

上海国泰君安证券资产管理有限公司

国泰君安君得诚混合型  
集合资产管理计划  
更新招募说明书

(2020 年第 1 号)

管理人：上海国泰君安证券资产管理有限公司

托管人：招商银行股份有限公司

## 重要提示

国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）由国泰君安君得稳一号集合资产管理计划变更而来，国泰君安君得稳一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》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》等有关法律法规、中国证券业协会《证券公司客户资产管理业务规范》等自律性文件的规定、《国泰君安君得稳一号集合资产管理计划管理合同》及其他有关规定募集，并经中国证券业协会备案。

根据中国证监会于2018年11月30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，国泰君安君得稳一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。

经中国证监会批准，《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同》自集合计划管理人公布的生效之日起生效，原《国泰君安君得稳一号集合资产管理计划管理合同》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，但中国证监会对国泰君安君得稳一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、集合计划合同、集合计划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股指期货、国债期货、股票期权。股指期货、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。投资股票期权所面临的主要风险是股票期权价格波动带来的市场风险；因保证金不足、备兑证券数量不足或持仓超限而导致的强行平仓风险；股票期权具有高杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动可能会使投资人权益遭受较大损失；包括对手方风险和连带风险在内的第三方风险；以及各类操作风险。

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。

本集合计划参与内地与香港股票市场交易互联互通机制（以下简称“港股通机制”）下港股通相关业务，集合计划资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对集合计划的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险烦请查阅本招募说明书的风险揭

示章节的具体内容。

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

本集合计划可投资于科创板股票,科创板股票的特有风险包括: 科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点,企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。此外,科创板企业可能存在首次公开发行前最近3个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形,可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形。

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。

本集合计划自2020年3月25日起变更生效。本更新招募说明书所载内容截止日为2020年12月24日,有关财务和业绩表现数据截止日为2020年9月30日,财务和业绩表现数据未经审计。

## 目 录

重要提示.....	1
第一部分 绪言.....	0
第二部分 释义.....	1
第三部分 管理人.....	6
第四部分 托管人.....	14
第五部分 相关服务机构.....	20
第六部分 集合计划的历史沿革.....	23
第七部分 集合计划的存续.....	24
第八部分 集合计划份额的申购与赎回.....	25
第九部分 集合计划的投资.....	36
第十部分 集合计划的业绩.....	50
第十一部分 集合计划的财产.....	52
第十二部分 集合计划资产估值.....	53
第十三部分 集合计划的收益与分配.....	60
第十四部分 集合计划费用与税收.....	62
第十五部分 集合计划的会计与审计.....	64
第十六部分 集合计划的信息披露.....	65
第十七部分 风险揭示.....	72
第十八部分 集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算.....	82
第十九部分 集合计划合同的内容摘要.....	84
第二十部分 集合计划托管协议的内容摘要.....	101
第二十一部分 对集合计划份额持有人的服务.....	119
第二十二部分 其他应披露事项.....	120
第二十三部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	122
第二十四部分 备查文件.....	123

## 第一部分 绪言

《国泰君安君得诚混合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》”）、《证券投资基金销售管理办法》（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《国泰君安君得诚混合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国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划的投资目标、策略、风险、费率等与投资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、集合资产管理计划：指上海国泰君安证券资产管理有限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

2、集合计划或本集合计划：指国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划

3、管理人：指上海国泰君安证券资产管理有限公司

4、托管人：指招商银行股份有限公司

5、集合计划合同、《集合计划合同》：指《国泰君安君得诚混合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

6、托管协议：指管理人与托管人就本集合计划签订之《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

7、招募说明书或本招募说明书：指《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

8、集合计划产品资料概要：指《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划集合计划产品资料概要》及其更新（关于本集合计划产品资料概要的编制、披露与更新要求，最迟将自 2020 年 9 月 1 日起执行）

9、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

10、《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

11、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

13、《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

14、《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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、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

17、合同当事人：指受集合计划合同约束，根据集合计划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

18、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的自然人

19、机构投资者：指依法可以投资集合资产管理计划的、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

20、合格境外机构投资者：指符合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的中国境外的机构投资者

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

22、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的其他投资人的合称

23、集合计划份额持有人：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

24、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

25、销售机构：指上海国泰君安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

26、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

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

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

29、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

30、集合计划合同生效日：指《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同》的生效日，原《国泰君安君得稳一号集合资产管理计划管理合同》同日起失效

31、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

32、存续期：指《国泰君安君得稳一号集合资产管理计划管理合同》生效至集合计划合同终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、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

35、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

36、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（若本集合计划参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则管理人有权根据实际情况决定本集合计划暂停申购、赎回及转换业务并公告）

37、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

38、《业务规则》：指中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则及其不

时做出的修订，是规范管理人所管理的并由中国证券登记结算有限责任公司办理登记业务的集合资产管理计划登记方面的业务规则

39、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

40、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

41、集合资产管理计划转换：指集合计划份额持有人按照集合计划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、某一集合资产管理计划的份额转换为管理人管理的其他集合资产管理计划份额的行为

42、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

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

44、巨额赎回：指本集合计划单个开放日，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%

45、元：指人民币元

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

47、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

48、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

49、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

50、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

---

51、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（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

52、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

53、摆动定价机制：指当开放式集合资产管理计划遭遇大额申购赎回时，通过调整集合资产管理计划份额净值的方式，将集合资产管理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资产管理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

54、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 管理人

### 一、管理人概况

名称：上海国泰君安证券资产管理有限公司（简称：本公司或公司）

住所：上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室

成立日期：2010 年 8 月 27 日

法定代表人：江伟

办公地址：上海市东园路 111 号

联系电话：38676999

联系人：胡秀华

注册资本：20 亿元人民币

股权结构：国泰君安证券股份有限公司，持有股份 100%。

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

江伟，女，1969 年 4 月出生，高级管理人员工商管理硕士，中共党员。历任国泰君安证券股份有限公司商城路营业部总经理助理、上海水城路营业部总经理、上海江苏路营业部总经理、上海分公司总经理、国泰君安证券总裁助理、党委委员、经纪业务委员会副总裁、研究与机构业务委员会总裁等职务，现任本公司董事长，国泰君安创新投资有限公司董事长、执行委员会主席、代行总经理职责，国泰君安证券股份有限公司上海分公司总经理。

蒋忆明，男，1963 年 11 月出生，博士。历任君安证券经纪业务部副总经理、资金计划部总经理、财务总监，国泰君安证券总会计师、财务总监；现任国泰君安证券副总裁、营运总监，本公司董事。

喻健，男，1964 年 4 月出生，工商管理硕士。历任航空航天部所属研究所科技部项目主管；国泰证券的证券发行部副经理、发行一处经理以及证券发行部副总经理；国泰君安证券股份有限公司投行部副总经理，企业融资部副总监、总监、总经理，上市办公室主任。现任国泰君安证券股份有限公司董事、董事会秘书、北京代表处首席代表、董事会办公室主任，本公司董事。

## 2、监事

傅南平，男，1962年10月出生，经济学博士。历任深圳国际信托投资公司证券发行部副总经理，原君安证券投资银行总部副总经理，国泰君安证券投资银行二部总经理、企业融资总部常务董事、副总监、机构客户服务总部副总经理、深圳总部副总经理、深圳分公司副总经理，现任国泰君安证券巡察委员会巡察员，本公司监事。

## 3、高级管理人员

陶耿，男，1968年1月出生，博士，高级经济师，中共党员。历任中国银行、中国人民银行科员，中国证监会上海监管局机构处主任科员、机构监管二处副处长、基金监管处处长、办公室主任，光大保德信基金管理有限公司总经理。现任本公司总裁。

叶明，男，1976年8月出生，大学本科，中共党员。1995年7月入职原国泰证券，1999年7月加入国泰君安证券，先后担任计划财务部副经理、资金清算总部总经理助理、营运中心副总经理；2010年8月起加入本公司，历任营运总监兼任营运部总经理、董事会秘书、代履职合规总监职责，现任本公司副总裁兼任合规总监、首席风险官、财务负责人。

吴楠，女，1970年12月出生，经济学硕士。1992年7月任职于深圳发展银行，1997年1月加入君安证券，1999年8月加入国泰君安证券，2010年10月进入本公司担任总裁助理兼北京业务部总经理，现任本公司副总裁。

周诗宇，男，1971年出生，大学本科，中共党员。1994年7月加入君安证券，1999年8月加入国泰君安证券，2013年10月进入本公司担任总裁助理兼市场部总经理，现任本公司副总裁。

成飞，男，汉族，1983年9月出生，硕士研究生，中共党员。2006年7月入职国泰君安证券，历任固定收益证券总部研究员、资产管理部投资经理，2010年10月加入本公司，历任固定收益部副总经理、总经理、公司总裁助理，现任本公司副总裁。

李艳，女，1974年2月出生，硕士研究生，FRM，中共党员。2001年3月入职上海证券有限责任公司，历任证券投资总部高级经理、创新产品总部高级经理、研究所金融工程部负责人、基金评价研究中心副总经理、创新发展总部总经理兼

