本币市场托管业务市场创新奖”三项大奖；2023年4月，荣获《中国基金报》第二届中国基金业创新英华奖“托管创新奖”；2023年9月，荣获《中国基金报》中国基金业英华奖“公募基金25年基金托管示范银行（全国性股份行）”；2023年12月，荣获《东方财富风云榜》“2023年度托管银行风云奖”。2024年1月，荣获中央国债登记结算有限责任公司“2023年度优秀资产托管机构”、“2023年度估值业务杰出机构”、“2023年度债市领军机构”、“2023年度中债绿债指数优秀承销机构”四项大奖；2024年2月，荣获泰康养老保险股份有限公司“2023年度最佳年金托管合作伙伴”奖。2024年4月，荣获中国基金报“中国基金业英华奖-ETF20周年特别评选“优秀ETF托管人”奖。2024年6月，荣获上海清算所“2023年度优秀托管机构”奖。2024年8月，在《21世纪经济报道》主办的2024资产管理年会暨十七届21世纪【金贝】资产管理竞争力研究案例发布盛典上，“招商银行托管+”荣获“2024卓越影响力品牌”奖项；2024年9月，在2024财联社中国金融业“拓扑奖”评选中，荣获银行业务类奖项“2024年资产

托管银行‘拓扑奖’”。

（二）主要人员情况

缪建民先生，招商银行董事长、非执行董事，2020年9月起担任招商银行董事、董事长。中央财经大学经济学博士，高级经济师。中国共产党第十九届、二十届中央委员会候补委员。招商局集团有限公司董事长。曾任中国人寿保险（集团）公司副董事长、总裁，中国人民保险集团股份有限公司副董事长、总裁、董事长，曾兼任中国人民财产保险股份有限公司董事长，中国人保资产管理有限公司董事长，中国人民健康保险股份有限公司董事长，中国人民保险（香港）有限公司董事长，人保资本投资管理有限公司董事长，中国人民养老保险有限责任公司董事长，中国人民人寿保险股份有限公司董事长。

王良先生，招商银行党委书记、执行董事、行长。中国人民大学经济学硕士，高级经济师。1995年6月加入招商银行，历任招商银行北京分行行长助理、副行长、行长，2012年6月起历任招商银行行长助理、副行长、常务副行长，2022年4月18日起全面主持招商银行工作，2022年5月19日起任招商银行党委书记，2022年6月15日起任招商银行行长。兼任招商银行香港上市相关事宜之授权代表、招银国际金融控股有限公司董事长、招银国际金融有限公司董事长、招商永隆银行董事长、招联消费金融有限公司副董事长、招商局金融控股有限公司董事、中国支付清算协会副会长、中国银行业协会中间业务专业委员会第四届主任、中国金融会计学会第六届常务理事、广东省第十四届人大代表。

王颖女士，招商银行副行长，南京大学政治经济学专业硕士，经济师。王颖女士1997年1月加入招商银行，历任招商银行北京分行行长助理、副行长，天津分行行长，深圳分行行长，招商银行行长助理。2023年11月起任招商银行副行长。

孙乐女士，招商银行资产托管部总经理，硕士研究生毕业，2001年8月加入招商银行至今，历任招商银行合肥分行风险控制部副经理、经理、信贷管理部总经理助理、副总经理、总经理、公司银行部总经理、中小企业金融部总经理、投行与金融市场部总经理；无锡分行行长助理、副行长；南京分行副行长，具有20余年银行从业经验，在风险管理、信贷管理、公司金融、资产托管等领域有深入的研究和丰富的实务经验。

（三）基金托管业务经营情况

截至 2024 年 9 月 30 日，招商银行股份有限公司累计托管 1518 只证券投资基金。

二、托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

招商银行确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管制度，坚持守法经营、规范运作的经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内部控制及风险防范体系：

一级内部控制及风险防范是在招商银行总行风险管控层面对风险进行预防和控制；总行风险管理部、法律合规部、审计部独立对资产托管业务进行评估监督，并提出内控提升管理建议。

二级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部设立风险合规管理相关团队，负责部门内部风险预防和控制，及时发现内部控制缺陷，提出整改方案，跟踪整改情况，并直接向部门总经理室报告。

