

上海光大证券资产管理有限公司

光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型  
集合资产管理计划  
资产管理合同

管理人：上海光大证券资产管理有限公司

托管人：中国光大银行股份有限公司

二〇二一年六月

## 目录

第一部分 集合计划的历史沿革.....	2
第二部分 前言.....	3
第三部分 释义.....	5
第四部分 集合计划的基本情况.....	11
第五部分 集合计划的存续.....	13
第六部分 集合计划份额的申购与赎回.....	14
第七部分 资产管理合同当事人及权利义务.....	23
第八部分 集合计划份额持有人大会.....	30
第九部分 管理人、托管人的更换条件和程序.....	39
第十部分 集合计划的托管.....	42
第十一部分 集合计划份额的登记.....	43
第十二部分 集合计划的投资.....	45
第十三部分 集合计划的财产.....	54
第十四部分 集合计划资产估值.....	55
第十五部分 集合计划费用与税收.....	61
第十六部分 集合计划的收益与分配.....	64
第十七部分 集合计划份额的折算.....	66
第十八部分 集合计划的会计与审计.....	67
第十九部分 集合计划的信息披露.....	68
第二十部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算.....	75
第二十一部分 违约责任.....	77
第二十二部分 争议的处理和适用的法律.....	78
第二十三部分 合同的效力.....	79
第二十四部分 其他事项.....	80
第二十五部分 资产管理合同内容摘要.....	81

## 第一部分 集合计划的历史沿革

本集合计划由光大阳光北斗星集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。

原集合计划为限定性集合资产管理计划，自 2013 年 4 月 15 日起开始募集并于 2013 年 4 月 15 日结束募集，于 2013 年 4 月 18 日成立。2013 年 5 月 31 日取得《关于上海光大证券资产管理有限公司发起设立光大阳光北斗星集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]498 号）。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。变更后的资产管理合同自集合计划管理人公告的生效之日起生效。

## 第二部分 前言

### 一、订立本合同的目的、依据和原则

1、订立本合同的目的是保护投资人合法权益，明确合同当事人的权利义务，规范集合资产管理计划运作。

2、订立本合同的依据是《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)和其他有关法律法规。

3、订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

二、资产管理合同是规定资产管理合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与集合计划相关的涉及资产管理合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与资产管理合同有冲突，均以资产管理合同为准。资产管理合同当事人按照《基金法》、资产管理合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

资产管理合同的当事人包括管理人、集合计划托管人和集合计划份额持有人。集合计划投资人自依本合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和本合同的当事人，其持有集合计划份额的行为本身即表明其对资产管理合同的承认和接受。

三、本集合计划由光大阳光北斗星集合资产管理计划变更而来，原光大阳光北斗星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》、原《光大阳光北斗星集合资产管理计划资产管理合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)批准。

中国证监会对原光大阳光北斗星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集合计划财产，

但不保证投资于本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

投资者应当认真阅读本集合计划招募说明书、资产管理合同、产品资料概要等信息披露文件，自主判断本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。

四、管理人、托管人在本合同之外披露涉及本集合计划的信息，其内容涉及界定资产管理合同当事人之间权利义务关系的，如与资产管理合同有冲突，以资产管理合同为准。

五、本集合计划按照中国法律法规成立并运作，若资产管理合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

六、本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股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。

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

八、本集合计划对于每份集合计划份额，设定 180 天的滚动运作期。每个运作期到期日前，集合份额持有人不能提出赎回申请。每个运作期到期日起 5 个工作日内，集合计划份额持有人方可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日起 5 个工作日内未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该集合计划份额进入下一个运作期。故投资者在运作期间到期日前无法赎回的风险，以及错过当期运作期到期日起 5 个工作日内未能赎回而进入下一运作期的风险。

### 第三部分 释义

在本合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合计划或本集合计划：指光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划

2、管理人：指上海光大证券资产管理有限公司

3、托管人：指中国光大银行股份有限公司

4、资产管理合同、《资产管理合同》或本合同：指《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》及对本合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指管理人与托管人就本集合计划签订之《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书：指《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

7、产品资料概要：指《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新

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

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

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

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

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

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

14、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由境内证券交易所在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

15、港股通交易日：指上海证券交易所、深圳证券交易所证券交易服务公司公布的港股通交易日

16、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

17、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

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

19、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

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

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证券投资基金

的其他投资人的合称

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

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：指上海光大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。集合计划的登记机构为上海光大证券资产管理有限公司或接受上海光大证券资产管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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、集合计划所管理的集合计划份额余额及其变动情况的账户

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、资产管理合同生效日：《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日，原《光大阳光北斗星集合资产管理计划资产管理合同》同日失效

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

32、存续期：指原《光大阳光北斗星集合资产管理计划资产管理合同》生效至本合同终止之间的期限

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、运作期起始日：对于每份集合计划份额，第一个运作期起始日指资产管理合同生效日(对原光大阳光北斗星集合资产管理计划持有人持有的集合计划份额而言，下同)或集合计划份额申购确认日(对申购份额而言，下同)；对于上一运作期到期日起 5 个工作日内未赎回的每份集合计划份额的下一运作期起始日，指该份额上一运作期到期日后的下一日

37、运作期到期日：对于每份集合计划份额，第一个运作期到期日指资产管理合同生效日(对原光大阳光北斗星集合资产管理计划持有人持有的集合计划份额而言，下同)或集合计划份额申购确认日(对申购份额而言，下同)后的第 180 天(如该对应日为非工作日，则顺延到下一工作日)，第二个运作期到期日为资产管理合同生效日或集合计划份额申购确认日后的第 360 天(如该日为非工作日，则顺延至下一工作日)，以此类推

38、开放日：指为投资人办理集合计划份额申购、赎回或其他业务的工作日(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，则管理人可根据实际情况决定本集合计划是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准)，每份集合计划份额仅可在其每个运作期到期日起 5 个工作日内办理赎回业务