基金评价研究中心总经理，2015年9月加入本公司担任综合管理部总经理，现任本公司董事会秘书。

庄严，男，1971年8月出生，大学本科。1990年9月起历任中国银行上海分行会计员；中国工商银行总行信托投资公司上海证券总部交易员、办公室主任助理、主任；中国银河证券有限责任公司上海总部行政部经理；亚洲证券有限公司公司总裁办副主任、资产管理总部副总经理、总经理；国海富兰克林基金管理有限公司渠道总监兼零售业务部总经理；泰信基金管理有限公司市场总监兼市场部总经理、营销部总经理；光大保德信基金管理有限公司副CMO等；2016年9月起加入本公司担任基金管理部总经理、总裁助理兼机构金融部总经理，现任本公司总裁助理。

朱晓力，男，1965年4月出生，工商管理硕士，中共党员。1993年3月起历任上海国际信托有限公司证券部技术主管、营业部副经理；上海证券有限责任公司信息技术总部总经理、电子商务总部总经理；2016年3月起加入本公司担任信息技术部总经理，现任本公司首席信息官。

#### 4、本集合计划的投资经理

周晨，北京大学光华管理学院金融学硕士，现任国泰君安证券资产管理有限公司权益与衍生品部高级投资经理。历任国泰君安证券资产管理有限公司研究发展部研究员、高级研究员、资深研究员。具有8年从业经验，2019年6月起担任“君得稳”投资经理。

杜浩然：复旦大学金融硕士，5年证券从业经历。现任国泰君安证券资产管理有限公司固定收益部投资经理助理，主要从事债券研究、集合产品投资管理。2018年12月起担任“君得稳”投资经理。

#### 5、公募投资决策委员会成员

陶耿，公募投资决策委员会主任委员，现任本公司总裁。

成飞，公募投资决策委员会副主任委员，现任本公司副总裁。

李少君，公募投资决策委员会委员，现任本公司投资研究院院长。

张骏，公募投资决策委员会委员，现任本公司基金投资部总经理。

王红莲，公募投资决策委员会委员，现任本公司风险管理部总经理。

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《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、监督托管人按法律法规和《集合计划合同》规定履行自己的义务，托管人违反《集合计划合同》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《集合计划合同》约定的其他义务。

#### 四、管理人承诺

1、管理人将根据集合计划合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、理念、策略及限制等全权处理本集合计划的投资。

2、管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，

采取有效措施，防止以下行为发生：

- (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) 不公平地对待管理人管理的不同集合资产管理计划财产；
- (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) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

### 3、集合计划投资经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和集合计划合同的规定，本着谨慎的原则为集合计划份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- (3) 不违反现行有效的有关法律法规、规章、集合计划合同和中国证监会的有关规定，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明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (4) 不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；
- (5) 不从事损害集合计划资产和集合计划份额持有人利益的证券交易及其他活动。

## 五、管理人的内部控制制度

### 1、内部控制制度概述

为保障公司及其所开展的资产管理业务规范运作，有效防范、规避和化解各类风险，最大限度地保护利益相关者及公司的合法权益，管理人建立了科学合理、控制严密、运行高效的内部控制制度。

内部控制制度是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项基本

管理制度的纲要和总揽，贯穿公司运营的所有环节，其内容包括公司内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等。

## 2、内部控制目标

(1) 确保公司经营运作严格遵守国家有关法律、法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

(2) 防范和化解经营风险，提高经营管理效益，实现公司资产管理业务的持续、稳定、健康发展。

(3) 建立行之有效的风险控制系统，保障公司资产及客户资产的安全完整，维护公司股东的合法权益，并最大限度地保护投资人的合法权益。

(4) 确保公司业务记录、财务信息和其它信息真实、准确、完整、及时。

(5) 保证公司内部规章制度的贯彻执行，提高公司经营效益。

## 3、内部控制原则

(1) 健全性原则。内部控制机制应当做到事前、事中、事后控制相统一；覆盖公司各个部门和各级岗位，渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内部控制程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则。公司各部门和岗位职责应当保持相对独立，公司对受托资产、自有资产、其他资产的管理运作必须分离；公司设立法律合规部及风险管理部，承担内部控制监督检查职能，对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。

(4) 相互制约原则。内部部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡；前台业务运作与后台管理支持适当分离。

(5) 成本效益原则。公司内部控制与公司业务范围、经营规模、风险状况相适应，运用科学化的经营管理方法，以合理的成本实现内部控制目标。

## 4、控制环境

内部控制环境主要包括公司经营理念与风险意识、治理结构、组织架构与决策程序、内部控制体系、员工的诚信和道德价值观、人力资源政策等。

## 5、内控措施

公司建立科学严密的风险控制评估体系，通过定期与不定期风险评估，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，发现风险来源和类型，针对不同的风险由

---

相关部门提出相应的风险控制方案，及时防范和化解风险。

控制活动主要包括：授权控制、内幕交易控制、关联交易控制和法律风险控制等。内部控制的主要内容包括：市场开发业务控制、投资管理业务控制、信息披露控制、信息技术系统控制、会计系统控制和人力资源控制等。

#### 6、管理人关于内部控制的声明

- (1) 管理人确知建立、实施和维持内部控制制度是管理人的责任；
- (2) 上述关于内部控制的披露真实、准确；
- (3) 管理人承诺将根据市场环境的变化及管理人业务的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

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：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

注册资本：252.20亿元

法定代表人：缪建民

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

联系人：张燕

#### 2、发展概况

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2020年6月30日，招商银行总资产80,318.26亿元人民币，高级法下资本充足率14.90%，权重法下资本充足率12.49%。

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，现下设业务管理团队、产品管理团队、项目管理团队、稽核监察团队、基金外包业务团队、养老金团队、系统与数据团队7个职能团队，现有员工96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，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管、存托凭证试点存托人等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，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“6心”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，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《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；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理“金贝奖”“最佳资产托管银行”。2017年6月招商银行再度荣膺《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”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”。2018年1月招商银行荣膺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”奖项；同月，招商银行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月荣膺公募基金20年“最佳基金托管银行”奖；5月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”；12月荣膺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月招商银行荣获《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6月荣获《财资》“中国最佳托管机构”“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。

## 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。十九届中央候补委员。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。

田惠宇先生，招商银行行长、执行董事，2013年5月起担任招商银行行长、招商银行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

汪建中先生，招商银行副行长。1991年加入招商银行；2002年10月至2013年12月历任招商银行长沙分行行长，总行公司银行部副总经理，佛山分行筹备组组长，佛山分行行长，武汉分行行长；2013年12月至2016年10月任招商银行业务总监兼公司金融总部总裁，期间先后兼任公司金融综合管理部总经理、战略客户部总经理；2016年10月至2017年4月任招商银行业务总监兼北京分行行长；2017年4月起任招商银行党委委员兼北京分行行长。2019年4月起任招商银行副行长。

刘波先生，招商银行资产托管部总经理，硕士研究生毕业，高级经济师，具有基金托管人高级管理人员任职资格。1999年7月加入招商银行，历任招商银行重庆分行干部、总行计划财务部副经理、经理、高级经理、总行资产负债管理部总经理助理、深圳分行党委委员、行长助理、副行长等职务，具有20余年银行

从业经验。

### 三、基金托管业务经营情况

截至 2020 年 6 月 30 日，招商银行股份有限公司累计托管 641 只证券投资基金。

### 四、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；

二级内部控制及风险防范是招商银行资产托管部设立稽核监察团队，负责部门内部风险预防和控制；

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我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、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，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形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，根据法律法规和其他有关规定调用资料，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(4) 信息技术系统风险控制。招商银行对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房 24 小时值班并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、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队队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源管理。

#### **五、托管人对管理人运作集合计划进行监督的方法和程序**

根据《基金法》、《运作办法》等有关法律法规的规定及《集合计划合同》、托管协议的约定，对集合计划投资范围、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。

在为集合计划投资运作所提供的集合计划清算和核算服务环节中，托管人对管理人发送的投资指令、管理人对各集合计划费用的提取与支付情况进行检查监督，对违反法律法规、《集合计划合同》的指令拒绝执行，并立即通知管理人。

托管人如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《集合计划合同》约定，及时以书面形式通知管理人进行整改，整改的时限应符合法律法规及《集合计划合同》允许的调整期限。管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向托管人发出回函并改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。

