

申万宏源证券有限公司

申万宏源红利成长灵活配置混合型  
集合资产管理计划  
更新的招募说明书

集合计划管理人：申万宏源证券有限公司

集合计划托管人：中国建设银行股份有限公司

时间：二〇二二年一月

## 重要提示

申万宏源红利成长灵活配置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”）由宏源证券宏源 3 号红利成长集合资产管理计划变更而来，宏源证券宏源 3 号红利成长集合资产管理计划由管理人依照《证券公司客户资产管理业务试行办法》（证监会令第 17 号）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（证监会公告[2008]26 号）、《宏源证券宏源 3 号红利成长集合资产管理计划集合资产管理合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准设立。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，宏源证券宏源 3 号红利成长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 2020 年 8 月 31 日《关于准予宏源证券宏源 3 号红利成长集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函【2020】2384 号）批准，自 2021 年 1 月 19 日起，《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《宏源证券宏源 3 号红利成长资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会批准，但中国证监会对宏源证券宏源 3 号红利成长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和集合计划合同等信息披露文件，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。股指期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

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

本集合计划可投资科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、科创板上市公司退市风险（科创板执行比 A 股其他板块更为严格的退市标准）和投资集中风险等。本集合计划可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分本集合计划资产投资于科创板股票或选择不将本集合计划资产投资于科创板股票，本集合计划资产并非必然投资科创板股票。本集合计划的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本集合计划的过往业绩并不预示其未来表现，管理人管理的其他产品的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。管理人提醒投资者投资的“买者自负”

---

---

原则，在投资者作出投资决策后，集合计划运营状况与集合计划净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。本次更新的招募说明书主要对集合计划管理人、相关服务机构、财务数据、净值表现等信息进行修订，更新内容截止日为 2022 年 1 月 10 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2021 年 9 月 30 日（本报告中财务数据未经审计）。

---

---

## 目 录

第一部分 绪言.....	1
第二部分 释义.....	2
第三部分 集合计划管理人.....	7
第四部分 集合计划托管人.....	25
第五部分 相关服务机构.....	28
第六部分 集合计划的历史沿革.....	32
第七部分 集合计划的存续.....	33
第八部分 集合计划份额的申购与赎回.....	34
第九部分 集合计划的投资.....	45
第十部分 集合计划的业绩.....	58
第十一部分 集合计划的财产.....	60
第十二部分 集合计划资产估值.....	62
第十三部分 集合计划的收益与分配.....	68
第十四部分 集合计划费用与税收.....	70
第十五部分 集合计划的会计与审计.....	73
第十六部分 集合计划的信息披露.....	74
第十七部分 风险揭示.....	81
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.....	89
第十九部分 集合计划合同的内容摘要.....	91
第二十部分 集合计划托管协议的内容摘要.....	107
第二十一部分 对集合计划份额持有人的服务.....	126
第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	127
第二十三部分 备查文件.....	128

---

---

## 第一部分 绪言

《申万宏源红利成长灵活配置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《申万宏源红利成长灵活配置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申万宏源红利成长灵活配置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、集合计划或本集合计划：指申万宏源证券有限公司设立管理的投资者人数不受200人限制的申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划

2、集合计划管理人或管理人：指申万宏源证券有限公司

3、集合计划托管人或托管人：指中国建设银行股份有限公司

4、集合计划合同：指《申万宏源红利成长灵活配置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

5、托管协议：指集合计划管理人与集合计划托管人就本集合计划签订之《申万宏源红利成长灵活配置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

6、招募说明书或本招募说明书：指《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

7、产品资料概要：指《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新

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

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

10、《销售办法》：指中国证监会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

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

开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于集合资产管理计划或证券投资基金的自然人

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

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

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

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

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

23、集合计划销售业务：指集合计划管理人或销售机构宣传推介集合计划，



办理集合计划份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

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

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

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

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

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

29、集合计划合同生效日：指《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同资产管理合同》的生效日，原《宏源证券宏源3号红利成长集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效，具体生效日期以集合计划管理人公告为准

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

31、存续期：指集合计划合同生效至终止之间的不定期期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、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

34、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

35、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

36、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

37、《业务规则》：指中国证券登记结算有限责任公司发布并不时修订的适用于集合计划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

38、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

39、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

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

41、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。

42、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

43、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%

44、元：指人民币元

45、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

46、收益分配基准日：即期末可供分配利润计算截止日

47、权益登记日：指享有收益分配权益的计划份额的登记日期。只有在收益分配权益登记日（不包括本登记日）前购入的计划份额，并在权益登记日当天登记在册的份额才有资格参加收益分配，具体以管理人公告为准

48、除息日：指收益分配方案中确定的将红利从集合计划资产中扣除的日期。

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、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、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

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

56、不可抗力：指集合计划合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

### 第三部分 集合计划管理人

#### 一、管理人概况

名称：申万宏源证券有限公司

住所：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：杨玉成

成立日期：2015 年 1 月 16 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监许可[2015]95 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：53,500,000,000 元