39、开放时间：指开放日集合计划接受申购、赎回或其他交易的时间段

40、《业务规则》：指登记机构相关业务规则及其不时做出的修订

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

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

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

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

45、定期定额投资计划：指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期申

购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理集合计划申购申请的一种投资方式

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

47、元：指人民币元

48、集合计划收益：指集合计划投资所得红利、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

49、集合计划资产总值：指集合计划拥有的各类有价证券、银行存款本息、集合计划应收申购款及其他资产的价值总和

50、集合计划资产净值：指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值

51、集合计划份额净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划份额总数

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

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

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

55、集合计划份额类别：指根据申购规则、销售服务费的不同将本集合计划份额分为 A 类份额和 C 类份额，各类份额分别设置代码，并分别计算和公告集合计划份额净值和集合计划份额累计净值

56、A 类份额：指依据资产管理合同，在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别计划资产中计提销售服务费的份额

57、C 类份额：指依据资产管理合同，不收取申购费，并从本类别计划资产中计提销售服务费的份额

58、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

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

60、不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

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

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

---

---

## 第四部分 集合计划的基本情况

### 一、集合计划的名称

光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划

### 二、集合计划的类别

债券型集合资产管理计划

### 三、集合计划的运作方式

契约型开放式

1、每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能提出赎回申请。

对于每份集合计划份额，第一个运作期指资产管理合同生效日（对原光大阳光北斗星集合资产管理计划持有人持有的集合计划份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作起始日），至资产管理合同生效日或集合计划份额申购确认日后的第 180 天（即第一个运作期到期日。如该对应日为非工作日，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至资产管理合同生效日或集合计划份额申购确认日后的第 360 天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。以此类推。

2、每个运作期到期日起 5 个工作日内，集合计划份额持有人可提出赎回申请。

每个运作期到期日起 5 个工作日内，集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在每个运作期到期日起 5 个工作日内未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该集合计划份额进入下一个运作期。

### 四、集合计划的投资目标

本集合计划主要投资于债券为主的固定收益类产品，并在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现集合计划资产的长期稳健增值。

## 五、集合计划份额的面值

本集合计划份额的发售面值为人民币 1.00 元。

## 六、集合计划的存续期限

本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。

## 七、集合计划份额类别设置

对于投资者依据本资产管理合同申购的计划份额，本集合计划根据申购规则、销售费用收取方式的不同，将集合计划份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别计划资产中计提销售服务费的份额，称为 A 类份额；不收取申购费，并从本类别计划资产中计提销售服务费的份额，称为 C 类份额。

本集合计划 A 类份额和 C 类份额分别设置代码，并分别计算和公告集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。投资者在申购份额时可自行选择 A 类或 C 类份额类别。

有关集合计划份额类别的具体设置、费率水平等由管理人确定，并在招募说明书、产品资料概要中公告。

在法律法规允许且条件具备的情况下，管理人可受理份额转换的申请。管理人拟受理集合计划份额转换业务的，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换业务。

在不违反法律法规、资产管理合同的约定以及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与托管人就清算交收、核算估值、系统支持等方面协商一致，在履行适当程序后管理人可增加、减少或调整集合计划份额类别设置、对集合计划份额分类办法及规则进行调整并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开集合计划份额持有人大会。

## 第五部分 集合计划的存续

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

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

---

---

## 第六部分 集合计划份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

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

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

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

管理人在开放日办理集合计划份额的申购，在每个运作期的到期日起 5 个工作日内办理集合计划份额的赎回。具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（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，则管理人可根据实际情况决定本集合计划是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准），但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在届时相关公告中载明。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

管理人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。

集合计划份额每个运作期到期日起 5 个工作日内，集合计划份额持有人方可就该集合计划份额提出赎回申请。管理人自本资产管理合同生效之日后的 180 天（如遇非工作日顺延到下一工作日）起开始办理赎回，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》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

管理人不得在资产管理合同约定之外的日期或者时间办理集合计划份额的申购、赎回或者转换。投资人在资产管理合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其集合计划份额申购、赎回价格为下一开放日该类别集合计划份额申购、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，即按照持有集合计划份额登记日期的先后次序进行顺序赎回；

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

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购集合计划份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；集合计划份额登记机构确认集合计划份额时，申购生效。

集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；集合计划份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照本合同有关条款处理。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项



顺延至前述因素消失日的下一个工作日划出。

### 3、申购和赎回申请的确认

管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T 日），在正常情况下，登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

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

### 五、申购和赎回的数量限制

1、管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

2、管理人可以规定投资人每个集合计划交易账户的最低集合计划份额余额，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

3、管理人可以规定单个投资人累计持有的集合计划份额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。

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》的有关规定在规定媒介上公告。

### 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本集合计划 A 类份额和 C 类份额分别设置代码，分别计算和公告集合

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

2、申购份额的计算及余额的处理方式：本集合计划申购份额的计算详见《招募说明书》。本集合计划的申购费率由管理人决定，并在招募说明书及产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类集合计划份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

3、赎回金额的计算及处理方式：本集合计划赎回金额的计算详见《招募说明书》。本集合计划的赎回费率由管理人决定，并在招募说明书及产品资料概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类集合计划份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

4、申购费用由申购相应类别集合计划份额的投资人承担，不列入集合计划财产。

5、赎回费用由赎回集合计划份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。赎回费用归入集合计划财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书的规定，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。其中，对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入集合计划财产。

6、投资者申购本集合计划 A 类份额需缴纳申购费，申购本集合计划 C 类份额不需缴纳申购费用。本集合计划各类计划份额的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由管理人根据资产管理合同的规定确定，并在招募说明书中列示。管理人可以在资产管理合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

7、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。

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

#### 七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致集合计划无法正常运作。
- 2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市或者港股通临时停市，导致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、港股通交易每日额度不足。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