---

---

## 第五部分 相关服务机构

### 一、集合计划销售机构

#### 1、直销机构

名称：上海国泰君安证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室

成立日期：2010 年 8 月 27 日

注册资本：20 亿元人民币

法定代表人：江伟

办公地址：上海市东园路 111 号

联系电话：021-38676999

联系人：甘珉

#### 2、其他销售机构：

##### （1）招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

客户服务电话：95555

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

##### （2）国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

法定代表人：贺青

客户服务电话：95521

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

##### （3）深圳众禄基金销售股份有限公司

住所：广东省深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场一期四层12-13室

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006788887

网址：www.jjmmw.com

(4) 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：刘连舸

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

(5) 重庆银行股份有限公司

住所：重庆市江北区永平门街6号

法定代表人：林军

客户服务电话：96899

网址：www.cqcbank.com

(6) 京东肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西三旗建材城中路12号17号平房157

法定代表人：王苏宁

客户服务电话：95118

网址：kenterui.jd.com

(7) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层

法定代表人：其实

客户服务电话：4001818188或95021

网址：www.1234567.com.cn

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》进行公告。

## 二、集合计划登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

---

---

电话：010-50938888

传真：010-50938828

联系人：张喆

### 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：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

### 四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

办公地址：上海市世纪大道100号环球金融中心50楼

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：021-22288888

传真：021-22280000

联系人：丁鹏飞

经办注册会计师：李斐、丁鹏飞

---

---

## 第六部分 集合计划的历史沿革

国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划由国泰君安君得稳一号集合资产管理计划变更而来。

国泰君安君得稳一号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，自2013年2月19日起开始募集，于2013年2月21日结束募集工作，并于2013年2月27日成立。2013年5月31日，国泰君安君得稳一号集合资产管理计划取得《关于上海国泰君安证券资产管理有限公司发起设立国泰君安君得稳一号集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函〔2013〕941号）。

根据中国证监会于2018年11月30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，国泰君安君得稳一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。

经中国证监会批准，《国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同》自集合计划管理人公布的生效之日起生效，原《国泰君安君得稳一号集合资产管理计划管理合同》同日起失效。

---

---

## 第七部分 集合计划的存续

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，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 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、与其他集合资产管理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。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

## 第八部分 集合计划份额的申购与赎回

### 一、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。

### 二、申购和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（若本集合计划参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则管理人有权根据实际情况决定本集合计划暂停申购、赎回及转换业务并公告），但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，管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

管理人可根据实际情况依法决定本集合计划开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

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

管理人不得在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。

### 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》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 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；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；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。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他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载明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

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，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项

退还给投资人。

集合计划销售机构对申购、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请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资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、投资人单笔申购的最低金额为 1000 元，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

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。

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，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。

5、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》的有关规定在指定媒介上公告。

#### 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

##### 1、申购费

(1) 投资人申购集合计划份额时，需交纳申购费用，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	1.50%
100 万元 ≤ M < 300 万元	1.00%
300 万元 ≤ M < 500 万元	0.80%
M ≥ 500 万	每笔 1000 元

(2) 申购费用由投资人承担，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

本集合计划的赎回费在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。集合计划份额的赎回费率按照持有时间递减，即集合计划份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。具体赎回费率如下表所示：

持有期限 (N)	赎回费率
$N < 7$ 日	1.50%
$7 \text{ 日} \leq N < 180$ 日	0.75%
$180 \text{ 日} \leq N < 365$ 日	0.50%
$N \geq 365$ 日	0

本集合计划对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入集合计划财产；对持续持有期大于等于 30 日少于 90 日的投资人，将赎回费总额的 75% 计入集合计划财产；对持续持有期大于等于 90 日但少于 180 日的投资人，将赎回费总额的 50% 计入集合计划财产；对持续持有期大于等于 180 日的投资人，将赎回费总额的 25% 计入集合计划财产。未归入集合计划财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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》的有关规定在指定媒介上公告。

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) 申购费用适用比例费率时：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日集合计划份额净值}$$

(2) 申购费用为固定金额时：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日集合计划份额净值}$$

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

例：某投资者投资 5 万元申购本集合计划，则对应的申购费率为 1.50%，假设申购当日集合计划份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 1.50\%) = 49,261.08 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000 - 49,261.08 = 738.92 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49,261.08 / 1.0500 = 46,915.31 \text{ 份}$$

即：投资者投资 5 万元申购本集合计划，假设申购当日集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 46,915.31 份的集合计划份额。

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

$$\text{申购费用} = 1,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 5,500,000 - 1,000 = 5,499,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 5,499,000 / 1.0500 = 5,237,142.86 \text{ 份}$$

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

## 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集合计划份额净值扣减其他相应的费用，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：某持有人赎回5万份本集合计划份额，持有满183日，则对应的赎回费率为0.5%，假设赎回当日集合计划份额净值为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=52,500×0.5%=262.50元

净赎回金额=52,500-262.50=52,237.50元

即：持有人赎回5万份本集合计划份额，持有满183日，假设赎回当日集合计划份额净值为1.0500元，则其可得到52,237.50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、发生集合计划合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市或休市，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指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，被拒绝部分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、发生集合计划合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

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

7、法律法规规定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，管理人应在当日报中国证监会备案，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，按集合计划合同的相关条款处理。份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

处理，无优先权并以下一开放日的集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 在出现巨额赎回时，对于单个集合计划份额持有人当日超过上一开放日集合计划总份额 20% 以上的赎回申请，管理人可以对超过的部分全部进行延期办理，具体措施如下：延期的赎回申请将自动与下一个开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如该单个集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于此类持有人未超过上述比例的部分，管理人有权根据前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的方式与其他持有人的赎回申请一并办理。但是，如此类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。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，并于两日内在指定媒介上刊登公告。

#### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

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，在指定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公布最近 1 个开放日的集合计划份额净值；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，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、集合资产管理计划转换

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,集合资产管理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,集合计划销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。

## 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

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。

## 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、如相关法律法规允许管理人办理其他集合计划业务,管理人将制定和实施相应的业务规则。

## 第九部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

本集合计划利用管理人的研究优势，主要投资于具备持续增长能力的优秀企业，并通过宏观、市场和价值分析，捕捉价值型公司（价值公司）的投资机会。通过科学合理的资产配置和股票组合，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。

### 二、投资范围

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、股指期货、国债期货、股票期权、债券（含国债、金融债、可转换债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、可交换债券、可分离交易债券的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具等，以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划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集合资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产比例为 50%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更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

本集合计划采取积极的资产配置策略，通过宏观策略研究，辅之以管理人自行开发的数量化辅助模型，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类

资产配置比例。

本集合计划将从分析集合计划投资者行为特点和需求入手，确定流动性需求，并将其作为资产配置和构建投资组合的一个约束条件，同时配合大额退出的制度安排，使投资组合能够满足流动性需要。

## 2、股票投资策略

本集合计划采取的是自上而下和自下而上相结合的选股策略。本集合计划将从行业配置策略和公司精选两方面进行具体股票筛选，并基于此形成两级股票池。

### 1) 行业配置策略

本集合计划将通过分析宏观经济、产业政策和行业景气程度，以中国证监会行业分类标准为基础，挑选出以下行业：

增长前景持续向好的行业或处于周期景气复苏上升期的行业；

随 GDP 增长、居民收入提高以及城市化过程出现重大机遇的行业；

宏观经济调整周期内仍有稳定增长的行业；

受益于人民币升值周期和经济结构性调整的行业。

### 2) 公司股票精选策略

本集合计划结合使用定量分析和定性分析两方面的方法精选符合条件的股票。本集合计划定量分析使用的指标包括成长指标、价值指标和盈利指标，针对不同行业采取相应的估值方法。同时，本集合计划对精选公司使用内部的企业竞争力分析等方法进行定性分析，结合行业估值模型来考察个股的基本面，并判断企业是否具备以下特征：

行业地位突出、有市场定价能力，主营业务鲜明且具备核心竞争力；

公司治理结构比较规范，管理能力较强；

有合理的可持续的盈利模式；

具备长远规划；

注重股东长期回报；

有一定的自主品牌和创新能力；

财务状况稳健，现金流良好。

## 3、组合调整策略

本集合计划采用两级仓位配置策略确定股票的仓位。股票总仓位包含基本仓位和动态仓位两部分。其中，基本仓位一般保持在 50%左右，主要投资增长明确、可长期持有的成长股（即明星股）和估值便宜、有一定行业发展机遇的价值股（即价值股）。动态仓位主要体现策略研究和行业研究的成果，通过宏观、市场流动性和行为金融分析，选择具有阶段性机会的蓝筹股和主题股票，以期通过灵活的动态仓位调整策略，体现研究价值，获得超额收益。但从整体而言，产品仓位会较为稳定在一个合适的水平，年均换手率也将明显低于同类产品，从而更好地体现研究和长期投资的价值。

#### 4、股指期货、国债期货交易策略

##### （1）股指期货投资策略

在股指期货投资上，本集合计划以套期保值和有效管理为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本集合计划在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率，并利用股指期货流动性较好的特点对冲集合计划的流动性风险，如大额申购赎回等。

##### （2）国债期货投资策略

在风险可控的前提下，本集合计划将本着谨慎原则适度参与国债期货投资。本集合计划参与国债期货交易以套期保值为主要目的，运用国债期货对冲风险。本集合计划将根据对债券现货市场和期货市场的分析，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，发挥国债期货杠杆效应和流动性较好的特点，灵活运用多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲收益率曲线平坦、陡峭等形态变化的风险、对冲关键期限利率波动的风险；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

#### 5、债券的投资策略

本集合计划将采取利率策略、信用策略、债券选择策略等积极投资策略，在

严格控制风险的前提下，发掘和利用市场失衡提供的投资机会，以实现组合增值的目标。

### （1）利率策略

通过全面研究 GDP、物价、就业以及国际收支等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，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，以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。