存续期限：持续经营

联系人：唐玮

联系电话：010-88085035

股权结构：申万宏源集团股份有限公司持有 100% 的股份

申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源”或“公司”），是由新中国第一家股份制证券公司——申银万国证券股份有限公司与国内资本市场第一家上市证券公司——宏源证券股份有限公司，于 2015 年 1 月 16 日合并组建而成。公司注册资本 535 亿元，拥有员工近 10000 名，是国家主权财富基金——中国投资有限责任公司的直管企业。公司营业网点遍布全国，实现了 32 个省市自治区全覆盖，共设有 41 家证券分公司和 2 家期货分公司、308 家证券营业部和 21 个期货营业网点，在香港设有子公司，并设有伦敦、东京、新加坡、首尔等海外分支机构。

申万宏源证券有限公司目前拥有全面的证券类业务资格，主要包括：许可项目：证券业务；证券投资咨询；证券投资基金销售服务；证券投资基金托管。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动，具体经营项目以相关部门批准文件或许可证件为准）一般项目：证券公司为期货公司提供中间介绍业务。（除依法须经批准的项目外，凭营业执照依法自主开展经营活动）。

公司是申万宏源集团股份有限公司的全资子公司，公司将在中投公司、中央

汇金公司等集团公司股东单位的大力支持下，契合国家发展战略重点布局上海、新疆、香港、新加坡等区域，通过转型创新不断做大做强，朝着“具有国际竞争力、品牌影响力和系统重要性的现代投资银行”的目标加快迈进，为中国资本市场的创新发展作出积极贡献。

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员

#### 储晓明：董事长

男，硕士，生于 1962 年，历任中国工商银行商业信贷部科员、副主任科员；中国工商银行技改信贷部项目评估处负责人；技改信贷部调查评估处副处长；中国工商银行固定资产信贷部调查评估处处长；中国工商银行评估咨询部基础设施评估处处长；银通投资咨询公司总经理；中国工商银行资产风险管理部副总经理级调研员；中海石油财务有限责任公司副总经理；中海信托投资有限责任公司常务副总经理、党委书记、总经理；中国海洋石油东海公司党委书记；中海基金管理有限公司董事长；申银万国证券股份有限公司党委书记、副董事长、总经理。现任申万宏源集团股份有限公司和申万宏源证券有限公司党委书记，申万宏源集团股份有限公司董事长，申万宏源证券有限公司董事长。

#### 杨玉成：董事

男，硕士，生于 1971 年，历任北京内燃机集团总公司计算机与自动控制技术员；财政部清产核资办公室、国家国有资产管理局主任科员；国务院稽察特派员总署稽察特派员助理，中共中央企业工作委员会、国务院国有重点大型企业监事会专职监事；中国网络通信有限公司综合部总监兼公司工会副主席；中国投资担保有限公司办公室主任、行政总裁助理兼公司管理委员会、薪酬委员会、专家委员会、审计委员会委员（期间曾借调在中央纪委监察部工作）；宏源证券股份有限公司党委委员、纪委书记、副总经理、监事长；申万宏源集团股份有限公司和申万宏源证券有限公司党委委员、申万宏源集团股份有限公司监事会主席。现任申万宏源集团股份有限公司和申万宏源证券有限公司党委副书记、申万宏源证券有限公司董事、总经理、执行委员会主任，中证机构间报价系统股份有限公司第二届董事会董事。

#### 葛蓉蓉：董事

女，博士，生于 1968 年，历任北京工业大学经管学院讲师，大鹏证券公司（北京）研究部副研究员，中国证监会发行监管部主任科员，中央汇金投资有限责任公司建行股权管理部高级经理、副主任，银行机构管理一部建行股权管理处副主任、主任，中央汇金投资有限责任公司监事会职工监事，银行机构管理一部研究支持处主任，中央汇金投资有限责任公司派往工商银行董事，银行机构管理一部副主任、董事总经理。现任申万宏源集团股份有限公司董事，申万宏源证券有限公司董事，中央汇金投资有限责任公司股权管理二部。

**任晓涛：董事**

男，硕士，生于 1971 年，历任上海建平中学高中数学教师，中国太平洋保险（集团）股份有限公司财务部精算分析员、精算经理、精算部精算高级经理，中央汇金投资有限责任公司非银行部高级副经理，证券机构管理部/保险机构管理部高级副经理、高级经理，证券机构管理部/保险机构管理部保险机构股权管理二处处主任、处长（其间挂职中国大地财产保险股份有限公司发展企划部副总经理，资产管理部副总经理兼上海自贸区分公司副总经理）。现任申万宏源集团股份有限公司董事、申万宏源证券有限公司董事、中央汇金投资有限责任公司股权管理二部。

**叶振勇：董事**

男，博士，高级经济师，生于 1967 年，历任中国人民银行人事司、办公厅、国际司、银行监管一司干部；中国人民银行驻美洲代表处代表；中国银行业监督管理委员会银行监管三部处长、副主任；中国光大（集团）总公司外事办公室主任，兼办公厅副主任、党委办公室副主任，办公厅主任、党委办公室主任。现任申万宏源证券有限公司董事，中国光大集团股份公司集团高管、董事会秘书、集团执委会成员。