## 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

除资产管理合同约定的每个运作期到期日起 5 个工作日内可办理集合计划份额的赎回外，管理人不接受投资人的赎回申请。

发生下列情形时，管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

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

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

## 九、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该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

(3) 如发生单个开放日内单个集合计划份额持有人申请赎回的集合计划份额超过前一开放日的集合计划总份额的 20% 时，管理人有权先行对该单个集合计划份额持有人超出 20% 以上的部分赎回申请实施延期办理，管理人只接受其集合计划总份额 20% 部分作为当日有效赎回申请，而对该单个集合计划份额持有人 20% 以内（含 20%）的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”条款处理。

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

### 3、巨额赎回的公告

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

### 十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

3、如发生暂停的时间超过 1 日但少于 2 周（含 2 周），暂停结束，和计划重新开放申购或赎回时，管理人应提前 2 日在规定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的各类集合计划份额净值。

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停结束，集合计划重新开放申购或赎回时，管理人应提前 2 日在规定媒介上连续刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的各类集合计划份额净值。

#### 十一、集合计划转换

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

#### 十二、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。

#### 十三、集合计划的转托管

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

#### 十四、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。

#### 十五、集合计划的冻结和解冻与质押

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

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

#### 十六、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。

#### 十七、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回

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

---

---

## 第七部分 资产管理合同当事人及权利义务

### 一、管理人

#### (一) 管理人简况

名称：上海光大证券资产管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

法定代表人：熊国兵

设立日期：2012 年 5 月 9 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会，证监许可[2011]1886 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：021-22169999

#### (二) 管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

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

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

(4) 销售集合计划份额；

(5) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；

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

(7) 在集合计划托管人更换时，提名新的集合计划托管人；

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



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

(10) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；

(11) 在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(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、证券经纪商或其他为集合计划提供服务的外部机构；

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

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

(2) 办理资产管理合同变更申请；

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

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

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

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

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

义务，集合计划托管人违反《资产管理合同》造成集合计划财产损失时，管理人应为集合计划份额持有人利益向集合计划托管人追偿；

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

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

(24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## 二、托管人

### (一) 托管人简况

名称：中国光大银行股份有限公司

住所：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：李晓鹏

成立时间：1992 年 6 月 18 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院、国函[1992]7 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79095 亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字〔2002〕75 号

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

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

(3) 监督管理人对本集合计划的投资运作，如发现管理人有违反《资产管理合同》及国家法律法规行为，对集合计划财产、其他当事人的利益造成重大损

失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护投资者的利益；

(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《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

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

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

(5) 保管由管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

(10) 对集合计划财务会计报告、季度报告、中期报告和年度报告出具意见，说明管理人在各重要方面的运作是否严格按照《资产管理合同》的规定进行；如

果管理人有未执行《资产管理合同》规定的行为，还应当说明托管人是否采取了适当的措施；

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

(12) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；

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

(16) 按照法律法规和《资产管理合同》的规定监督管理人的投资运作；

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

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

(19) 因违反《资产管理合同》导致集合计划财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督管理人按法律法规和《资产管理合同》规定履行自己的义务，管理人因违反《资产管理合同》造成集合计划财产损失时，应为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定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

### 三、集合计划份额持有人

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

同一类别每份集合计划份额具有同等的合法权益。

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《资产管理合同》约定的其他权利。

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

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

## 第八部分 集合计划份额持有人大会

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

本集合计划份额持有人大会未设立日常机构。在本集合计划存续期内，根据本集合计划的运作需要，集合计划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本合同另有约定的除外：

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

（2）更换管理人；

（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、提高销售服务费；

（6）变更集合计划类别；

（7）本集合计划与其他集合计划的合并；

（8）变更集合计划投资目标、范围或策略；

（9）变更集合计划份额持有人大会程序；

（10）管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；

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

（12）对《资产管理合同》当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在法律法规规定和《资产管理合同》约定的范围内且对集合计划份额持

有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由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、调低销售服务费或变更收费方式；
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《资产管理合同》进行修改；
- (4) 对《资产管理合同》的修改对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《资产管理合同》当事人权利义务关系发生重大变化；
- (5) 集合计划推出新业务或服务；
- (6) 增加、减少或调整集合计划份额类别设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整；
- (7) 管理人、登记机构、销售机构调整有关集合计划申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；
- (8) 按照法律法规和《资产管理合同》规定不需召开集合计划份额持有人大会的其他情形。

## 二、会议召集人及召集方式

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

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，在规定媒介公告。集合计划份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次集合计划份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、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委托人持有集合计划份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《资产管理合同》和会议通知的规定，并且持有集合计划份额的凭证与管理人持有的登记资料相符；

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

2、通讯开会。通讯开会系指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资产管理合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或资产管理合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按资产管理合同约定通知托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）到指定地点对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集合计划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委托人持有集合计划份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《资产管理合同》和会议通知的规定，并与集合计划登记机构记录相符；

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《资产管理合同》的重大修改、决定终止《资产管理合同》、更换管理人、更换托管人、与其他集合计划合并、法律法规及《资产管理合同》规定的其他事项以及会议召集人认为

需提交集合计划份额持有人大会讨论的其他事项。

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下,首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人,然后由大会主持人宣读提案,经讨论后进行表决,并形成大会决议。大会主持人为管理人授权出席会议的代表,在管理人授权代表未能主持大会的情况下,由托管人授权其出席会议的代表主持;如果管理人授权代表和托管人授权代表均未能主持大会,则由出席大会的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、委托人姓名(或单位名称)和联系方式等事项。

### (2) 通讯开会

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

## 六、表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议:

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

2、特别决议,特别决议应当经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上(含三分之二)通过方可做出。除本合同另有约定外,

转换集合计划运作方式、更换管理人或者托管人、终止《资产管理合同》、本集合计划与其他集合计划合并以特别决议通过方为有效。

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的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 日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告集合计划份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

管理人、托管人和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、实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

3、通讯开会的直接出具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相关集合计划份额的二分之一（含二分之一）；

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

集合计划份额的持有人参与或授权他人参与集合计划份额持有人大会投票；

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。

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

## 第九部分 管理人、托管人的更换条件和程序

### 一、管理人和托管人职责终止的情形

#### （一）管理人职责终止的情形

有下列情形之一的，管理人职责终止：

- 1、被依法取消管理人资格；
- 2、被集合计划份额持有人大会解任；
- 3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- 4、法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他情形。