组合久期是反映利率风险最重要的指标。本集合计划将根据对市场利率变化趋势的预期，制定出组合的目标久期：预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。

### （2）信用策略

根据国民经济运行周期阶段，分析企业债券、公司债券等发行人所处行业发展前景、业务发展状况、市场竞争地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定企业债券、公司债券的信用风险利差。

债券信用风险评定需要重点分析企业财务结构、偿债能力、经营效益等财务信息，同时需要考虑企业的经营环境等外部因素，着重分析企业未来的偿债能力，评估其违约风险水平。

### （3）债券选择策略

根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素，确定其投资价值，主要选择定价合理或价值被低估的企业（公司）债券进行投资。

### （4）可转债的投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性。本集合计划将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券进行投资，并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值，以合理价格买入并持有。本集合计划持有的可转换债券可以转换为股票。

## 6、资产支持证券等品种投资策略

资产支持证券包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券

(MBS) 等, 其定价受多种因素影响, 包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本集合计划将深入分析上述基本面因素, 并辅助数量化定价模型, 评估其内在价值。

#### 7、股票期权的投资策略

管理人认为在符合一定条件的市场环境中, 有必要审慎灵活地综合运用非线性品种期权来增加投资组合策略和套期保值交易的多样性、降低投资组合波动性并提高资金管理效率。本集合计划参与股票期权策略主要分为套期保值和套利两大类。前者和股指期货互为替代, 在综合考虑对冲成本和流动性的前提下选择最优的对冲工具。后者由于期权非线性的特征提供了许多套利类组合方式, 主要是在市场波动率异常的情况下进行波动率交易。本集合计划参与股票期权投资时将综合考虑: 1) 期权交易品种的流动性; 2) 期权交易品种的杠杆和成本; 3) 通过期权进行套期保值交易的必要性; 以及 4) 期权各类套利策略的盈亏空间, 来判断是否进行套期保值交易或套期保值的合理对冲比率以及是否参与套利交易。

#### 8、港股投资策略

本集合计划将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场, 不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。重点关注: (1) 具有持续领先优势或核心竞争力的企业; (2) 与 A 股同类公司相比具有相对优势的公司。

### 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) 股票资产占集合计划资产比例为 50%-95% (其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%);

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持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%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3) 本集合计划持有一家公司发行的证券, 其市值 (同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算) 不超过集合计划资产净值的 10%;

(4) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

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

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

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

(8) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

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

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

(12) 本集合计划管理人管理的全部开放式集合资产管理计划（包括开放式集合资产管理计划以及处于开放期的定期开放集合资产管理计划）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(13) 本集合计划投资股指期货、国债期货时，应当遵守下列限制：

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

2) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证

券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

3) 在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 20%；本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）应当符合《集合计划合同》关于股票投资比例的有关约定；

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

（14）本集合计划投资股票期权的，应当遵守下列限制：

1) 因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过集合计划资产净值的 10%；

2) 开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3) 未平仓的期权合约面值不得超过集合计划资产净值的 20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（15）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；

（16）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；

(17) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(9)、(15)、(16)项情形之外，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。法律法规另有规定的，从其规定。

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。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) 买卖其他集合资产管理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。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，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，本集合计划可以变更后的规定为准。经与托管人协商一致，管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对集合计划合同进行变更，该变更无须召开集合计划份额持有人大会审议。

### 五、业绩比较基准

本集合计划的业绩比较基准为： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 60\% + \text{中债综合指数收益率} \times 30\% + \text{恒生指数收益率} \times 10\%$

沪深 300 指数是由沪深 A 股中规模大、流动性好的最具代表性的 300 只股票组成，于 2005 年 4 月 8 日正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。选择该基准的原因：考虑到沪深 300 指数可以较为综合的、全面的反映出中国 A 股市场的基本情况，所以选择该指数。

中债综合指数是中国全市场债券指数，以 2001 年 12 月 31 日为基期，基点为 100 点，并于 2002 年 12 月 31 日起发布。中债综合指数的样本具有广泛的市场代表性，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成分债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类。选择中债综合指数作为本集合计划业绩比较基准的主要理由是：第一，该指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，并在中国债券网公开发布，具有较强的权威性和市场影响力；第二，该指数的样本券涵盖面广，能较好地反映债券市场的整体收益。

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

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，或今后法律法规发生变化，或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本管理人可依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，经履行适当程序，调整业绩比较基准并及时公告。

## 六、风险收益特征

本集合计划为混合型集合资产管理计划，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券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，属于中风险/收益的产品。

## 七、管理人代表集合计划行使股票或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股；

3、有利于集合计划财产的安全与增值；

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

## 八、集合计划投资组合报告

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。

托管人根据集合计划合同规定，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取自国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划2020年第3季度报告，所载数据截至2020年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 1、报告期末集合计划资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,218,356,069.95	86.96
	其中：股票	1,218,356,069.95	86.96
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	65,000,000.00	4.64
	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	106,815,336.01	7.62
8	其他资产	10,818,207.41	0.77
9	合计	1,400,989,613.37	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	643,004,540.63	46.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,403.91	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	48,996,000.00	3.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	300,895,188.97	21.57
J	金融业	18,204,000.00	1.30
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	16,547,507.20	1.19
M	科学研究和技术服务业	28,695,609.64	2.06
N	水利、环境和公共设施管理业	14,423.76	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

合计	1,056,366,674.11	75.71
----	------------------	-------

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
非日常生活消费品	14,873,214.72	1.07
日常消费品	81,220,089.60	5.82
金融	4,539,467.52	0.33
电信服务	40,760,305.92	2.92
地产业	20,596,318.08	1.48
合计	161,989,395.84	11.61

3、报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名股票投

资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00291	华润啤酒	1,950,000	81,220,089.60	5.82
2	000568	泸州老窖	490,000	70,339,500.00	5.04
3	300450	先导智能	1,160,000	56,132,400.00	4.02
4	600872	中炬高新	820,000	53,710,000.00	3.85
5	000799	酒鬼酒	650,000	53,527,500.00	3.84
6	600276	恒瑞医药	581,640	52,242,904.80	3.74
7	002624	完美世界	1,550,000	51,615,000.00	3.70
8	600004	白云机场	3,600,000	48,996,000.00	3.51
9	002690	美亚光电	973,519	46,680,236.05	3.35
10	603983	丸美股份	700,000	45,143,000.00	3.24

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本集合计划本报告期末未持有债券。

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

本集合计划本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名资产支

持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名贵金属

## 投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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

本集合计划本报告期末未持有权证。

### 9、报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

### 10、报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

### 11、投资组合报告附注

(1) 本报告期内集合计划投资的前十名证券的发行主体（除“中炬高新”公告违规外）没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

根据中炬高新 2019 年 10 月到 2020 年 9 月期间发布的公告，中炬高新因未及时披露关联交易事项，受到监管局警示的处罚。

本集合计划管理人此前投资中炬高新发行的股票时，严格执行了公司的投资决策流程，在充分调研的基础上，按规定将该股票纳入本集合计划股票池，而后进行了投资，并进行了持续的跟踪研究。

该情况发生后，本集合计划管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本集合计划管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

(2) 集合计划投资的前十名股票中，没有投资于超出集合计划合同规定备选股票库之外的情况。

#### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	325,924.86
2	应收证券清算款	10,095,656.71
3	应收股利	185,654.84
4	应收利息	35,601.57

5	应收申购款	175,369.43
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,818,207.41

(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前十名股票中不存在流通受限情况。

## 第十部分 集合计划的业绩

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

集合计划合同变更生效日为2020年3月25日，集合计划业绩截止日为2020年9月30日。

1、本报告期集合计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.22%	1.40%	5.58%	1.03%	-3.36%	0.37%
过去六个月	32.22%	1.26%	14.00%	0.88%	18.22%	0.38%
自集合计划合同生效之日起至今	33.67%	1.28%	15.72%	0.88%	17.95%	0.40%

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



注：本集合计划合同变更于2020年3月25日生效，截至本报告期末集合计划合

---

同变更生效未满一年。

---

---

## 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、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。

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、债券、期货合约、股票期权合约、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

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

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

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

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

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

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；

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

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

##### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、

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

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

4、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。

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

6、股指期货合约、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、股票期权合约以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

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

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

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

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

## 五、估值程序

1、集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，集合计划资产净值除以当日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。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。

2、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或集合计划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，将当日的集合计划资产净值和集合计划份额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。

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

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

### 2、估值错误处理原则

(1) 估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

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

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

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

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

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下:

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

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

(3) 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，管理人和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 本集合计划的会计责任方由管理人担任，与本集合计划有关的会计问题，如经管理人、托管人在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的建议执行，由此给集合计划份额持有人和基金财产造成的损失，由管理人负责赔付。

② 若管理人计算的集合计划份额净值已由托管人复核确认后公告，由此给集合计划份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或集合计划支付赔偿金额，就实际向投资者或集合计划支付的赔偿金额，管理人与托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

③ 如管理人和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，由管理人负责赔付。

④ 由于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，由管理人负责赔付。

(4) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

---

4、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净值信息由管理人负责计算, 托管人负责进行复核。管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人, 由管理人按规定对集合计划净值予以公布。