**陆正飞：独立董事**

男，博士，生于 1963 年，历任南京大学商学院会计系助教、讲师、副教授、教授、副系主任、系主任；北京大学光华管理学院会计系副系主任、系主任、副院长、院党委书记。现任申万宏源证券有限公司独立董事，北京大学光华管理学院会计系教授、博士生导师。其间：2001 年入选“北京市新世纪社科理论人才百人工程”，2005 年入选中国教育部“新世纪优秀人才支持计划”，2013 年入选

财政部“会计名家培养工程”(首批), 2014 年被评为中国教育部长江学者特聘教授。目前兼任中国会计学会常务理事及财务管理专业委员会副主任,《会计研究》和《审计研究》编委;兼任中国生物制药有限公司独立董事、中国人民财产保险股份有限公司独立监事、浙江泰隆商业银行股份有限公司独立董事、中国信达资产管理股份有限公司独立董事和招银国际金融有限公司独立董事。

孔宁宁: 独立董事

女, 博士, 生于 1973 年, 历任中国金融学院会计系讲师, 对外经济贸易大学商学院会计系讲师、副教授, 其间分别在荷兰尼津洛德大学、美国西东大学和美国密歇根州立大学任访问学者。现任申万宏源证券有限公司独立董事, 对外经济贸易大学商学院会计系教授、博士研究生导师, 中国注册会计师。

蒋大兴: 独立董事

男, 博士, 生于 1971 年, 历任南京大学法学院助教、讲师、副教授、教授、副院长; 北京大学法学院特聘研究员。现任申万宏源证券有限公司独立董事, 北京大学法学院教授、博士生导师; 兼任中国证券法学研究会副会长、中国商法学研究会常务理事、北京仲裁委员会仲裁员、深圳莱宝高科技股份有限公司独立董事。

## 2、监事会成员

方荣义: 监事会主席

男, 博士, 生于 1966 年, 历任北京用友电子财务技术有限公司研究所信息中心副主任, 厦门大学工商管理中心副教授, 中国人民银行深圳市中心支行会计处副处长, 中国人民银行深圳市中心支行非银行金融机构监管处处长, 中国银行业监督管理委员会深圳监管局财务会计处处长, 中国银行业监督管理委员会深圳监管局国有银行监管处处长, 申银万国证券股份有限公司财务总监, 申万宏源证券有限公司副总经理执行委员会成员兼财务总监、董事会秘书、首席风险官。现任申万宏源集团股份有限公司和申万宏源证券有限公司党委委员、监事会主席, 富国基金管理有限公司副董事长, 证通股份有限公司监事会主席。

陈燕: 监事

女, 硕士, 生于 1975 年, 历任中国人民保险公司北京市分公司职员; 经济日报报业集团《经济月刊》杂志社、报社企业新闻编辑室编辑; 经济日报社专刊

部企业新闻编辑室副主任（副处级）、总编室主任助理、总编室办公室主任（正处级）；中国建设银行北京月坛支行副行长（挂职）；中央汇金公司综合管理部/银行机构管理二部高级经理、政策性金融机构股权管理处处长。现任中央汇金公司综合管理部高级经理、政策研究处处长，申万宏源集团股份有限公司监事、申万宏源证券有限公司监事。

姜杨：监事

男，硕士，生于 1978 年，历任宏源证券新疆管理总部自营交易员、营业部财务负责人、高级投资顾问等；新疆维吾尔自治区金融工作办公室（借调）；新疆金融投资有限公司任办公室主任、职工监事、投资管理部经理、总经理助理、投资总监。现任新疆金融投资有限公司副总经理，新疆小额再贷款股份有限公司总经理，申万宏源证券有限公司监事，申万宏源集团股份有限公司监事，新疆凯迪投资有限责任公司董事、副总经理，新疆凯迪矿业投资股份有限公司董事。

宋孜茵：职工监事

女，硕士，生于 1973 年，历任上海市汽车运输代理公司职员，申银万国证券股份有限公司秘书、公司经理助理级秘书、办公室公关宣传部副经理、团委副书记、团委书记、办公室公关宣传部经理、党委办公室副主任。现任申万宏源证券有限公司工会副主席、职工监事，上海申银万国综合服务有限公司监事。

邱瑜：监事

女，硕士研究生，生于 1969 年，历任上海申银证券公司总裁办法律事务部副经理，申银万国证券股份有限公司办公室秘书部副经理、经理、办公室副主任，申万宏源证券有限公司办公室副主任。现任申万宏源证券有限公司监事会办公室主任、职工监事，申万宏源西部证券有限公司监事。