#### （二）托管人职责终止的情形

有下列情形之一的，托管人职责终止：

- 1、被依法取消基金托管资格；
- 2、被集合计划份额持有人大会解任；
- 3、依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- 4、法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他情形。

### 二、管理人和托管人的更换程序

#### （一）管理人的更换程序

1、提名：新任管理人由托管人或由单独或合计持有 10% 以上（含 10%）集合计划份额的持有人提名；

2、决议：集合计划份额持有人大会在管理人职责终止后 6 个月内对被提名的管理人形成决议，该决议需经参加大会的集合计划份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效；

3、临时管理人：新任管理人产生之前，由中国证监会指定临时管理人；

4、备案：集合计划份额持有人大会更换管理人的决议须报中国证监会备案；

5、公告：管理人更换后，由托管人在更换管理人的集合计划份额持有人大会决议生效后 2 日内在规定媒介公告；

6、交接：管理人职责终止的，管理人应妥善保管集合计划管理业务资料，及时向临时管理人或新任管理人办理集合计划管理业务的移交手续，临时管理人或新任管理人应及时接收。新任管理人应与托管人核对集合计划资产总值；



7、审计：管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对集合计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在集合计划财产中列支；

8、集合计划名称变更：管理人更换后，如果原任或新任管理人要求，应按其要求替换或删除集合计划名称中与原管理人有关的名称字样。

## （二）托管人的更换程序

1、提名：新任托管人由管理人或由单独或合计持有 10% 以上（含 10%）集合计划份额的持有人提名；

2、决议：集合计划份额持有人大会在托管人职责终止后 6 个月内对被提名的托管人形成决议，该决议需经参加大会的集合计划份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效；

3、临时托管人：新任托管人产生之前，由中国证监会指定临时托管人；

4、备案：集合计划份额持有人大会更换托管人的决议须报中国证监会备案；

5、公告：托管人更换后，由管理人在更换托管人的集合计划份额持有人大会决议生效后 2 日内在规定媒介公告；

6、交接：托管人职责终止的，应当妥善保管集合计划财产和集合计划托管业务资料，及时办理集合计划财产和集合计划托管业务的移交手续，新任托管人或者临时托管人应当及时接收。新任托管人与管理人核对集合计划资产总值；

7、审计：托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对集合计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报中国证监会备案，审计费用在集合计划财产中列支。

## （三）管理人与托管人同时更换的条件和程序。

1、提名：如果管理人和托管人同时更换，由单独或合计持有集合计划总份额 10% 以上（含 10%）的持有人提名新的管理人和托管人；

2、管理人和托管人的更换分别按上述程序进行；

3、公告：新任管理人和新任托管人应在更换管理人和托管人的集合计划份额持有人大会决议生效后 2 日内在规定媒介上联合公告。

三、本部分关于管理人、托管人更换条件和程序的约定，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，可直接对相应内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

## 第十部分 集合计划的托管

托管人和管理人按照《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定订立托管协议。

订立托管协议的目的是明确托管人与管理人之间在集合计划财产的保管、投资运作、净值计算、收益分配、信息披露及相互监督等相关事宜中的权利义务及职责，确保集合计划财产的安全，保护集合计划份额持有人的合法权益。

---

---

## 第十一部分 集合计划份额的登记

### 一、集合计划的份额登记业务

本集合计划的登记业务指本集合计划登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资人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。

### 二、集合计划登记业务办理机构

本集合计划的登记业务由管理人或管理人委托的其他符合条件的机构办理。管理人委托其他机构办理本集合计划登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确管理人和代理机构在投资者集合计划账户管理、集合计划份额登记、清算及集合计划交易确认、发放红利、建立并保管集合计划份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护集合计划份额持有人的合法权益。

### 三、集合计划登记机构的权利

集合计划登记机构享有以下权利：

- 1、取得登记费；
- 2、建立和管理投资者集合计划账户；
- 3、保管集合计划份额持有人开户资料、交易资料、集合计划份额持有人名册等；
- 4、在法律法规允许的范围内，对登记业务的办理时间进行调整，并依照有关规定于开始实施前在规定媒介上公告；
- 5、法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

### 四、集合计划登记机构的义务

集合计划登记机构承担以下义务：

- 1、配备足够的专业人员办理本集合计划份额的登记业务；
- 2、严格按照法律法规和《资产管理合同》规定的条件办理本集合计划份额的登记业务；
- 3、妥善保存登记数据，并将集合计划份额持有人名称、身份信息及集合计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自集合计划账户销

户之日起不低于法律法规规定的最低期限；

4、对集合计划份额持有人的集合计划账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或集合计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他情形除外；

5、按《资产管理合同》及招募说明书规定为投资者办理非交易过户业务、提供其他必要的服务；

6、接受管理人的监督；

7、法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

---

---

## 第十二部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

本集合计划主要投资于债券为主的固定收益类产品，并在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现集合计划资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、二级资本债、公开发行的次级债券、可交换债券、可转换债券（含分离型可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、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；国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准上市或注册的股票）、港股通标的股票、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

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

本集合计划的投资组合比例为：债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于可转换债券的比例不超过集合计划资产的 20%，投资于股票等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划资产的 20%（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国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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

### 三、投资策略

#### 1、资产配置策略

本集合计划采用专业的投资理念和分析方法，以系统化的研究为基础，通过对各类固定收益类资产的合理配置获取稳定收益。同时结合新股申购、权益类资产投资等，在严格控制投资风险、保持资产流动性的前提下，争取获得相对较高的资产组合投资收益水平。

#### （1）战略资产配置策略

本集合计划根据大类资产在不同市场环境下表现出的相关关系，对各类资产进行相对稳定的战略配置，以此降低组合风险，控制资产净值的波动，追求收益稳定。具体来看，本集合计划对国内外宏观经济形势、宏观经济政策、市场利率走势、信用利差水平、利率期限结构以及证券市场走势等因素进行分析，同时对各类资产在较长时期的收益与风险特征及各类资产收益与风险间的相关关系进行研究，在合同约定范围内设定战略资产配置比例。