#### 九、特殊情况的处理

1、管理人或托管人按集合计划合同约定的估值方法第 9 项进行估值时, 所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理;

2、由于不可抗力, 或由于证券、期货交易所、期货公司、登记结算公司等机构发送的数据错误等原因, 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, 但未能发现错误的, 由此造成的集合计划资产估值错误, 管理人和托管人免除赔偿责任, 但管理人、托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 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《集合计划合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

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

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

4、每一集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

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、收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

### 六、集合计划收益分配中发生的费用

集合计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。

---

---

当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，登记机构可将集合计划份额持有人的现金红利自动转为集合计划份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 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、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 4、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费等；
- 5、集合计划份额持有人大会费用；
- 6、集合计划的证券、期货交易费用；
- 7、集合计划的银行汇划费用；
- 8、集合计划的开户费用、账户维护费用；
- 9、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 10、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。

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人核对无误后，由托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

#### 2、托管人的托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人核对无误后，由托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

上述“一、集合计划费用的种类”中第 3—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

### 三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

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

2、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；

3、《集合计划合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目。

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

### 二、集合计划的年度审计

- 1、管理人聘请与管理人、托管人相互独立的具有证券、期货相关从业资格的会计师事务所及其注册会计师对本集合计划的年度财务报表进行审计。
- 2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得管理人同意。
- 3、管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报托管人。更换会计师事务所需依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。

## 第十六部分 集合计划的信息披露

一、本集合计划的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《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管理人、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等法律、行政法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

本集合计划信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内，将应予披露的集合计划信息通过中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）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、诋毁其他管理人、托管人或者集合计划销售机构；
- 5、登载任何自然人、法人和非法人组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6、中国证监会禁止的其他行为。

四、本集合计划公开披露的信息应采用中文文本。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）招募说明书、《集合计划合同》、托管协议、集合计划产品资料概要

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、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，招募说明书的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在指定网站上；招募说明书其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新招募说明书。

3、托管协议是界定托管人和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、集合计划产品资料概要是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，集合计划产品资料概要的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内更新集合计划产品资料概要，并登载在指定网站及销售机构网站或营业网点；集合计划产品资料概要其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新集合计划产品资料概要。

管理人应将招募说明书提示性公告和《集合计划合同》提示性公告登载在指定报刊上，将招募说明书、集合计划产品资料概要、《集合计划合同》和托管协议登载在指定网站上，并将集合计划产品资料概要登载在销售机构网站或营业网点；托管人应当同时将《集合计划合同》、托管协议登载在指定网站上。

（二）《集合计划合同》生效公告

管理人应当在指定媒介上登载《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，在开始办理集合计划份额申购或者赎回前，管理人应当至少每周在指定网站披露一次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，管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、销售机构网站或者营业网点披露开放日的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

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

#### （四）集合计划份额申购、赎回价格

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，包括年度报告、中期报告和季度报告（含资产组合季度报告）

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

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

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

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

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

管理人应当在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，并登载在指定报刊和指定网站上。

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、更换管理人、托管人、份额登记机构，集合计划改聘会计师事务所；
- 5、管理人委托相关服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托相关服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；
- 6、管理人、托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、管理人变更持有百分之五以上股权的股东、管理人的实际控制人变更；
- 8、管理人的高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
- 9、管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，管理人、托管人专门基金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、涉及集合计划财产、集合资产管理计划管理业务、集合资产管理计划托管业务的诉讼或仲裁；
- 11、管理人或其高级管理人员、集合计划投资经理因集合资产管理计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，托管人或其专门基金托管部门负责人因集合资产管理计划托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 12、管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，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、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 15、集合计划份额净值估值错误达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、管理人采用摆动定价机制进行估值；

22、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，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （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）清算报告

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

#### （十）投资资产支持证券的信息披露

管理人应在年报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。

#### （十一）投资股指期货的信息披露

管理人应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）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损

益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

#### （十二）投资国债期货的信息披露

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

#### （十三）投资股票期权的信息披露

管理人应在定期信息披露文件中披露股票期权交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示期权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。

#### （十四）参与港股通交易的信息披露

管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本集合计划参与港股通交易的相关情况。

#### （十五）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

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

管理人、托管人应当在指定媒介中选择一家披露本集合计划信息。管理人、托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的集合计划信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

管理人、托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公

---

---

共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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。

管理人、托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平对待投资者、不误导投资者、不影响集合计划正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从集合计划财产中列支。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

## 第十七部分 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和股票，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) 上市公司经营风险。上市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上市公司经营不善，其债券价格可能下跌，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。

## 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：一是管理人建仓时或为实现投资收益而进行组合调整时，可能会由于特定投资标的流动性相对不足而无法按预期的价格将股票或债券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，当个券的流动性较差时，管理人被迫在不适当的价格大量抛售股票或债券。两者均可能使集合计划净值受到不利影响。

### (1) 集合计划申购、赎回安排

**本集合计划为开放式，投资人可在本集合计划的开放日办理集合计划份额的申购和赎回业务。**为切实保护存量份额持有人的合法权益，遵循份额持有人利益优先的原则，管理人将合理控制集合计划份额持有人集中度，审慎确认申购、赎回业务申请，包括但不限于：

1) 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。

2) 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。

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

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，主要投资对象为具有良好流动性的金融工具，包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票（以下简称“港股通标的股票”）、股指期货、国债期货、股票期权、债券（含国债、金融债、可转换债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、可交换债券、可分离交易债券的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、现金等，以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）；同时，本集合计划基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本集合计划的流动性风险适中。

### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

根据《流动性风险规定》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：当管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

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

3) 在出现巨额赎回时，对于单个集合计划份额持有人当日超过上一开放日集合计划总份额 20%以上的赎回申请，管理人可以对超过的部分全部进行延期办理，具体措施如下：延期的赎回申请将自动与下一个开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如该单个集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于此类持有人未超过上述比例的部分，管理人有权根据前述“1) 全额赎回”或“2) 部分延期赎回”的方式与其他持有人的赎回申请一并办理。但是，如此类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。

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

本集合计划巨额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。

(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、收取短期赎回费、暂停集合计划估值、摆动定价等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，管理人将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。

#### 4、本集合计划特有风险

(1) 本集合计划的投资组合比例：股票资产占集合计划资产比例为50%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%）；管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，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股指期货、国债期货、股票期权。股指期货、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。投资股票期权所面临的主要风险是股票期权价格波动带来的市场风险；因保证金不足、备兑证券数量不足或持仓超限而导致的强行平仓风险；股票期权具有高杠杆性，当出现不利行情时，微小的变动可能会使投资人权益遭受较大损失；包括对手方风险和连带风险在内的第三方风险；以及各类操作风险。

(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）流通受限证券的风险

本集合计划可投流通受限证券，因此本集合计划可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

#### （5）本集合计划可投资于科创板股票，科创板股票的特有风险包括：

1) 科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性，投资者应当关注科创板公司盈利能力巨变的风险。

2) 科创板企业可能存在首次公开发行前最近 3 个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形。

3) 科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市。

4) 科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%，应当关注可能产生的股价波动的风险。

5) 科创板股票的交易制度与主板存在明显差异。例如上市首日即可作为融资融券标的，与上交所主板市场存在差异，投资者应注意相关风险。科创板股票交易盘中临时停牌情形和严重异常波动股票核查制度与上交所主板市场规定不同，投资者应当关注与此相关的风险。

6) 科创板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改，或者制定新的法律法规和业务规则，投资者应当关注规则变化的风险。

(6) 集合计划参与内地与香港股票市场交易互联互通机制（以下简称“港股通机制”）下港股通相关业务，集合计划资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于：

①海外市场风险

本集合计划在参与港股市场投资时将受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险。

②股价波动较大的风险

港股市场实行 T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，本集合计划的波动风险可能相对较大。

③汇率风险

本集合计划在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率，港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率，本集合计划可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本集合计划在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本集合计划将因此而遭遇资金被额外占用进而降低投资效率的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

④港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有每日额度上限的限制；本集合计划可能因为港股通市场每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。

⑤港股通可投资标的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入，本集合计划可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

### ⑥港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯、港股不能及时卖出的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易），导致本集合计划所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应，可能带来一定的流动性风险，造成其价格波动骤然增大，进而导致本集合计划所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

### ⑦交收制度带来的集合计划流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本集合计划在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本集合计划可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险。

### ⑧港股通标的权益分派、转换等的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本集合计划因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本集合计划存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

### ⑨香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地 A 股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与 A 股市场存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记（例如，ST 及 \*ST 等标记）以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板，联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较

大的主导权，使得联交所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。

因该等制度性差异，本集合计划可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而带来损失的风险。

#### ⑩港股通规则变动带来的风险

本集合计划是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资，受港股通规则的限制和影响；本集合计划存在因港股通规则变动而带来投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