三级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部在设置专业岗位时，遵循内部控制制衡原则，视业务的风险程度制定相应监督制衡机制。

3、内部控制原则

（1）全面性原则。内部控制覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有团队和岗位，并由全部人员参与。

（2）审慎性原则。托管组织体系的构成、内部管理制度的建立均以防范风险、审慎经营为出发点，体现“内控优先”的要求。

（3）独立性原则。招商银行资产托管部各团队、各岗位职责保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间相互分离。内部控制的检查、评价部门独立于内部控制的建立和执行部门。

（4）有效性原则。内部控制有效性包含内部控制设计的有效性、内部控制执行的有效性。内部控制设计的有效性是指内部控制的设计覆盖了所有应关注的重要风险，且设计的风险应对措施适当。内部控制执行的有效性是指内部控制能够按照设计要求严格有效执行。

（5）适应性原则。内部控制适应招商银行托管业务风险管理的需要，并能够随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行修订和完善。

（6）防火墙原则。招商银行资产托管部办公场地与招商银行其他业务场地隔离，办公网和业务网物理分离，部门业务网和全行业务网防火墙策略分离，以达到风险防范的目的。

（7）重要性原则。内部控制在实现全面控制的基础上，关注重要托管业务重要事项和高风险环节。

（8）制衡性原则。内部控制能够实现在托管组织体系、机构设置、权责分配及业务流程等方面相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率。

4、内部控制措施

（1）完善的制度建设。招商银行资产托管部从资产托管业务内控管理、产品受理、会计核算、资金清算、岗位管理、档案管理和信息管理等方面制定一系列规章制度，建立了三层制度体系，即：基本规定、业务管理办法和业务操作规程。制度结构层次清晰、管理要求明确，满足风险管理全覆盖的要求，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。

（2）业务信息风险控制。招商银行资产托管部在数据传输和保存方面有严格的加密和备份措施，采用加密、直连方式传输数据，数据执行异地实时备份，所有的业务信息须经过严格的授权方能进行访问。

（3）客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务办理过程中获取的客户资料严格保密，除法律法规和其他有关规定、监管机构及审计要求外，不向任何机构、部门或个人泄露。

（4）信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统机房、权限管理实行双人双岗双责，电脑机房 24 小时值班并设置门禁，所有电脑设置密码及相应权限。业务网和办公网、托管业务网与全行业务网双分离制度，与外部业务机构

实行防火墙保护，对信息技术系统采取两地三中心的应急备份管理措施等，保证信息技术系统的安全。

（5）人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效地进行人力资源管理。

三、托管人对管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法律法规的规定及基金合同、托管协议的约定，对基金投资范围、投资比例、投资组合等情况的合法性、合规性进行监督和核查。

在为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，基金托管人对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、基金合同的指令拒绝执行，并立即通知基金管理人。

基金托管人如发现基金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，及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及基金合同允许的调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