#### （2）战术资产配置策略

在战略资产配置策略的框架下，本集合计划在对各类资产在未来 3 至 6 个月的收益率与风险水平进行预测的基础上，对各类资产的配置比例进行优化，在严格控制下行风险的前提下，争取稳定投资收益。

### 2、固定收益类品种投资策略

本集合计划将通过分析宏观经济形势、政策预期和资金供给，并结合债券久期策略和收益率曲线结构的变化趋势来构建债券投资组合，把握利率债行情。在此基础上，积极采用信用策略，发掘市场上价值被低估的高收益信用债，获取较好的信用收益，力争达到产品债券组合安全性与收益性的统一。

#### （1）利率预测

本集合计划通过对影响债券投资的宏观经济形势进行分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，作为管理人调整利率久期，构建债券组合的基础。本集合计划主要关注的宏观经济因素有 GDP、通货膨胀、固定资产投资、对外贸易情况、全球经济形势等。通过对宏观经济形势的深度分析，形成对利率的科学预测，实现对债券投资组合久期的正确把握。

#### （2）收益曲线策略

本集合计划将根据信用债券市场的收益率水平，在综合考虑信用等级、期限、流动性、息票率、提前偿还和赎回等因素的基础上，建立收益率曲线预测模型和

信用利差曲线预测模型，通过模型进行估值，重点选择较高到期收益率、预期信用质量将改善以及价值尚未被市场充分发现的个券。

### （3）跨市场套利策略

鉴于同一债券品种在银行间市场和交易所市场、同期限同信用评级品种在一、二级市场由于市场交易方式、投资者结构或市场流动性的不同而可能出现收益率的差异，本集合计划将依据内部固定收益模型，推理套利充分可行的基础上，寻找合适交易时点，进行跨市场套利。

### （4）债券正回购套作策略

管理人根据需要合理选择银行间市场和交易所市场的债券质押式回购品种，保持组合的收益率稳定大于融资成本，在套利的基础上套作，追求稳定放大的收益；同时，严格控制参与正回购的放大倍数，防止出现欠资风险。

### （5）可转换债券策略

可转换债券是债券加期权的合体，兼具债券、股票、期权属性。一方面，可转换债券的基础属性还是信用债，有固定的利息，具有一定护本特性，持有人受到债券价值的支撑；另一方面，可转换债券可以转换为正股股票，可转债与正股涨跌同步，且可转换债券附加回售权、赎回权、转股价修正权等权利。

### （6）信用债投资策略

本集合计划将综合运用全方位信用研究方法识别信用风险，防止信用事件发生对集合计划资产造成损失，并通过信用分析发现市场中存在的定价偏离，发掘信用债券的潜在投资机会。并根据宏观周期、行业周期、信用周期的判断动态调整持仓结构，分散化投资，在满足流动性要求和控制风险的基础上，获得长期稳健的投资收益。

本集合计划依靠内部信用评级体系跟踪研究各行业最新变化、发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行综合评估，以此作为个券选择的基本依据。为准确评估发债主体的信用风险，管理人采用对企业基本面的定性和定量分析，同时考虑债券的增信措施等情况的方法，综合评估债券的违约风险，对其进行分类以辅助投资。分析框架包含：1）外部宏观环境分析；2）公司所属行业景气度的定性分析；3）公司行业地位及治理结构分析；4）企业性质和股东背景分析；5）公司经营业务和盈利能力分析；6）财务分析；7）公司外部授信和



或有事项分析；8）债券的增信措施和特殊条款分析；9）债券流动性分析；10）舆情分析；11）其他特殊情况分析。

本集合计划投资于信用债主体评级或债项评级或担保人评级 AA（含）级以上，且应当遵守下列要求：

1）本集合计划投资于 AAA 信用评级的信用债的比例占集合计划信用债资产总值比例为 50%-100%；

2）本集合计划投资于 AA+信用评级的信用债的比例合计不超过集合计划信用债资产总值的 50%；

3）本集合计划投资于 AA 信用评级的信用债的比例不超过集合计划信用债资产总值的 20%；

信用评级参照评级机构（中债资信除外）评定的最新债项评级，无债项评级的参照主体评级，短期融资券参照主体评级。

### 3、权益类品种的投资策略

#### （1）新股申购策略

本集合计划通过对新股的分析，参考同类公司的估值水平，判断一、二级市场价差的大小，并根据过往新股的中签率及上市后股价涨幅的统计，对新股投资的收益率进行预测，同时综合考虑锁定期间的投资风险以及资金成本，制定新股申购策略。

#### （2）股票二级市场的投资策略

本集合计划采取自上而下的行业配置与自下而上的个股选择相结合的股票二级市场投资策略。在行业配置方面，除通过对包括产业政策、行业成长性、市场竞争、行业估值等方面进行深入研究以外，根据公司盈利的持续性、稳定性、增长性以及资本回报率调整和修正折溢价，寻找合适的个股。

### 4、资产支持证券投资策略

本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

### 5、国债期货投资策略

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

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本集合计划债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%,其中投资于可转换债券的比例不超过集合计划资产的 20%,投资于股票等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划资产的 20% (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国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本集合计划保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;

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

(4) 管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家公司发行的证券 (同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算),不超过该证券的 10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制;

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

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

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

(8) 本管理人管理的全部公开募集性质的集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

(9) 本集合计划应投资于信用级别评级为 BBB 以上 (含 BBB) 的资产支持证券。本集合计划持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投

资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(10) 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，债券回购到期后不得展期；

(12) 本管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(13) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合计划资产净值的 15%；因证券/期货市场波动、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；

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

(15) 本集合计划投资于国债期货的投资限制如下：

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

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

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

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

(16) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述 (2)、(9)、(13)、(14) 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。