#### ⑪其他可能的风险

除上述显著风险外，本集合计划参与港股通投资，还可能面临的其他风险，包括但不限于：

i 除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费外，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，本集合计划存在因费用估算不准而导致账户透支的风险；

ii 在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏，本集合计划投资此类股票可能因缺乏交易对手而面临个股流动性风险；

iii 在本集合计划参与港股通交易中若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

iv 存在港股通香港结算机构因极端情况下无法交付证券和资金的结算风险；另外港股通境内结算实施分级结算原则，本集合可能面临以下风险：（a）因结算参与者未完成与中国结算的集中交收，导致本集合计划应收资金或证券被暂不交付或处置；（b）结算参与者对本集合计划出现交收违约导致本集合未能取得应收证券或资金；（c）结算参与者向中国结算发送的有关本集合的证券划付指令有误的导致本集合权益受损；（d）其他因结算参与者未遵守相关业务规则导致本集合利益受到损害的情况。

#### 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。

## 第十八部分 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，由管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《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，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

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

### 三、集合计划财产的清算

1、集合计划财产清算小组：自出现《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，管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

(1) 《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，清算期限可相应顺延。

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

#### 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 15 年以上。

## 第十九部分 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) 管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

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

(7) 在托管人更换时，提名新的托管人；

(8) 选择、更换集合计划销售机构，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》及有关法律的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) 以管理人的名义，代表集合计划份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

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

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《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，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《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) 监督托管人按法律法规和《集合计划合同》规定履行自己的义务，托管人违反《集合计划合同》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《集合计划合同》约定的其他义务。

## (二) 托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

(1) 自《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) 监督管理人对本集合计划的投资运作，如发现管理人有违反《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，为集合计划开设资金账户、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) 在管理人更换时，提名新的管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《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，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、合格的熟悉托管业务的专职人员，负责集合计划财产托管事宜；

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

(4) 除依据《基金法》、《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、审查管理人计算的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购、赎回价格；

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；

(14) 依据管理人的指令或有关规定向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》的规定监督管理人的投资运作；

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

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

(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) 按规定监督管理人按法律法规和《集合计划合同》规定履行自己的义务，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

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。

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) 监督管理人的投资运作；
- (8) 对管理人、托管人、集合计划服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《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《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) 关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳集合计划申购款项及法律法规和《集合计划合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的集合计划份额范围内，承担集合计划亏损或者《集合计划合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损集合计划及其他《集合计划合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《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) 更换管理人；
- (3) 更换托管人；
- (4) 转换集合计划运作方式；
- (5) 调整管理人、托管人的报酬标准；
- (6) 变更集合计划类别；
- (7) 本集合计划与其他集合资产管理计划的合并；
- (8) 变更集合计划投资目标、范围或策略；

- (9) 变更集合计划份额持有人大会程序；
- (10) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；
- (11) 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；
- (12) 对本合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《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，以下情况可由管理人和托管人协商后修改，不需召开集合计划份额持有人大会：

- (1) 法律法规要求增加或调整的集合计划费用的收取；
- (2) 调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；
- (3) 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；
- (4) 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；
- (5) 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管理人召集。

2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集。

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

4、代表集合计划份额 10%以上（含 10%）的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，应当向管理人提出书面提议。管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的集合

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

5、代表集合计划份额 10%以上（含 10%）的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，而管理人、托管人都不召集的，单独或合计代表集合计划份额 10%以上（含 10%）的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，管理人、托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

（三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席集合计划份额持有人大会的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、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为管理人，还应另行书面通知托管人到指定地点对表决意见的

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

#### （四）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，现场开会时管理人和托管人的授权代表应当列席集合计划份额持有人大会，管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行集合计划份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有集合计划份额的凭证、受托出席会议者出具的集合计划份额持有人持有集合计划份额的凭证及集合计划份额持有人的代理投票授权委托书符合法律法规、《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托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取份额持有人的书面表决意见；托管人或管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，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）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面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）集合计划份额的集合计划份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的集合计划份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有集合计划份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的集合计划份额持有人持有集合计划份额的凭证及集合计划份额持有人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《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、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

#### (五) 议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系集合计划份额持有人利益的重大事项，如《集合计划合同》的重大修改、决定终止《集合计划合同》、更换管理人、更换托管人、与其他集合资产管理计划合并、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。大会主持人为管理人授权出席会议的代表，在管理人授权代表未能主持大会的情况下，由托管人授权其出席会议的代表主持；如果管理人授权代表和托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的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。管理人和托管人拒不出席或主持集合计划份额持有人大会，不影响集合计划份额持有人大会作出的决议的效力。

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

### （2）通讯开会

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

### （六）表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

1、一般决议，一般决议须经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过方为有效；除下列第 2 项所规定的

须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。

2、特别决议，特别决议应当经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除《集合计划合同》另有约定外，转换集合计划运作方式、更换管理人或者托管人、终止《集合计划合同》、本集合计划与其他集合资产管理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书面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，但应当计入出具书面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）如大会由管理人或托管人召集，集合计划份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的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管理人或托管人召集，但是管理人或托管人未出席大会的，集合计划份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的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。管理人或托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

（4）计票过程应由公证机关予以公证，管理人或托管人拒不出席大会的，

不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

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

### （八）生效与公告

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

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

管理人、托管人和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、管理人、托管人均有约束力。

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

## 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》的变更

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

2、关于《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，并自决议生效后两日内在指定媒介公告。

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

## （三）集合计划财产的清算

1、集合计划财产清算小组：自出现《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，管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、具有从事证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

### 4、集合计划财产清算程序：

（1）《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，清算期限可相应顺延。

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

#### （七）集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 15 年以上。

### 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，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，管理人和托管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》受中华人民共和国法律（为集合计划合同之目的，不含港澳台立法）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，供投资者在管理人、托管人、销售机构的办

---

公场所和营业场所查阅。

## 第二十部分 集合计划托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 管理人（也可称资产管理人）

名称：上海国泰君安证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区南苏州路381号409A10室

法定代表人：龚德雄

设立日期：2010年8月27日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会、证监许可【2010】631号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币20亿元

存续期限：永久存续

联系电话：38676999

#### (二) 托管人（也可称资产托管人）

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

邮政编码：518040

法定代表人：李建红

成立时间：1987年4月8日

基金托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币252.20亿元

存续期间：持续经营

### 二、托管人与管理人之间的业务监督、核查

托管人对管理人的业务监督和核查

(一) 托管人根据有关法律法规的规定以及《集合计划合同》的约定,对集合计划投资范围、投资比例、投资限制、关联方交易等进行监督。《集合计划合同》明确约定集合计划投资证券选择标准的,管理人应事先或定期向托管人提供投资品种池,以便托管人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。

1. 本集合计划的投资范围为:

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、股指期货、国债期货、股票期权、债券(含国债、金融债、可转换债券、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债、可分离交易债券、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具等,以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划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. 本集合计划各类品种的投资比例、投资限制为:

(1) 股票资产占集合计划资产比例为50%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%);

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3) 本集合计划持有一家公司发行的证券,其市值(同一家公司在境内和香港市场同时上市的A+H股合并计算)不超过集合计划资产净值的10%;

(4) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划持有一家公司发行的证券(同一家公司在境内和香港市场同时上市的A+H股合并计算),不超过该证券的10%;

(5) 本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得

超过集合计划资产净值的10%；

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

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

(8) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

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

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

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

(12) 本集合计划管理人管理的全部开放式集合资产管理计划(包括开放式集合资产管理计划以及处于开放期的定期开放集合资产管理计划)持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的15%；本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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的30%；

(13) 本集合计划投资股指期货、国债期货时，应当遵守下列限制：

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

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

3) 在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持

有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的20%；本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）应当符合《集合计划合同》关于股票投资比例的有关约定；

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

（14）本集合计划投资股票期权的，应当遵守下列限制：

1) 因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过集合计划资产净值的10%；

2) 开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物；

3) 未平仓的期权合约面值不得超过集合计划资产净值的20%。其中，合约面值按照行权价乘以合约乘数计算；

（15）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；

（16）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；

（17）本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的140%；

（18）法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（9）、（15）、（16）项情形之外，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。法律法规另有规定的，从其规定。

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。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上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制。

3. 本集合计划财产不得用于以下投资或者活动：

- （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、行政法规或者中国证监会规定禁止的其他活动。

4. 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其他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。

5. 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，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，本集合计划可以变更后的规定为准。经与托管人协商一致，管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对集合计划合

同进行变更，该变更无须召开集合计划份额持有人大会审议。

(二) 托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对管理人选择存款银行进行监督。集合计划投资银行定期存款的，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，并及时提供给托管人，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。对于不符合规定的银行存款，托管人可以拒绝执行，并通知管理人。

本集合计划投资银行存款应符合如下规定：

本集合计划投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过集合计划资产净值的30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；本集合计划投资于具有托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占集合计划资产净值的比例合计不得超过20%，投资于不具有托管人资格的同一商业银行的银行存款、同业存单占集合计划资产净值的比例合计不得超过5%。

有关法律法规或监管部门制定或修改新的定期存款投资政策，管理人履行适当程序后，可相应调整投资组合限制的规定。

3. 管理人负责对本集合计划存款银行的评估与研究，建立健全银行存款的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度，切实防范有关风险。托管人负责对本集合计划银行定期存款业务的监督与核查，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。