第五部分 相关服务机构

一、集合计划销售机构

1、直销机构

财达证券股份有限公司：

注册地址：石家庄市自强路35号

办公地址：石家庄市桥西区自强路35号

法定代表人：张明

客户咨询电话：【0311-95363】

传真：【021-60609079】

联系人：【杨玉冰】

2、其他销售机构：

（1）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

法定代表人：其实

客服电话：400-181-8188

网址：fund.eastmoney.com

（2）京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区知春路76号(写字楼)1号楼4层1-7-2

法定代表人：邹保威

客服电话：400-098-8511

网址：kenterui.jd.com

（3）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座

法定代表人：宋晓言

客服电话：400-799-1888

网址：www.520fund.com.cn

（4）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路500号30层3001单元

法定代表人：王翔

客服电话：021-65370077

网址：www.jiyufund.com.cn

（5）北京度小满基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室

法定代表人：盛超

客服电话：95055-4

网址：www.duxiaomanfund.com

（6）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号4层401-2

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

网址：www.hcfunds.com

（7）上海利得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区海基六路70弄1号208-36

室

法定代表人：李兴春

客服电话：400-032-5885

网址：www.leadfund.com.cn

（8）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

法定代表人：王珣

客服电话：95188-8

网址：www.fund123.cn

（9）中证金牛（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

法定代表人：吴志坚

客服电话：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

（10）上海联泰基金销售有限公司

注册地址：上海市普陀区兰溪路900弄15号526室

法定代表人：尹彬彬

客服电话：400-118-1188

网址：www.66liantai.com

（11）上海攀赢基金销售有限公司

注册地址：上海市闸北区广中西路1207号306室

法定代表人：郑新林

客服电话：021-68889082

网址：www.pytz.cn

（12）珠海盈米基金销售有限公司

注册地址：珠海市横琴新区环岛东路3000号2719室

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

（13）通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

法定代表人：沈丹义

客服电话：400-101-9301

网址：www.tonghuafund.com

（14）宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路345号

法定代表人：陆华裕

客服电话：95574

网址：www.nbcb.com.cn

（15）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（16）深圳市前海排排网基金销售有限责任公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室

法定代表人：杨柳

客服电话：400-666-7388

网址：www.ppwfund.com

（17）福克斯（北京）基金销售有限公司

注册地址：北京市怀柔区怀北镇怀北路308号

法定代表人：谢亚凡

客服电话：010-84084940

网址：www.haofunds.com

（18）和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号1002室

法定代表人：章知方

客服电话：400-920-0022

网址：www.licaike.com

（19）华瑞保险销售有限公司

注册地址：上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座14层

法定代表人：杨新章

客服电话：952303

网址：www.my1000.cn

（20）博时财富基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福新社区益田路5999号基金大厦19层

法定代表人：王德英

客服电话：400-610-5568

网址：www.boserawealth.com

（21）国信嘉利基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区华泾路507号4幢2层223室

法定代表人：付钢

客服电话：021-68809999

网址：www.gxjlc.cn

（22）北京创金启富基金销售有限公司

注册地址：北京市丰台区金泽路161号1号楼-4至43层101内3层09A

法定代表人：梁蓉

客服电话：010-66154828

网址：www.5irich.com

（23）泰信财富基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路乙118号京汇大厦10层1206

法定代表人：彭浩

客服电话：400-004-8821

网址：www.taixincf.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，管理人增减或变更本集合计划的销售机构时，将在管理人网站公示。

二、集合计划登记机构

名称：财达证券股份有限公司

住所：石家庄市自强路35号

办公地址：石家庄市自强路35号

法定代表人：张明

联系人：【杨玉冰】

联系电话：【021-60609079】

传真：【021-60609079】

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：中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）；

住所：武汉市武昌区中北路 166 号长江产业大厦 17-18 层；

办公地址：武汉市武昌区中北路 166 号长江产业大厦 17-18 层；

首席合伙人：石文先；

电话：027-86791215；

传真：027-85424329；

联系人：刁平军；

经办注册会计师：霍春玉、刁平军。

第六部分 集合计划的基本情况

一、集合计划名称

财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

二、集合计划的类别

债券型集合资产管理计划

三、集合计划的运作方式

契约型开放式

（1）每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能提出赎回申请。对于每份计划份额，第一个运作期指资产管理合同生效日（对资产管理合同生效前相应计划份额而言，下同）或计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满 3 个月对应的月度对日（即第一个运作期到期日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满 6 个月对应的月度对日止，第三个运作期指第二个运作期到期日的次一日起，至资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满 9 个月对应的月度对日止。以此类推。

（2）每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该计划份额进入下一个运作期。集合计划份额持有人在运作期到期日申请赎回的，集合计划管理人按照资产管理合同和招募说明书的约定为集合计划份额持有人办理赎回事宜。

集合计划份额持有人在运作期到期日申请赎回的，管理人按照资产管理合同和招募说明书的约定为集合计划份额持有人办理赎回事宜。

四、集合计划份额面值

本集合计划份额面值为人民币 1.00 元。

五、集合计划存续期限

本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期至 2025 年 12 月 31 日。本集合计划自 2025 年 12 月 31 日后，按照中国证监会有关规定执行。

六、本计划将计划份额分为不同的类别。其中：

投资人申购计划份额时收取申购费用，不从本类别计划资产中计提销售服务费的计划份额称为 A 类计划份额；在投资人申购计划份额时不收取申购费用，而是从本类别计划资产中计提销售服务费的计划份额称为 C 类计划份额。