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

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

## 2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，则管理人在履行适当程序后，本集合计划不受上述规定的限制。

#### 五、业绩比较基准

本集合计划的业绩比较基准为： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 5\% + \text{中债综合指数收益率} \times 90\% + \text{中证港股通综合指数(人民币)收益率} \times 5\%$

选择该业绩比较基准，是基于以下因素：

(1) 沪深 300 指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，并且不易被操纵；其编制和发布有一定的历史，有较高的知名度和市场影响力；

(2) 中债综合指数是中央国债登记结算有限责任公司编制的反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数。该指数的样本主要包括国债、政策性银行债券、商业银行债券、中期票据、短期融资券、企业债、公司债等；

(3) 中证港股通综合指数选取符合港股通资格的普通股作为样本股，以反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势。

基于本集合计划的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够真实、客观地反映本集合计划的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本集合计划的业绩基准的指数时，管理人可以根据本集合计划的投资范围和投资策略则管理人可与托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，调整或变更本集合计划的业绩比较基准并及时公告，无需召开集合计划份额持有人大会。

#### 六、风险收益特征

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

本集合计划可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港证券市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本集合计划还面临汇率风险、投资于香港证券市场的风险、以及通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资的风险等特有风险。

## 七、管理人代表集合计划行使股东或债权人权利的处理原则及方法

1、管理人按照国家有关规定代表集合计划独立行使股东或债权人权利，保护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、授权代表或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

## 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

---

---

## 第十三部分 集合计划的财产

### 一、集合计划资产总值

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

### 二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

### 三、集合计划财产的账户

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

### 四、集合计划财产的保管和处分

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

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

---

---

## 第十四部分 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、资产支持证券、国债期货合约和银行存款本息、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固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种对应的估值净价估值；

(3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价；

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

##### 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和债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(3) 对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计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整，确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则采用估值技术确定公允价值；

(4) 流通受限的股票，包括非公开发行股票、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、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、持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

8、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。

9、估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与港币的中间价。

10、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。

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

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

按照管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

1、某一类别集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，某类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

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本合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将集合计划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。

本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。

对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行：

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他错误等，因不可抗力原因出现估值错误的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该估值错误取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

### 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。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

1、集合计划投资所涉及的证券/期货交易遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4、法律法规、中国证监会和资产管理合同认定的其它情形。

## 八、集合计划净值的确认

集合计划资产净值和集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的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，由管理人对集合计划净值予以公布。

## 九、特殊情形的处理

1、管理人或托管人按估值方法的第 10 项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。

2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、证券/期货经纪机构及登记结算公司、存款银行发送的数据错误等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

## 十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

---

---

## 第十五部分 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、销售服务费；
- 4、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 5、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费和诉讼费和仲裁费等；
- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券、期货交易费用；
- 8、集合计划的银行汇划费用；
- 9、集合计划的开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.3% 的年费率计提，计算方法如下：

$$G = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划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、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

#### 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 0.1% 的年费率计提，计

算方法如下：

$$T = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

T 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划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托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。

本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.3%，C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额的集合计划资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划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。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

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

### 三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

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

2、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；

3、《资产管理合同》生效前的相关费用，根据《光大阳光北斗星集合资产管理计划资产管理合同》的约定执行；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目。

#### 四、实施侧袋机制期间的集合计划费用

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

#### 五、集合计划税收

本集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。集合计划财产投资的相关税收，由集合计划份额持有人承担，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。



---

---

## 第十六部分 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，本集合计划可进行收益分配；
- 2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；以红利再投资方式取得的集合计划份额的持有到期时间与投资者原持有的集合计划份额最短持有期到期时间一致，因多笔认购、申购导致原持有基金份额最短持有期不一致的，分别计算。
- 3、集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、由于本集合计划 A 类份额、C 类份额的销售费用收取方式存在不同，各集合计划份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，并由托管人复核，在 2 日内在规

定媒介公告。

#### 六、集合计划收益分配中发生的费用

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

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

## 第十七部分 集合计划份额的折算

### 一、集合计划份额折算基准日

在资产管理合同生效日或管理人决定的其他日期，管理人可根据市场情况确定折算基准日。

### 二、集合计划份额折算对象

份额折算基准日登记在册的本集合计划份额。

### 三、份额折算频率

不定期。

### 四、集合计划份额折算方式

管理人对本集合计划份额的折算方式，具体见管理人届时发布的相关公告。

### 五、集合计划份额折算期间的集合计划业务办理

为保证集合计划份额折算期间本集合计划的平稳运作，管理人可暂停本集合计划份额的申购或赎回等相关业务，具体见管理人届时发布的相关公告。

### 六、份额折算的公告

管理人应按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告，并报中国证监会备案。

## 第十八部分 集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

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

## 第十九部分 集合计划的信息披露

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

### 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法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。

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

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

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

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

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

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的集合计划信息

公开披露的集合计划信息包括：

（一）集合计划招募说明书、《资产管理合同》、集合计划托管协议、产品资料概要

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

2、集合计划招募说明书应当最大限度地披露影响集合计划投资者决策的全部事项，说明集合计划申购和赎回安排、集合计划投资、集合计划产品特性、风险揭示、信息披露及集合计划份额持有人服务等内容。《资产管理合同》生效后，集合计划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，更新集合计划招募说明书并登载在规定网站上；集合计划招募说明书其他信息发生变更的，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招募说明书。

3、集合计划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、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。《资产管理合同》生效后，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，更新产品资料概要，并登载在规定网站及集合计划销售机构网站或营业网点；产品资料概要其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新产品资料概要。

经中国证监会批准后，管理人将集合计划招募说明书提示性公告和《资产管理合同》提示性公告登载在规定报刊上，将集合计划招募说明书、产品资料概要、《资产管理合同》和集合计划托管协议登载在规定网站上；托管人应当同时将《资产管理合同》、集合计划托管协议登载在网站上。