### 3、总经理及其他高级管理人员

杨玉成：总经理、执行委员会主任

男，硕士，生于 1971 年，历任北京内燃机集团总公司计算机与自动控制技术员；财政部清产核资办公室、国家国有资产管理局主任科员；国务院稽察特派员总署稽察特派员助理，中共中央企业工作委员会、国务院国有重点大型企业监事会专职监事；中国网络通信有限公司综合部总监兼公司工会副主席；中国投资担保有限公司办公室主任、行政总裁助理兼公司管理委员会、薪酬委员会、专家



委员会、审计委员会委员（期间曾借调在中央纪委监察部工作）；宏源证券股份有限公司党委委员、纪委书记、副总经理、监事长；申万宏源集团股份有限公司和申万宏源证券有限公司党委委员、申万宏源集团股份有限公司监事会主席。现任申万宏源集团股份有限公司和申万宏源证券有限公司党委副书记、申万宏源证券有限公司董事、总经理、执行委员会主任，中证机构间报价系统股份有限公司第二届董事会董事，自 2021 年 10 月 27 日起代行申万宏源证券有限公司合规总监职务，代行时间不超过 6 个月。

**朱敏杰：执行委员会成员兼首席风险官**

男，硕士，生于 1966 年，历任上海万国证券静安营业部副经理，上海万国证券公司交易部兼计财部经理，计财部兼交易一部经理，上海万国证券公司总裁助理兼发展研究中心主任、办公室副主任，申银万国证券股份有限公司国债总部总经理、计划统筹总部总经理、发展协调办公室主任、财会管理总部总经理，申银万国证券股份有限公司总经理助理、副总经理、兼上海分公司总经理、资产管理事业部总经理，申万宏源证券有限公司副总经理。现任申万宏源证券有限公司执行委员会成员兼首席风险官。

**张剑：副总经理、执行委员会成员**

男，博士，生于 1977 年，历任中信证券股份有限公司投资银行部项目助理、项目经理、项目主管，投资银行运营部负责人，投资银行并购业务线负责人，申万宏源证券有限公司总经理助理兼申万宏源证券承销保荐有限责任公司总经理。现任申万宏源证券有限公司副总经理、执行委员会成员、申万宏源证券承销保荐有限责任公司董事长、申万宏源（香港）有限公司执行董事、申万宏源（国际）集团有限公司董事。

**李雪峰：执行委员会成员**

男，硕士，生于 1970 年，历任江苏南通柴油机股份有限公司生产处企业管理，申银万国证券研究所有限公司策略部资深高级分析师，渤海证券股份有限公司研究所所长，国都证券股份有限公司研究发展中心总经理、财富管理中心总经理，浙商证券股份有限公司副总裁、董事会秘书、资产管理公司总经理。现任申万宏源证券有限公司执行委员会成员、申万宏源（国际）集团有限公司董事。

**房庆利：执行委员会成员、机构客户总部党总支书记、总经理**

男，硕士，生于 1969 年，历任中信证券股份有限公司研究开发部、万通证券交易部负责人（借调）、研究咨询部、总经理办公室、交易部、信用交易管理部、信用交易管理部行政负责人、金融市场委员会委员（兼）、经纪业务发展与管理委员会财富管理部负责人、中信证券股份有限公司广东分公司负责人（兼），中国国际金融股份有限公司财富服务中心董事总经理，申万宏源证券有限公司高级董事总经理。现任申万宏源证券有限公司执行委员会成员、机构客户总部党总支书记、总经理兼申万宏源（国际）集团有限公司董事长、申万宏源（香港）有限公司董事长。

王苏龙：执行委员会成员、财富管理事业部总经理

男，本科，历任句容对外贸易公司员工，上海万国证券公司南京市证券公司联合业务部员工，申银万国证券江苏管理总部员工、南京华侨路证券营业部江浦服务部负责人、南京山西路证券营业部副经理、南京浦口凤凰大街证券营业部总经理、合肥阜南路证券营业部总经理、南京华侨路证券营业部总经理，申万宏源证券有限公司江苏分公司副总经理兼南京华侨路证券营业部总经理、江苏分公司副总经理（主持工作）、总经理，申万宏源证券有限公司办公室主任等职务。现任申万宏源证券有限公司执行委员会成员、财富管理事业部总经理，申万宏源证券承销保荐有限公司监事。

吴萌：执行委员会成员、国际业务总部总经理

女，博士，历任中国建银投资有限责任公司投资银行部证券公司管理处员工、投资银行部业务副经理，中央汇金投资有限责任公司资本市场处、证券机构管理部/保险机构管理部一级经理、证券机构管理部/保险机构管理部经理、高级副经理，申万宏源证券有限公司董事会办公室主任等，现任申万宏源证券有限公司执行委员会成员、国际业务总部总经理，申万宏源（国际）集团有限公司董事长、总经理兼市场拓展部负责人，申万宏源（香港）有限公司董事长，上海申银万国证券研究所有限公司董事，申万宏源证券承销保荐有限责任公司董事。

汤俊：执行委员会成员、金融创新总部总经理

男，硕士，历任法国巴黎兴业银行企业投资银行助理交易员，法国巴黎银行伦敦分行欧洲股票衍生品业务，中信证券股份有限公司股权衍生品业务线交易经理、执行总经理（ED），申万宏源证券有限公司原投资交易事业部总部总经理