A 类计划份额和 C 类计划份额分别设置代码。由于集合计划费用的不同，A 类计划份额和 C 类计划份额将分别计算并公布计划份额净值。

投资人可自行选择申购的计划份额类别。不同类别计划份额之间不得互相转换。

本计划份额类别的具体设置、费率水平等由管理人确定，并在招募说明书及产品资料概要中列明。根据本计划运作情况，在不违反法律法规规定、资产管理合同约定以及对计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，管理人在履行适当程序后可以增加新的计划份额类别、调整现有计划份额类别的申购费率、调低赎回费率或销售服务费率、变更收费方式或者停止现有计划份额类别的销售，或对计划份额分类办法及规则进行调整等，而无需召开计划份额持有人大会，但调整实施前管理人需及时公告并报中国证监会备案。

第七部分 集合计划的历史沿革

本集合计划由原财达证券稳达三号集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。

原集合计划为限定性集合资产管理计划，自 2013 年 5 月 15 日起开始募集，于 2013 年 5 月 22 日结束募集工作，并于 2013 年 5 月 28 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》的规定，原集合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 3 月 28 日起，《财达证券稳达三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《财达证券稳达三号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

第八部分 集合计划的存续

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

变更为本集合计划后，本集合计划存续期限为自资产管理合同生效之日起存续至 2025 年 12 月 31 日。本集合计划自 2025 年 12 月 31 日后，按照中国证监会有关规定执行。如 2025 年 12 月 31 日后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合计划份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

第九部分 集合计划份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

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

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

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

管理人在开放日办理集合计划份额的申购，在每个运作期到期日办理集合计划份额的赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或资产管理合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

管理人自资产管理合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

集合计划份额每个运作期到期日，集合计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请，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，管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

管理人不得在资产管理合同约定之外的日期或者时间办理集合计划份额的申购、赎回或者转换。投资者在资产管理合同约定之外的日期和时间提出申购或转换转入申请且登记机构确认接受的，该申购或转换转入申请视为下一开放日提

出的有效申购或转换转入申请。投资人在运作期到期日业务办理时间结束后或在运作期到期日之外的日期和时间提出赎回或转换转出申请的，视为无效申请。

三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

投资人申购集合计划份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；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，管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或资产管理合同载明的延缓支付赎回的情形时，款项的支付办法参照资产管理合同有关条款处理。遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其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，赎回款项顺延至前述因素消失日的下一个工作日划出。

3、申购和赎回申请的确认

管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎

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

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购及赎回份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

五、申购和赎回的数量限制

1、投资人首次申购单笔最低金额为 1 元（含申购费），追加申购的单笔最低金额为 1 元（含申购费）。各销售机构对本集合计划最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

2、投资人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 0.01 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 0.01 份的，在赎回时需一次全部申请赎回。

3、各销售机构对交易账户最低份额余额有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

4、单个投资人累计持有的集合计划份额不设上限。

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

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

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、申购费

（1）本集合计划 C 类计划份额不收取申购费用，投资人申购 A 类计划份额时，需交纳申购费用，投资者申购本计划 A 类计划份额的申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者可以多次申购本集合计划，申购费率按单笔分别计算。具体申购费率如下表所示：

单笔申购金额（含申购费，M）	申购费率
$M < 100$ 万元	0.3%
$100 \text{ 万元} \leq M < 500 \text{ 万元}$	0.1%
$M \geq 500$ 万	每笔 1000 元

（2）申购费用由申购 A 类计划份额的投资人承担，不列入集合计划财产，主要用于本集合计划的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费

本集合计划不收取赎回费。

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

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

七、申购份额、赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

当投资者选择申购本集合计划份额时，申购份额的计算方法如下：

（1）申购 A 类计划份额

①申购费用适用比例费率时：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类计划份额净值

②申购费用为固定金额时：

申购费用=固定金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/申购当日 A 类计划份额净值

（2）申购 C 类计划份额

申购份额=申购金额/申购当日 C 类计划份额净值

申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类集合计划份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，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：某投资者投资 5 万元申购本集合计划 A 类计划份额，则对应的申购费率为 0.30%，假设申购当日 A 类计划份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