（二）《资产管理合同》生效公告

管理人应当在规定媒介上登载《资产管理合同》生效公告。

（三）集合计划净值信息

《资产管理合同》生效后，在开始办理集合计划份额申购或者赎回前，管理

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

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

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

#### （四）集合计划份额申购、赎回价格

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

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

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

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

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

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

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

#### （六）临时报告

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

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

- 1、集合计划份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《资产管理合同》终止、集合计划清算；
- 3、转换集合计划运作方式、集合计划合并；
- 4、更换管理人、托管人、集合计划份额登记机构，集合计划改聘会计师事务所；
- 5、管理人委托服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；
- 6、管理人、托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、管理人变更持有百分之五以上股权的股东、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、集合计划管理业务、集合计划托管业务的诉讼或仲裁；
- 11、管理人或其高级管理人员、投资经理因集合计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，托管人或其专门托管部门负责人因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、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 15、任一类集合计划份额净值计价错误达该类集合计划份额净值百分之零点



五；

- 16、本集合计划开始办理申购、赎回；
- 17、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；
- 18、本集合计划连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 19、本集合计划暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 20、发生涉及集合计划申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 21、管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 22、本集合计划实施集合计划份额折算；
- 23、集合计划信息披露义务人认为可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和资产管理合同约定的其他事项。

#### （七）澄清公告

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

#### （八）集合计划份额持有人大会决议

集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （九）投资资产支持证券的信息披露

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

#### （十）投资港股通标的股票信息披露

若本集合计划投资港股通标的股票，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投资港股通标

的股票的相关情况。

（十一）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。

（十二）实施侧袋机制期间的信息披露

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

（十三）中国证监会规定的其他信息。

## 六、信息披露事务管理

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《资产管理合同》的约定,对管理人编制的集合计划资产净值、各类集合计划份额净值、集合计划份额申购赎回价格、集合计划定期报告、更新的招募说明书、产品资料概要、集合计划清算报告等相关集合计划信息进行复核、审查,并向管理人进行书面或电子确认。

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

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

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

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

#### 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，管理人和托管人可暂停或延迟披露集合计划相关信息：

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

## 第二十部分 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算

### 一、《资产管理合同》的变更

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

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

### 二、《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

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

### 三、集合计划财产的清算

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

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

(2)对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、集合计划财产清算的公告

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

#### 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

---

---

## 第二十一部分 违约责任

一、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《资产管理合同》约定，给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。

二、由于合同当事人违反资产管理合同，给其他合同当事人造成损失的，应当承担赔偿责任。当发生下列情况时，当事人免责：

1、管理人及托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

2、管理人由于按照《资产管理合同》规定的投资原则投资或不投资造成的直接损失或潜在损失等；

3、不可抗力。

三、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护集合计划份额持有人利益的前提下，《资产管理合同》能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

四、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成集合计划财产或投资人损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

## 第二十二部分 争议的处理和适用的法律

因履行本合同发生的争议，由当事人协商解决，协商不成的，提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照该会届时有效的仲裁规则仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局性的，对各方均有约束力。争议处理期间，相关各方当事人应恪守职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

《资产管理合同》受中国法律管辖。

## 第二十三部分 合同的效力

《资产管理合同》是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

1、《资产管理合同》经管理人、托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章，经管理人向中国证监会提交变更《光大阳光北斗星集合资产管理计划资产管理合同》的申请并获得中国证监会批准后，自集合计划管理人公告的生效之日起生效，原《光大阳光北斗星集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

2、《资产管理合同》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。

3、《资产管理合同》自生效之日起对包括管理人、托管人和集合计划份额持有人在内的《资产管理合同》各方当事人具有同等的法律约束力。

4、《资产管理合同》正本一式二份，管理人、托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

5、《资产管理合同》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。



## 第二十四部分 其他事项

《资产管理合同》如有未尽事宜，由《资产管理合同》当事人各方按有关法律法规协商解决。

---

---

## 第二十五部分 资产管理合同内容摘要

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

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

(4) 销售集合计划份额；

(5) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；

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

(7) 在集合计划托管人更换时，提名新的集合计划托管人；

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

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

(10) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；

(11) 在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(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、证券经纪商或其他为集合计划提供服务的外部机构；

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

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

(2) 办理资产管理合同变更申请；

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

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

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

(6) 除依据《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定外，不得利用

集合计划财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作集合计划财产；

(7) 依法接受集合计划托管人的监督；

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

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

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

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

(3) 监督管理人对本集合计划的投资运作，如发现管理人有违反《资产管

理合同》及国家法律法规行为，对集合计划财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护投资者的利益；

(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《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

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

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

(5) 保管由管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；

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

(16) 按照法律法规和《资产管理合同》的规定监督管理人的投资运作；

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

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

(19) 因违反《资产管理合同》导致集合计划财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(20) 按规定监督管理人按法律法规和《资产管理合同》规定履行自己的义务，管理人因违反《资产管理合同》造成集合计划财产损失时，应为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定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

(三) 集合计划份额持有人的权利与义务

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

同一类别每份集合计划份额具有同等的合法权益。

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《资产管理合同》约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守《资产管理合同》、招募说明书等信息披露文件；

(2) 了解所投资集合计划产品，了解自身风险承受能力，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(3) 关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳集合计划申购款项及法律法规和《资产管理合同》所规定的费用；

(5) 在其持有的集合计划份额范围内，承担集合计划亏损或者《资产管理合同》终止的有限责任；

(6) 不从事任何有损集合计划及其他《资产管理合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决定；

(8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## 二、集合计划份额持有人大会召集、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未设立日常机构。在本集合计划存续期内，根据本集合计划的运作需要，集合计划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本合同另有约定的除外：

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

(2) 更换管理人；

(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、提高销售服务费；

(6) 变更集合计划类别；

(7) 本集合计划与其他集合计划的合并；

(8) 变更集合计划投资目标、范围或策略；

(9) 变更集合计划份额持有人大会程序；

(10) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；

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

(12) 对《资产管理合同》当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

2、在法律法规规定和《资产管理合同》约定的范围内且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由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、调低销售服务费或变更收费方式;