理级干部，金融创新总部（筹）改革整合负责人、证券投资总部总经理等，现任申万宏源证券有限公司执行委员会成员、金融创新总部总经理、申万宏源（国际）集团有限公司董事。

谢晨：首席信息官

男，博士，生于 1976 年，历任中芯国际集成电路制造（上海）有限公司信息技术部工程师、EAP 项目组长，上海期货交易所技术部经理助理，中国期货市场监控中心技术部部长、技术部总监、申万宏源证券有限公司总经理助理、信息技术保障总部总经理（兼）。现任申万宏源证券有限公司首席信息官。

陈秀清：执行委员会成员、财务总监

历任中国农业银行甘肃省信托投资公司上海证券营业部职员、副经理，大连路营业部经理，中国农业银行长城信托投资公司深圳莲花证券营业部交易部经理总助，证券资金清算部副经理，中国银河证券有限责任公司财务资金总部清算中心副经理、经理，客户资产存管中心副总经理，运营部总经理，结算管理部总经理，托管总部总经理。现任申万宏源证券有限公司执行委员会成员、财务总监。

#### 4、本集合计划投资经理

秦庆：工学硕士，曾任职于基金公司、泰康资管权益投资部，从事通信、电子、计算机、传媒等行业研究工作。2013 年 6 月加入原宏源证券北京资管分公司权益投资部，先后历任宏源证券宏源 10 号股债双鑫集合资产管理计划、宏源证券股债双丰集合资产管理计划投资主办人，拥有丰富的投资运营管理经验，不存在其他兼职情况；已取得投资主办人执业证书，证书编号为：S1180814050001，并已取得基金从业资格，证书编号为：F4530000002689，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。

陈旻先生，工商管理硕士，经济师职称，25 年证券从业经验。曾任申银万国证券股份有限公司证券投资总部投资经理、客户资产管理总部定向理财投资部投资经理、“申万 1 号”和“宝鼎一期”投资主办助理、“申万 3 号”投资主办以及“宝鼎优选定增系列”“宝鼎稳盈系列”“宝鼎系列”等产品投资主办，现为本集合计划投资经理。现任申万宏源证券资产管理事业部高级投资经理，拥有丰富的投资运营管理经验，不存在其他兼职情况；已取得投资主办人执业证书，证书编号为：S0900812110010，并已取得基金从业资格，证书编号为：

F4530000002658，且最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的经历。

#### 5、权益投资决策委员会成员

梁福涛，金融学博士，权益投资决策委员会主任，申万宏源资产管理事业部副总经理。具有 18 年金融行业从业经验，其中具有连续 10 年养老金(含保险资金)大规模资金权益投研管理经验。具有完整的卖方研究、买方研究、资管和公募投研管理的经历。曾任职申银万国证券研究所宏观经济研究员、长江养老保险股份有限公司研究部总经理、权益投资部总经理、高级董事总经理兼投资管理事业部总经理、凯石公募基金总经理助理(投研)。2021 年 3 月加入申万宏源证券资产管理事业部，分管资产管理事业部权益投资业务。

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

秦庆，权益投资决策委员会委员、权益公募投资决策小组成员，简历见本部分“一、管理人概况”之“4、投资经理”。

陈旻，权益公募投资决策小组成员，简历见本部分“一、管理人概况”之“4、投资经理”。

许维伦，权益公募投资决策小组成员，美国密歇根大学硕士，理工科复合背景。7 年基金从业经历，其中 5 年行业研究经验，历任申万菱信基金、申万宏源证券资产管理事业部行业研究员。2021 年 8 月加入申万宏源证券资产管理事业部，主要负责行业研究等工作。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