净申购金额=50,000/（1+0.30%）=49,850.45 元

申购费用=50,000-49,850.45=149.55 元

申购份额=49,850.45/1.0500=47,476.62 份

即：投资者投资 5 万元申购本集合计划 A 类计划份额，假设申购当日 A 类计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 47,476.62 份的 A 类计划份额。

例：某投资者投资 550 万元申购本集合计划 A 类计划份额，则其对应的申购费用为 1,000 元，假设申购当日 A 类计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到的 A 类计划份额的份数计算如下：

申购费用=1,000.00 元

净申购金额=5,500,000-1,000=5,499,000.00 元

申购份额=5,499,000/1.0500=5,237,142.86 份

即：投资人投资 550 万元申购本集合计划 A 类计划份额，假设申购当日 A 类计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 5,237,142.86 份 A 类计划份额。

例：某投资者投资 50,000 元申购本集合计划 C 类计划份额，假设申购当日 C 类计划份额净值为 1.0180 元，无申购费率，则其可得到的 C 类计划份额为：

申购份额=50,000/1.0180=49,115.91 份

即：投资者投资 50,000 元申购本集合计划 C 类计划份额，假设申购当日 C 类计划份额净值为 1.0180 元，则可得到 49,115.91 份 C 类计划份额。

2、赎回金额的计算

本集合计划的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的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赎回费用。

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×赎回当日该类集合计划份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额—赎回费用

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

例：某持有人在运作期到期日赎回 5 万份本集合计划 A 类计划份额，则对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 A 类计划份额净值为 1.0500 元，则可得到的赎回金额为：

赎回总金额=50,000×1.0500=52,500 元

赎回费用=52,500×0%=0 元

净赎回金额=52,500—0=52,500 元

即：持有人在运作期到期日赎回 5 万份本集合计划 A 类计划份额，假设赎回当日 A 类计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 52,500 元。

3、集合计划份额净值计算

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

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

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

1、因不可抗力导致集合计划无法正常运作。

2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的申购申请。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有集合计划份额持有人利益时。

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

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

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

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

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

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

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日集合计划资

产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有集合计划份额持有人利益的情形时，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，管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受集合计划赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应及时报中国证监会备案，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按资产管理合同的相关条款处理。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，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。因发生暂停赎回等情形导致相应运作期到期日无法办理赎回的，管理人有权相应顺延。

十、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

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

2、巨额赎回的处理方式

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

（1）全额赎回：当管理人认为有能力支付集合计划份额持有人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当管理人认为支付集合计划份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付集合计划份额持有人的赎回申请而进行的财产变现可能会对

集合计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日集合计划总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，集合计划份额持有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。如集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，集合计划份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

若本集合计划发生巨额赎回的，在单个集合计划份额持有人的赎回申请超过前一开放日集合计划总份额 10%以上的情形下，管理人可以延期办理赎回申请：对于该集合计划份额持有人当日赎回申请超过上一开放日集合计划总份额 10%以上的部分，管理人可以全部进行延期办理；对于该集合计划份额持有人当日赎回申请未超过上述比例的部分，根据前段“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他集合计划份额持有人的赎回申请一并办理。但是，对于未能赎回部分，如该集合计划份额持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在规定媒介上刊登公告。

十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

2、管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关

规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

十二、集合计划转换

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

十三、集合计划的非交易过户

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

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

十四、集合计划的转托管

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

十五、定期定额投资计划

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

十六、集合计划份额的冻结和解冻与质押

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。

如相关法律法规允许管理人办理集合计划份额的质押业务或其他集合计划业务，管理人将制定和实施相应的业务规则。

十七、集合计划份额的转让

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

十八、实施侧袋机制期间集合计划的申购与赎回

集合计划实施侧袋机制的，集合计划的申购和赎回安排详见本招募说明书“侧袋机制”章节或届时发布的相关公告。

第十部分 集合计划的投资

一、投资目标

在严格控制风险、保持资产良好流动性的基础上，通过主动管理，获取证券的利息收益和资本利得收益，以追求资产持续稳健的增值。

二、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，包括国内依法发行的债券（包括国债、地方政府债、金融债、政策性金融债券、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、证券公司发行的短期公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本计划不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场的新股申购或增发新股，仅可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种（但须符合中国证监会的相关规定）。因上述原因持有的股票和权证等资产，本计划应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