(1) 管理人负责控制信用风险。信用风险主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。因选择存款银行不当造成集合计划财产损失的，由管理人承担责任。

(2) 管理人负责控制流动性风险，并承担因控制不力而造成的损失。流动性风险主要包括管理人要求全部提前支取、部分提前支取或到期支取而存款银行未能及时兑付的风险、集合计划投资银行存款不能满足集合计划正常结算业务的风险、因全部提前支取或部分提前支取而涉及的利息损失影响估值等涉及到集合计划流动性方面的风险。

(3) 管理人须加强内部风险控制制度的建设。如因管理员工职务行为导致集合计划财产受到损失的，需由管理人承担由此造成的损失。

(4) 管理人与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。

(三) 集合计划投资银行存款协议的签订、账户开设与管理、投资指令与资金划付、账目核对、到期兑付、提前支取

#### 1. 集合计划投资银行存款协议的签订

(1) 管理人应与符合资格的存款银行总行或其授权分行签订《集合计划存款业务总体合作协议》（以下简称《总体合作协议》），确定《存款协议书》的格式范本。《总体合作协议》和《存款协议书》的格式范本由托管人与管理人共同商定。

(2) 托管人依据相关法规对《总体合作协议》和《存款协议书》的内容进行复核，审查存款银行资格等。

(3) 管理人应在《存款协议书》中明确存款证实书或其他有效存款凭证的办理方式、邮寄地址、联系人和联系电话，以及存款证实书或其他有效凭证在邮寄过程中遗失后，存款余额的确认及兑付办法等。

(4) 由存款银行指定的存放存款的分支机构（以下简称“存款分支机构”）寄送或上门交付存款证实书或其他有效存款凭证的，托管人可向存款分支机构的上级行发出存款余额询证函，存款分支机构及其上级行应予配合。

(5) 管理人应在《存款协议书》中规定，集合计划存放到期或提前兑付的资金应全部划转到指定的集合计划托管账户，并在《存款协议书》写明账户名称和账号，未划入指定账户的，由存款银行承担一切责任。

(6) 管理人应在《存款协议书》中规定，在存期内，如本集合计划银行账户、预留印鉴发生变更，管理人应及时书面通知存款行，书面通知应加盖托管人预留印鉴。存款分支机构应及时就变更事项向管理人、托管人出具正式书面确认书。变更通知的送达方式同开户手续。在存期内，存款分支机构和托管人的指定联系人变更，应及时加盖公章书面通知对方。

(7) 管理人应在《存款协议书》中规定，因定期存款产生的存单不得被质押或以任何方式被抵押，不得用于转让和背书。

#### 2. 集合计划投资银行存款时的账户开设与管理

(1) 集合计划投资于银行存款时，管理人应当依据管理人与存款银行签订的《总体合作协议》、《存款协议书》等，以集合计划的名义在存款银行总行或授权分行指定的分支机构开立银行账户。

(2) 集合计划投资于银行存款时的预留印鉴由托管人保管和使用。

### 3. 存款凭证传递、账目核对及到期兑付

#### (1) 存款证实书等存款凭证传递

存款资金只能存放于存款银行总行或者其授权分行指定的分支机构。管理人应在《存款协议书》中规定，存款银行分支机构应为集合计划开具存款证实书或其他有效存款凭证（下称“存款凭证”），该存款凭证为集合计划存款确认或到期提款的有效凭证，且对应每笔存款仅能开具唯一存款凭证。资金到账当日，由存款银行分支机构指定的会计主管传真一份存款凭证复印件并与托管人电话确认收妥后，将存款凭证原件通过快递寄送或上门交付至托管人指定联系人；若存款银行分支机构代为保管存款凭证的，由存款银行分支机构指定会计主管传真一份存款凭证复印件并与托管人电话确认收妥。

#### (2) 存款凭证的遗失补办

存款凭证在邮寄过程中遗失的，由管理人向存款银行提出补办申请，管理人应督促存款银行尽快补办存款凭证，并按以上（1）的方式快递或上门交付至托管人，原存款凭证自动作废。

#### (3) 账目核对

每个工作日，管理人应与托管人核对各项银行存款投资余额及应计利息。

管理人应在《存款协议书》中规定，对于存期超过3个月的定期存款，存款银行应于每季末后5个工作日内向托管人指定人员寄送对账单。因存款银行未寄送对账单造成的资金被挪用、盗取的责任由存款银行承担。

存款银行应配合托管人对存款凭证的询证，并在询证函上加盖存款银行公章寄送至托管人指定联系人。

#### (4) 到期兑付

管理人提前通知托管人通过快递将存款凭证原件寄给存款银行分支机构指定的会计主管。存款银行未收到存款凭证原件的，应与托管人电话询问。存款到期前管理人与存款银行确认存款凭证收到并于到期日兑付存款本息事宜。

托管人在存款到期日未收到存款本息或存款本息金额不符时,通知管理人与存款银行接洽存款到账时间及利息补付事宜。管理人应将接洽结果告知托管人,托管人收妥存款本息的当日通知管理人。

管理人应在《存款协议书》中规定,存款凭证在邮寄过程中遗失的,存款银行应立即通知托管人,托管人在原存款凭证复印件上加盖公章并出具相关证明文件后,与存款银行指定会计主管电话确认后,存款银行应在到期日将存款本息划至指定的集合计划托管账户。如果存款到期日为法定节假日,存款银行顺延至到期后第一个工作日支付,存款银行需按原协议约定利率和实际延期天数支付延期利息。

#### 4. 提前支取

如果在存款期限内,由于集合计划规模发生缩减的原因或者出于流动性管理的需要等原因,管理人可以提前支取全部或部分资金。

提前支取的具体事项按照管理人与存款银行签订的《存款协议书》执行。

#### 5. 集合计划投资银行存款的监督

托管人发现管理人在进行存款投资时有违反有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定的行为,应及时以书面形式通知管理人在10个工作日内纠正。管理人对托管人通知的违规事项未能在10个工作日内纠正的,托管人应报告中国证监会。托管人发现管理人有重大违规行为,应立即报告中国证监会,同时通知管理人在10个工作日内纠正或拒绝结算,若因管理人拒不执行造成集合计划财产损失的,相关损失由管理人承担,托管人不承担任何责任。

(四) 托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定,对管理人参与银行间债券市场进行监督。管理人应在集合计划投资运作之前向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。管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给托管人,否则由此造成的损失应由管理人承担。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。托管人监督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。在集合计划存续期间管理人可以调整交易对手名单,但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知托管人。新名单确定时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，但不得再发生新的交易。如管理人根据市场需要临时调整银行间债券交易对手名单及结算方式的，应向托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个交易日内与托管人协商解决。

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及损失。若未履约的交易对手在管理人确定的时间内仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如托管人事后发现管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，托管人应及时提醒管理人，托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）本集合计划投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关监管规定。

1. 流通受限证券包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。

本集合计划可以投资经中国证监会批准的非公开发行股票，且限于由中国证券登记结算有限责任公司、中央国债登记结算有限责任公司或银行间市场清算所股份有限公司负责登记和存管的，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本集合计划不得投资未经中国证监会批准的非公开发行股票。

本集合计划不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

2. 管理人应在集合计划首次投资流通受限证券前，向托管人提供经管理人董事会批准的有关集合计划投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。集合计划投资非公开发行股票，管理人还应提供管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于集合计划投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至托管人，保证托管人有足够的时间进行审核。托管人应在收到上述资料后两个工作

日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

管理人对本集合计划投资流通受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决集合计划运作的流动性问题。如因集合计划巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致集合计划现金周转困难时，管理人应保证提供足额现金确保集合计划的支付结算，并承担所有损失。对本集合计划因投资流通受限证券导致的流动性风险，托管人不承担任何责任。

3. 集合计划投资流通受限证券前，管理人应向托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，集合计划拟认购的数量、价格、总成本、应划付的认购款、资金划付时间等。管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至托管人，保证托管人有足够的时间进行审核。

由于管理人未及时提供有关证券的具体的必要的信息，致使托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的，托管人免于承担责任。

4. 托管人依照法律法规、《集合计划合同》、《托管协议》审核管理人投资流通受限证券的行为。如发现管理人违反了《集合计划合同》、《托管协议》以及其他相关法律法规的有关规定，应及时通知管理人，并呈报中国证监会，同时采取合理措施保护投资人的利益。托管人有权对管理人的违法、违规以及违反《集合计划合同》、《托管协议》的投资指令不予执行，并立即通知管理人纠正，管理人不予纠正或已代表集合计划签署合同不得不执行时，托管人应向中国证监会报告。

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

（六）管理人应当对投资中期票据业务进行研究，认真评估中期票据投资业务的风险，本着审慎、勤勉尽责的原则进行中期票据的投资业务，并应符合法律法规及监管机构的相关规定。

（七）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、集合计划份额净值计算、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) 托管人发现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、邮件或书面提示等方式通知管理人限期纠正。管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查。管理人收到通知后应及时核对并回复托管人，对于收到的书面通知，管理人应以书面形式给托管人发出回函，就托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限。在上述规定期限内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。