#### 三、管理人的职责

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

2、办理集合计划备案手续；

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

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

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

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

7、依法接受集合计划托管人的监督；

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

9、进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

24、执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

25、建立并保存集合计划份额持有人名册；

26、法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他义务。

#### 四、管理人承诺

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

2、集合计划管理人不得从事下列行为：

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待其管理的不同集合计划财产；

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

(4) 向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用基金财产；

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

- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

### 3、投资经理承诺

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

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

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

- (4) 不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

### 五、管理人的内部控制制度

#### 1、内部控制的原则

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

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

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

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

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

#### 2、内部控制的主要内容

##### (1) 基本要求

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

2) 公司与股东、实际控制人、关联方之间保持资产、财务、人事、业务、

机构等方面的独立性，确保公司独立运作。

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

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

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

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

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

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

## (2) 控制环境

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

董事会审计委员会负责审查公司内部控制，监督内部控制的有效实施和内部控制自我评价情况，协调内部控制审计及其他相关事宜等。

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

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



公司经理层风险管理委员会负责牵头内部控制实施的相关工作。稽核审计部门负责内部控制评价的组织实施工作。

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

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

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

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

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

### (3) 风险评估

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

公司准确识别与实现控制目标相关的内部风险和外部风险,确定相应的风险承受度。

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

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

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

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

#### （4）控制活动

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

2) 公司内部控制活动包括：不相容职务分离控制、授权审批控制、会计系统控制、财产保护控制、预算控制、运营分析控制和绩效考评控制等。

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

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

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

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

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

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

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

⑥公司建立运营分析控制，制定运营情况分析制度，综合运用业务、财务、

风险等方面的信息，通过因素分析、对比分析、趋势分析等方法，定期开展运营情况分析，发现存在的问题，及时查明原因并加以改进。

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

3) 公司重点加强对关联交易、对外担保、重大投资等活动的控制，加强对控股子公司的管理控制，并建立相应的控制政策和程序。

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

4) 公司关联交易的内部控制应遵循诚实信用、平等自愿、公平公开公允的原则，确保交易行为规范；对外担保的内部控制应遵循合法、审慎、互利、安全的原则，严格控制担保风险；重大投资的内部控制应遵循合法、审慎、安全、有效的原则，控制投资风险、注重投资效益。

#### (5) 对所属公司的管理控制

1) 公司制定科学的投资管控制度，通过合法有效的形式履行出资人职责、维护出资人权益，重点关注控股子公司的发展战略、年度财务预决算、重大投融资、重大担保、大额资金使用、主要资产处置、重要人事任免、内部控制体系建设等重要事项。

2) 公司制定对控股子公司的控制政策及程序，并在充分考虑控股子公司业务特征的基础上，督促其建立内部控制制度。公司对控股子公司的管理控制至少应包括以下控制活动：

①建立对各控股子公司的控制架构和控制制度，明确向控股子公司委派的董事、监事及重要高级管理人员的选任方式和职责权限等。

②根据公司的战略规划，协调控股子公司的经营策略和风险管理策略，督促各控股子公司据以制定相关业务经营计划、风险管理程序，并严格在授权范围内经营。

③建立对各控股子公司的业绩考核与激励约束制度。

④制定母子公司业务竞争、关联交易等方面的政策及程序。

⑤要求各控股子公司建立重大事项报告制度及审议程序，及时向公司分管负

责人报告重大业务事项、重大财务事项以及其他可能对公司经营产生重大影响的信息，并严格按照授权规定将重大事项报公司董事会审议或股东审议。

⑥定期取得并分析各控股子公司的财务报告和管理报告，并根据相关规定，委托会计师事务所审计控股子公司的财务报告。

3) 公司对控股子公司内部控制制度的实施及其检查监督工作进行评价。

4) 公司的控股子公司同时控股其他公司的，公司督促其控股子公司参照上述要求，逐层建立对其下属子公司的管理控制制度。

5) 公司比照上述要求，对具有重大影响的参股公司的内部控制制度做出安排。

#### (6) 信息与沟通

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

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

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

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

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

6) 公司建立举报投诉制度和举报人保护制度，设置举报专线，明确举报投诉处理程序、办理时限和办结要求，确保举报、投诉成为公司有效掌握信息的重要途径。

#### (7) 内部控制的监督检查

---

1) 公司制定风险管理、稽核审计和纪检监察的规章制度，明确各机构在内部监督中的职责权限，规范内部监督的程序、方法和要求。

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

专项监督的范围和频率根据风险评估结果以及日常监督的有效性等予以确定。

2) 公司明确内部控制缺陷认定标准，建立健全内部控制缺陷的纠正与处理机制，对内部控制监督检查中发现的缺陷，分析缺陷的性质和产生原因，提出整改方案，督促相关单位落实，并对落实情况进行跟踪检查，就内部监督中发现的重大缺陷，追究相关责任单位或者责任人的责任。

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

4) 公司稽核审计部门结合内部监督情况，定期对内部控制的健全性和有效性进行全面自我评价，出具内部控制自我评价报告。

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

---

---

## 第四部分 集合计划托管人

### 一、基金托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

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[1998]12 号

联系人：李申

联系电话：(021)6063 7102

#### (二) 主要人员情况

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、全球托管处、养老金托管处、新兴业务处、运营管理处、跨境托管运营处、社保及大客户服务处、托管应用系统支持处、合规监督处等 12 个职能处室，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工 300 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

#### (三) 基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系，是目

前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2021 年三季度末，中国建设银行已托管 1120 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。截至目前，中国建设银行先后多次被《全球托管人》、《财资》、《环球金融》杂志及《中国基金报》评选为“最佳托管银行”、连续多年荣获中央国债登记结算有限责任公司（中债）“优秀资产托管机构”、银行间市场清算所股份有限公司（上清所）“优秀托管银行”奖项、并在 2017、2019 及 2020 年分别荣获《亚洲银行家》颁发的“最佳托管系统实施奖”、“中国年度托管业务科技实施奖”以及“中国年度托管银行（大型银行）”奖项。

## 二、基金托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

作为基金托管人，中国建设银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格检查，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