本集合计划不投资于股票等资产，也不投资于可交换债券。

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

本集合计划的投资组合比例为：本计划债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%；本计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

三、投资策略

1、资产配置策略

本资产管理计划将充分发挥管理人的资产配置能力，在货币市场工具、利率债、信用债等资产之间进行灵活配置。以债券类资产为主要配置，同时依托丰富

的投资经验和优秀的风险控制能力在控制组合回撤风险的基础上增厚组合收益，力争获取持续稳定的收益。

2、债券资产投资策略

管理人在宏观经济形势、货币及财政政策研究的基础上，以预测未来市场利率的走势和债券市场供求关系为核心，结合收益率期限结构和利差分析，来构建债券组合。在运作过程中将实施积极的、动态的债券投资组合管理，争取获取较高的债券组合收益。

（1）利率策略。通过全面研究国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测货币及财政政策等的取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势，以此来确定债券投资组合的综合持有期限。

（2）类属配置策略。通过对债券市场收益率期限结构进行分析，对不同类型债券品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、公司债等利差和变化趋势，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。

（3）单个券种选择。通过对影响个别债券定价的流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。在风险收益特征等方面对组合进行进一步的优化，以争取达到在相同期限和类属的条件下，更进一步降低组合风险，提高组合收益的目的。

本资产管理计划主动投资信用债的债项评级不得低于 AA+；其中对债项评级 AA+ 的信用债投资比例不高于本资产管理计划信用债资产的 50%，对债项评级 AAA 的信用债投资比例不低于本资产管理计划信用债资产的 50%。对于没有债项评级的信用债，上述债项评级参照主体评级。如本资产管理计划所投资的信用债因评级下调导致不符合前述投资范围的，管理人应当在三个月之内进行调整。

3、货币市场工具投资策略

本资产管理计划将在确定总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、银行存款的期限、债券逆回购的预期收益率来确定货币市场工具的配置，并定期对货币市场工具组合平均剩余期限以及

投资品种比例进行适当调整。

4、资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本集合计划将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。

5、可转债投资策略

本资产管理计划将采用定性（行业地位、竞争优势、公司治理、产能、创新能力、财务状况等）与定量（PB、PE、PEG、PS、净资产收益率、预测未来两年主营业务利润复合增长率等）相结合的方法来构建可转债投资组合，重点投资价值被市场低估、发债公司具有较好发展潜力、基础股票具有较高上升预期的个券品种。

本资产管理计划投资可转债比例合计不超过计划资产净值的 20%。

四、投资限制

1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

（1）本计划债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%；

（2）本计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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

（4）管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种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开募集性质的集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

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

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

（13）集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的 140%；

（14）法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

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

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

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，在履行适当程序后，本集合计划可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，在履行适当程序后，本集合计划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：中债总财富（1-3 年）指数收益率*90%+一年期定期存款利率（税后）*10%。

本集合计划是以中债总财富（1-3 年）指数收益率*90%+一年期定期存款利率（税后）*10%作为业绩比较基准，符合本集合计划的风险收益特征。

中债总财富（1-3 年）指数是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场中短期债券指数，对中短期债券价格变动趋势有很强的代表性，能较好的反映本集合计划的投资策略，较为科学、合理的评价本集合计划的业绩表现。

如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布，或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准，如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适用于本集合计划的业绩比较基准时，本管理人可以根据本集合计划的投资范围和投资策略，调整集合计划的业绩比较基准，但应在取得托管人同意并履行适当程序后报中国证监会备案，并及时公告，无须召开集合计划份额持有人大会审议。

六、风险收益特征

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

七、管理人代表集合计划行使债权人权利的处理原则及方法

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

2、有利于集合计划财产的安全与增值；

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

八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

九、集合计划投资组合报告（未经审计）

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

托管人招商银行股份有限公司根据资产管理计划合同规定，复核了本投资组合报告，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 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,079,291,886.45	99.34
	其中：债券	982,547,973.57	90.44
	资产支持证券	96,743,912.88	8.90
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	6,109,894.15	0.56
8	其他资产	1,065,240.70	0.10
9	合计	1,086,467,021.30	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