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《资产管理合同》进行修改;

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

(5) 集合计划推出新业务或服务;

(6) 增加、减少或调整集合计划份额类别设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整;

(7) 管理人、登记机构、销售机构调整有关集合计划申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则;

(8) 按照法律法规和《资产管理合同》规定不需召开集合计划份额持有人大会的其他情形。

## (二) 会议召集人及召集方式

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

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，在规定媒介公告。集合计划份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

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

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次集合计划份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关

及其联系方式和联系人、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委托人持有集合计划份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《资产管理合同》和会议通知的规定，并且持有集合计划份额的凭证与管理人持有的登记资料相符；

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

2、通讯开会。通讯开会系指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资产管理合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定

的地址或系统。通讯开会应以书面方式或资产管理合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

(2) 召集人按资产管理合同约定通知托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）到指定地点对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集合计划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委托人持有集合计划份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《资产管理合同》和会议通知的规定，并与集合计划登记机构记录相符；

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《资产管理合同》的重大修改、决定终止《资产管理合同》、更换管理人、更换托管人、与其他集合计划合并、法律法规及《资产管理合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交集合计划份额持有人大会讨论的其他事项。

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为管理人授权出席会议的代表，在管理人授权代表未能主持大会的情况下，由托管人授权其出席会议的代表主持；如果管理人授权代表和托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的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、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的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日内在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告集合计划份额持有人大会决议时，必须将公证

书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

管理人、托管人和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) 实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

3、通讯开会的直接出具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相关集合计划份额的二分之一(含二分之一);

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。

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

### 三、集合计划收益分配原则、执行方式

#### (一) 集合计划利润的构成

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

#### (二) 集合计划可供分配利润

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

#### (三) 集合计划收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；以红利再投资方式取得的集合计划份额的持有到期时间与投资者原持有的集合计划份额最短持有期到期时间一致，因多笔认购、申购导致原持有基金份额最短持有期不一致的，分别计算。

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

4、由于本集合计划 A 类份额、C 类份额的销售费用收取方式存在不同，各集合计划份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别的

每一集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案

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

#### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

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

#### （六）集合计划收益分配中发生的费用

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

#### （七）实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。

### 四、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### （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、销售服务费；
- 4、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 5、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费和诉讼费和仲裁费等；

- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券、期货交易费用；
- 8、集合计划的银行汇划费用；
- 9、集合计划的开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

## （二）集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.3% 的年费率计提，计算方法如下：

$$G = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划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、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### 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0.1%的年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

T 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划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托管人。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。

本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.3%，C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额的集合计划资产净值的 0.3% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经集合计划管理人与集合计划托管人核对一致后，由集合计划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。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

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

### （三）不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

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

2、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；

3、《资产管理合同》生效前的相关费用，根据《光大阳光北斗星集合资产管理计划资产管理合同》的约定执行；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用

的项目。

#### （四）实施侧袋机制期间的集合计划费用

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

#### （五）集合计划税收

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

### 五、集合计划财产的投资方向和投资限制

#### （一）投资目标

本集合计划主要投资于债券为主的固定收益类产品，并在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现集合计划资产的长期稳健增值。

#### （二）投资范围

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、二级资本债、公开发行的次级债券、可交换债券、可转换债券（含分离型可转换债券）及其他经中国证监会允许投资的债券）、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；国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会核准上市或注册的股票）、港股通标的股票、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。

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

本集合计划的投资组合比例为：债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于可转换债券的比例不超过集合计划资产的 20%，投资于股票等权益

类资产的投资比例合计不超过集合计划资产的 20%（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国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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

### （三）投资限制

#### 1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

（1）本集合计划债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于可转换债券的比例不超过集合计划资产的 20%，投资于股票等权益类资产的投资比例合计不超过集合计划资产的 20%（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国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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

（4）管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

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

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

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



(8) 本管理人管理的全部公开募集性质的集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

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

(10) 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，债券回购到期后不得展期；

(12) 本管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(13) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合计划资产净值的 15%；因证券/期货市场波动、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；

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

(15) 本集合计划投资于国债期货的投资限制如下：

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

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

3) 本集合计划所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和

买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于债券投资比例的有关约定；

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

(16) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述（2）、（9）、（13）、（14）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。

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

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

## 2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

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

如法律、行政法规或监管部门取消上述禁止性规定，则管理人在履行适当程序后，本集合计划不受上述规定的限制。

#### （四）侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

### 六、集合计划资产净值的计算方法和公告方式

#### （一）集合计划资产总值

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）集合计划净值信息的公告方式

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

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

各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

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

#### （四）实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

### 七、资产管理合同的终止事由、程序与集合计划资产的清算

#### （一）《资产管理合同》的变更

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

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

#### （二）《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

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

#### （三）集合计划财产的清算

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

监督下进行集合计划清算。

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

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

4、集合计划财产清算程序：

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

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

(四) 清算费用

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

(五) 集合计划财产清算剩余资产的分配

依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资

产扣除集合计划财产清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。

#### （六）集合计划财产清算的公告

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

#### （七）集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

### 八、争议解决方式

因履行本合同发生的争议，由当事人协商解决，协商不成的，提交中国国际经济贸易仲裁委员会上海分会，按照该会届时有效的仲裁规则仲裁，仲裁地点为上海。仲裁裁决是终局性的，对各方均有约束力。争议处理期间，相关各方当事人应恪守职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

《资产管理合同》受中国法律管辖。

### 九、资产管理合同的存放地及投资者取得方式

1、《资产管理合同》正本一式二份，管理人、托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。

2、《资产管理合同》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。

（本页无正文，为《光大阳光北斗星 180 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》签署页）

管理人（盖章）：上海光大证券资产管理有限公司（公章/合同专用章）

法定代表人（或授权代表）签字或盖章：

签订地点：上海

签署日期：2021 年 月 日

托管人（合同专用章）：中国光大银行股份有限公司

法定代表人（或授权代表）签字或盖章：

签订地点：

签署日期：2021 年 月 日