### （二）内部控制组织结构

中国建设银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管业务部配备了专职内控合规人员负责托管业务的内控合规工作，具有独立行使内控合规工作职权和能力。

### （三）内部控制制度及措施

资产托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

### （一）监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投资运

---

---

作。利用自行开发的“新一代托管应用监督子系统”，严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## （二）监督流程

1.每工作日按时通过新一代托管应用监督子系统，对各基金投资运作比例控制等情况进行监控，如发现投资异常情况，向基金管理人进行风险提示，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，如有重大异常事项及时报告中国证监会。

2.收到基金管理人的划款指令后，对指令要素等内容进行核查。

3.通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求基金管理人进行解释或举证，如有必要将及时报告中国证监会。



---

---

## 第五部分 相关服务机构

### 一、集合计划销售机构

#### 1、直销机构

申万宏源证券有限公司

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号恒奥中心 B 座二层

法定代表人：杨玉成

客户服务电话：95523

联系人：罗奂萌、沈维婧

传真：010-88085753

#### 2、其他销售机构：

##### (1) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358 号大成国际大厦  
20 楼2005室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大  
厦20 楼

法定代表人：王献军

联系人：王叔胤

电话：021-33388252

传真：021-33388224

客户服务电话：400-800-0562

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

##### (2) 京东肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区知春路76号(写字楼)1号楼4层1-7-2

办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总  
部A座15层

法定代表人：邹保威

联系人：苏湘然

电话：13552280319

(3) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区金融大街25号, 香港中环干诺道中3号中国建设银行大厦28楼

法定代表人：田国立

联系人：吴寒冰

电话：010-67596051

(4) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路1号903室

办公地址：浙江省杭州市余杭区五常街道同顺街18号同花顺大楼4层

法定代表人：吴强

联系人：洪泓

电话：0571-88911818-8659

客户服务电话：952555

网址：fund.10jqka.com.cn

(5) 北京植信基金销售有限公司

注册地址：北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京朝阳区四惠盛世龙源国食苑10号楼

法定代表人：王军辉

联系人：张鼎

电话：18641514414

(6) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦

法定代表人：其实

联系人：段颖

电话：021-54509977-8418

(7) 腾安基金销售（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商

务秘书有限公司)

办公地址： 深圳市南山区海天二路腾讯滨海大厦南塔15层

法定代表人： 刘明军

联系人： 靳倩

电话： 0755-86013388

(8) 上海陆金所基金销售有限公司

注册地址： 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元

办公地址： 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号

法定代表人： 王之光

联系人： 王嘉恂

电话： 021-38645803

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

中国证券登记结算有限责任公司

办公地址： 北京市西城区太平桥大街17号恒奥中心A座

法定代表人： 周明

全国统一客户服务电话： 4008058058

联系人： 苑泽田

传真： 010-50938991/8907

## 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： 俞卫锋

电话： 021-31358666

传真： 021-31358600

联系人： 陈颖华

---

经办律师：黎明、陈颖华

#### 四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称：中兴华会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市西城区阜外大街1号东塔楼15层

办公地址：北京市西城区阜外大街1号东塔楼15层

执行事务合伙人：李尊农

联系电话：010-68364878

联系传真：010-68364875

经办注册会计师：傅虎、谭军英

联系人：傅虎

---

---

## 第六部分 集合计划的历史沿革

申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划由宏源证券宏源 3 号红利成长集合资产管理计划变更而来。

宏源证券宏源 3 号红利成长集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2010 年 11 月 2 日经中国证监会许可【2010】1518 号文核准设立，自 2011 年 2 月 14 日起开始募集，于 2011 年 3 月 11 日结束募集工作，并于 2011 年 3 月 21 日正式成立。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，宏源证券宏源 3 号红利成长集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，自 2021 年 1 月 19 日起，《申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《宏源证券宏源 3 号红利成长集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

---

---

## 第七部分 集合计划的存续

变更为本集合计划后，本集合计划存续期限自本集合计划合同生效之日起 3 年，但在此期间如同时满足以下条件的，则本集合计划在变更为公募基金后存续期限为不定期，而无需召开集合计划份额持有人大会：

1、获得公募基金管理资格或者以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司并将本集合计划合同中管理人的全部权利和义务转让给前述从事资产管理业务的公司；

2、在法律法规规定、集合计划合同约定的范围内，对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，根据监管机构的要求将本集合计划变更注册为相应的公募基金。

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

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

---

---

## 第八部分 集合计划份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

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

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

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

本集合计划每日开放。投资人在开放日办理集合计划份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但集合计划管理人根据法律法规、中国证监会的要求或集合计划合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。集合计划合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，集合计划管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

集合计划管理人自集合计划合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

集合计划管理人自集合计划合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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

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

### 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的集合计划份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在集合计划管理人规定的时间以内按约定方式撤销，具体规定参见招募说明书；

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

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

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

#### 四、申购与赎回的程序

##### 1、申购和赎回的申请方式

集合计划投资人必须根据集合计划销售机构规定的程序，在开放日的业务办理时间向集合计划销售机构提出申购或赎回的申请。

##### 2、申购和赎回的款项支付

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

集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；集合计划份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，集合计划管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。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。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照集合计划合同有关条款处理。