本集合计划本报告期末未持有股票。

（2）报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明

细

本集合计划本报告期末未持有股票。

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	93,910,847.46	9.65
	其中：政策性金融债	61,110,114.86	6.28
4	企业债券	135,407,789.08	13.91
5	企业短期融资券	169,407,006.80	17.41
6	中期票据	583,822,330.23	59.99
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	982,547,973.57	100.95

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明

细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	102300347	23冀中能源MTN003 B(科创票据)	400,000	43,449,167.12	4.46
2	102381331	23漯河投资MTN002	400,000	42,328,775.34	4.35
3	149806	22株高01	400,000	42,146,224.66	4.33
4	012481562	24津渤海SCP007	400,000	40,622,099.18	4.17
5	242380016	23中原银行永续债01	300,000	32,800,732.60	3.37

6、报告期末按公允价值占基金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)	占基金资产净值比例 (%)
1	262856	24金源1A	470,000	47,621,501.60	4.89
2	144406	星灿4A2	200,000	20,102,701.37	2.07
3	143832	星灿2A3	100,000	10,438,096.16	1.07
4	144272	星灿3A2	80,000	6,383,221.23	0.66

5	199580	诚泰16A2	150,000	5,944,374.25	0.61
6	144262	诚丰1A1	200,000	4,597,098.52	0.47
7	262511	24GTQR11	30,000	941,312.28	0.10
8	144405	星灿4A1	150,000	715,607.47	0.07

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资
明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明
细

本集合计划本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末无股指期货投资。

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划本报告期末无股指期货投资。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本期国债期货投资政策

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

（2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

（3）本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末无国债期货投资。

11、投资组合报告附注

（1）本集合计划投资前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

（2）本集合计划本报告期末未持有股票。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,387.17

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,060,853.53
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,065,240.70

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

（5）报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末未持有股票。

（6）投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十一部分 集合计划的业绩

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

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

本集合计划资产管理合同生效日为2022年3月28日，集合计划业绩截止日为2024年12月31日。

一、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

稳达三个月滚动持有债券A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2024.10.1-2024.12.31	0.87%	0.03%	1.15%	0.03%	-0.28%	0.00%
2024.7.1-2024.12.31	1.18%	0.03%	1.75%	0.03%	-0.57%	0.00%
2024.1.1-2024.12.31	3.89%	0.02%	3.67%	0.03%	0.22%	-0.01%
2022.3.28-2024.12.31	10.47%	0.03%	8.65%	0.03%	1.82%	0.00%

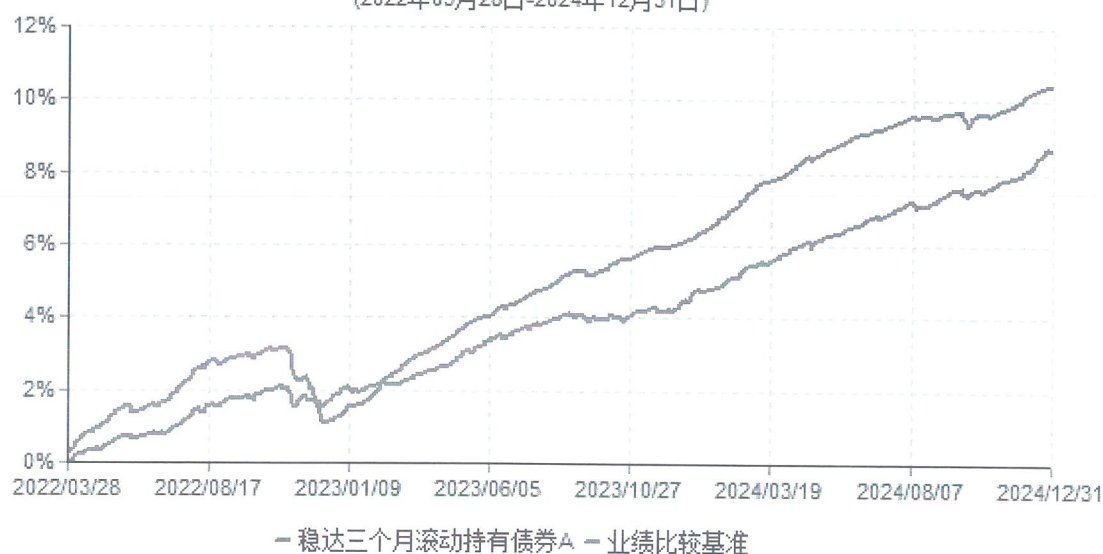
稳达三个月滚动持有债券C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2024.10.1-2024.12.31	0.80%	0.03%	1.15%	0.03%	-0.35%	0.00%
2024.7.1-2024.12.31	1.03%	0.03%	1.75%	0.03%	-0.72%	0.00%
2024.1.1-2024.12.31	3.56%	0.02%	3.67%	0.03%	-0.11%	-0.01%