(九) 管理人有义务配合和协助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。包括但不限于：对托管人发出的提示，管理人应在规定时间内答复并改正，或就托管人的疑义进行解释或举证；对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，管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(十) 若托管人发现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，应当立即通知管理人及时纠正，由此造成的损失由管理人承担，托管人在履行其通知义务后，予以免责。

(十一) 托管人发现管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知管理人限期纠正。

#### 管理人对托管人的业务核查

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

(二) 管理人发现托管人擅自挪用集合计划财产、未对集合计划财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行管理人资金划拨指令、泄露集合计划投资信息等违反《基金法》、集合计划合同、托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形

式通知托管人限期纠正。托管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，管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。

(三) 托管人有义务配合和协助管理人依照法律法规、集合计划合同和本托管协议对集合计划业务执行核查，包括但不限于：对管理人发出的书面提示，托管人应在规定时间内答复并改正，或就管理人的疑义进行解释或举证；托管人应积极配合提供相关资料以供管理人核查托管财产的完整性和真实性。

(四) 管理人发现托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知托管人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。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，情节严重或经管理人提出警告仍不改正的，管理人应报告中国证监会。

### 三、集合计划财产的保管

#### (一) 集合计划财产保管的原则

1. 集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。
2. 托管人应安全保管集合计划财产。
3. 托管人按照规定开设集合计划财产投资所需的相关账户。
4. 托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，确保集合计划财产的完整与独立。
5. 托管人根据管理人的指令，按照集合计划合同和本协议的约定保管集合计划财产。未经管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何资产。不属于托管人实际有效控制下的资产及实物证券等在托管人保管期间的损坏、灭失，托管人不承担由此产生的责任。
6. 对于因为集合计划投资产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日集合计划财产没有到达集合计划托管账户的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收，由此给集合计划财产造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿集合计划财产的损失。
7. 托管人对因为管理人投资产生的存放或存管在托管人以外机构的集合计

划资产，或交由证券公司负责清算交收的集合计划资产及其收益，由于该等机构或该机构会员单位等本协议当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给集合计划资产造成的损失等不承担责任。

8. 除依据法律法规和集合计划合同的规定外，托管人不得委托第三人托管集合计划财产。

## （二）集合计划托管账户的开立和管理

1. 托管人以本集合计划的名义在其营业机构开立集合计划的托管账户（也可称为“托管账户”），保管集合计划的银行存款，并根据管理人的指令办理资金收付。托管账户名称应为“国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划”，预留印鉴为托管人印章。

2. 集合计划托管账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得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. 集合计划托管账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

## （三）集合计划证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为集合计划开立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。托管人和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托管人负责，账户资产的管理和运用由管理人负责。

4. 托管人以托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司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，管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5. 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，按有关规定开立、使用并管理；若无相关规定，则托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

#### （四）债券托管账户的开设和管理

集合计划合同生效后，托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以集合计划的名义在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，并代表集合计划进行银行间市场债券的结算。

#### （五）其他账户的开立和管理

1. 管理人根据投资需要按照规定开立期货保证金账户及期货交易编码等，托管人按照规定开立期货结算账户等投资所需账户。完成上述账户开立后，管理人应以书面形式将期货公司提供的期货保证金账户的初始资金密码和市场监控中心的登录用户名及密码告知托管人。资金密码和市场监控中心登录密码重置由管理人进行，重置后务必及时通知托管人。

托管人和管理人应当在开户过程中相互配合，并提供所需资料。管理人保证所提供的账户开户材料的真实性和有效性，且在相关资料变更后及时将变更的资料提供给托管人。

2. 因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和集合计划合同的规定，由管理人协助托管人按照有关法律法规和本协议的约定协商后开立。新账户按有关规定使用并管理。

3. 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等有价凭证按约定由托管人存放于托管人的保管库，或存入中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司、中国证券登记结算有限责任公司或票据营业中心的代保管库，实物保管凭证由托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由托管人根据管理人的指令办理。托管人对由上述存放机构及托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

#### （七）与集合计划财产有关的重大合同的保管

由管理人代表集合计划签署的、与集合计划财产有关的重大合同的原件分别由管理人、托管人保管。除本协议另有规定外，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应保证管理人和托管人至少各持有一份正本的原件。

管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给托管人，并在三十个工作日内将正本送达托管人处。因管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由管理人负责。重大合同的保管期限为集合计划合同终止后不少于 15 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。

对于无法取得二份以上的正本的，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。管理人向托管人提供的合同传真件与管理人留存原件不一致的，以传真件为准。

#### 四、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

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

集合计划份额净值是指估值日集合计划资产净值除以估值日集合计划份额总数，集合计划份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，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、集合计划份额净值，经托管人复核，按规定公告。

###### 2. 复核程序

管理人每工作日对集合计划资产进行估值后，将集合计划资产净值、集合计划份额净值发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人对外公布。

3. 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。本集合计划的集合计划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，仍无法达成一致意见的，按照管理人对集合计划资产净值的计算结果对外予以公布。

##### （二）集合计划资产的估值

管理人及托管人应当按照《集合计划合同》的约定进行估值。

##### （三）集合计划份额净值错误的处理方式

管理人及托管人应当按照《集合计划合同》的约定处理份额净值错误。

##### （四）集合计划会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （五）集合计划账册的建立

管理人和托管人在集合计划合同生效后,应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则,分别独立地设置、记录和保管本集合计划的全套账册,对相关各方各自的账册定期进行核对,互相监督,以保证集合计划资产的安全。

#### （六）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管理人编制,托管人复核。

##### 2. 报表复核

托管人在收到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

管理人、托管人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制及复核;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及复核;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及复核;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及复核。托管人在复核过程中,发现双方的报表存在不符时,管理人和托管人应共同查明原因,进行调整,调整以国家有关规定为准。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关从业资格的会计师事务所审计。集合计划合同生效不足两个月的,管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

（七）在有需要时,管理人应每季度向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、证件号码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管理人的指令编制和保管,管理人和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 15 年,法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管,则按相关法律法规承担责任。

在托管人要求或编制中期报告和年报前，管理人应将有关资料送交托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。管理人和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

各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院，按照深圳国际仲裁院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为深圳市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守管理人和托管人职责，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。

本协议受中华人民共和国法律（为本协议之目的，不含港澳台立法）管辖。

## 七、托管协议的修改与终止

双方对托管协议的效力约定如下：

（一）集合计划管理人向中国证监会提交的托管协议，应经托管协议当事人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，协议当事人双方根据中国证监会的意见修改并正式签署托管协议。托管协议以中国证监会批准的文本为正式文本。

（二）托管协议自集合计划合同生效之日起生效。托管协议的有效期自其生效之日起至集合计划财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

（三）托管协议自生效之日起对托管协议当事人具有同等的法律约束力。

（四）本协议一式三份，协议双方各持一份，由管理人根据需要上报监管机构一份，每份具有同等法律效力。

---

---

## 第二十一部分 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）资料寄送

#### 1、集合计划投资者对账单：

管理人每季度结束后通过书面或电子邮件方式向集合计划份额持有人提供对账单信息，对账单内容应包括集合计划份额持有人持有集合计划份额的数量及净值，参与、退出明细，收益分配等情况。

#### 2、其他相关的信息资料。

### （二）联系方式

上海国泰君安证券资产管理有限公司客服电话：95521

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

## 第二十二部分 其他应披露事项

序号	公告事项	披露方式	披露日期
1	国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划托管协议	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/3/19
2	国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/3/19
3	国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划招募说明书	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/3/19
4	国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同及招募说明书提示性公告	证券日报	2020/3/19
5	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同等法律文件生效的公告	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/3/25
6	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/4/17
7	国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划开放日常赎回业务公告	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/4/21
8	国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划开放日常申购、赎回业务公告	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/4/27
9	国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划2020年第二季度报告	证监会指定网站、公司官网	2020/7/21
10	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分集合计划季度报告提示性公告	证券日报	2020/7/21
11	国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2020/8/28
12	国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划2020年中期报告	证监会指定网站、公司官网	2020/8/28
13	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分集合计划中期报告提示性公告	证券日报	2020/8/28

14	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于董事会成员变更事宜的公告	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/8/29
15	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/9/18
16	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下参公大集合变更简称的公告	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/9/25
17	国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	证监会指定网站、公司官网	2020/9/29
18	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分产品获配隆盛科技（300680）非公开发行 A 股的公告	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/10/27
19	国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划 2020 年第三季度报告	证监会指定网站、公司官网	2020/10/28
20	上海国泰君安证券资产管理有限公司旗下部分集合计划季度报告提示性公告	证券日报	2020/10/28
21	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分产品获配开润股份（300577）非公开发行 A 股的公告	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/11/25
22	上海国泰君安证券资产管理有限公司关于旗下部分产品获配梦百合（603313）非公开发行 A 股的公告	证券日报、证监会指定网站、公司官网	2020/12/4

---

---

## 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) 中国证监会准予国泰君安君得稳一号集合资产管理计划变更为国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划的文件

(二) 国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划资产管理合同

(三) 国泰君安君得诚混合型集合资产管理计划托管协议

(四) 法律意见书

(五) 管理人业务资格批件、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。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

二〇二〇年十二月