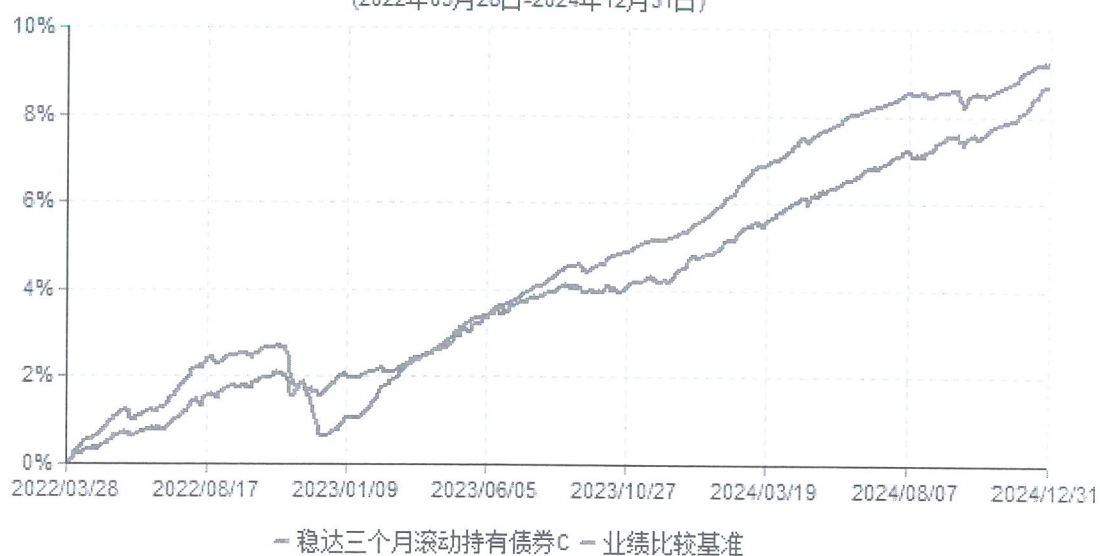
24.12.31						
2022.3.28-2024.12.31	9.27%	0.03%	8.65%	0.03%	0.62%	0.00%

二、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

稳达三个月滚动持有债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年03月28日-2024年12月31日)



稳达三个月滚动持有债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年03月28日-2024年12月31日)



第十二部分 集合计划的财产

一、集合计划资产总值

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

二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

三、集合计划财产的账户

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

四、集合计划财产的保管和处分

本集合计划财产独立于管理人、托管人和集合计划销售机构的财产，并由托管人保管。管理人、托管人、集合计划登记机构和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《资产管理合同》的规定处分外，集合计划财产不得被处分。

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

第十三部分 集合计划资产估值

一、估值日

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

二、估值对象

集合计划所拥有的债券和银行存款本息、其它投资等资产及负债。

三、估值原则

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

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

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

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

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在 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，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（含可分离交易可转债的纯债部分）以每日收盘价作为估值全价；

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

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

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、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、同业存单的估值方法

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

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

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

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

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

五、估值程序

1、某一类别集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，某一类别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。

管理人每个工作日计算集合计划资产净值及集合计划份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，管理人将视情况对前述事项进行相应的调整，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、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或资产管理合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将当日的集合计划份额净值和资产净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人按规定对外公布。

六、估值错误的处理

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

资产管理合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

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

（3）因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但估值错误责任方仍应对估值错误负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还