##### 3、申购和赎回申请的确认

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

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

#### 五、申购和赎回的数量限制

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

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

3、单个投资人累计持有的集合计划份额不设上限，但单一投资者持有集合计划份额数不得达到或超过集合计划份额总数的 50%（在集合计划运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50% 的除外）。

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的数量限制。管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

##### 1、申购费

（1）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	1.00%
$100 \text{ 万元} \leq M < 500$ 万元	0.75%
$500 \text{ 万元} \leq M < 1000$ 万元	0.50%
$M \geq 1000$ 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%
$7 \text{ 日} \leq N < 30$ 日	0.75%
$30 \text{ 日} \leq N < 180$ 日	0.50%
$N \geq 180$ 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，将赎回费全额计入集合计划财产；对持续持有期等于或长于 30 日、少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入集合计划财产；对持续持有期等于或长于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入集合计划财产。以上每个月按照 30 日计算。未计入集合计划财产的赎回费用于支付注册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集合计划合同约定的情形下根据市

场情况制定集合计划促销计划，定期或不定期地开展集合计划促销活动。在集合计划促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，管理人可以适当调低集合计划的申购、赎回费率。

## 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 1.00%，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：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 1.00\%) = 49,504.95 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000 - 49,504.95 = 495.05 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49,504.95 / 1.0500 = 47,147.57 \text{ 份}$$

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 47,147.57 份的集合计划份额。

例：某投资者投资 1020 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：

$$\text{申购费用} = 1,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 10,200,000 - 1,000 = 10,199,000.00 \text{ 元}$$

---

---

申购份额 =  $10,199,000.00 / 1.0500 = 9,713,333.33$  份

即：投资人投资 1020 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 9,713,333.33 份集合计划份额。

### 3、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并扣除其他相应的费用，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，持有期为 5 日，则对应的赎回费率为 1.50%，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 =  $50,000 \times 1.0500 = 52,500.00$  元

赎回费用 =  $52,500.00 \times 1.50\% = 787.50$  元

净赎回金额 =  $52,500.00 - 787.50 = 51,712.50$  元

即：持有人赎回 5 万份本集合计划份额，持有期为 5 日，假设赎回当日集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 51,712.50 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，集合计划管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

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

发生上述第 1、2、3、5、6、8、9 项暂停申购情形之一且集合计划管理人决定暂停接受投资人申购申请时，集合计划管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝的，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，集合计划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，集合计划管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致集合计划管理人不能支付赎回款项。

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

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

(2) 部分延期赎回：当集合计划管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，集合计划管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日集合计划总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的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 10%时，集合计划管理人有权对其进行延期办理（被延期赎回的赎回申请，将自动转入下一个开放日继续赎回，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）；对于该集合计划份额持有人申请赎回的份额中未超过上一开放日集合计划总份额 10%的部分，集合计划管理人根据前段“（1）全部赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他集合计划份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该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，如集合计划管理人认为有必要，可暂停接受集合计划的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在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，集合计划管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个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，集合计划管理人当日应立即向中国证

监会备案，并在规定期限内在规定媒介上刊登暂停公告。

2、上述暂停申购或赎回情况消除的，集合计划管理人应于重新开放日公布最近 1 个工作日集合计划份额净值。

3、集合计划管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。

## 十二、集合计划转换

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

## 十三、集合计划的非交易过户

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

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

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

## 十四、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，具体以销售机构办理规则为准。

## 十五、定期定额投资计划



---

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

#### 十六、集合计划份额的冻结和解冻

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

#### 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。

## 第九部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

本集合计划通过把握中国经济增长所带来投资机会，重点投资于高增长、低估值、具备较好分红能力的上市公司，力争实现集合计划资产的长期稳定增值。

### 二、投资理念

本集合计划通过投资股票市场中高增长、低估值、具备较好分红能力的上市公司股票，为投资者获得股息收益和资本增值双重收益。

### 三、投资范围及资产配置比例

#### 1、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，包括境内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票，不包含港股）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本集合计划可以参与融资交易；不可以参与融券交易，不得将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司，但法律法规另有规定的除外。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

#### 2、集合计划的投资组合比例

集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产的比例为 0%—95%（投资于境内依法发行上市的股票占集合计划资产的 0%-95%）；投资同业存单不超过集合计划资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，集合计划保留的现金或者投资于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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如因证券/期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在 10 个交易日内将投

资比例降至许可范围内。

#### 四、投资策略

本集合将深入挖掘高增长、高分红行业和上市公司投资机会，使投资者充分分享到中国经济长期快速增长的发展成果。

##### 1、资产配置策略

本集合计划根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行资产配置：

当上证指数成份股的整体市净率 PB（每股股价与每股净资产的比率）处于 6 以上（不含），本集合计划中股票资产总市值占资产净值比例为 0~50%；

当上证指数成份股的整体市净率 PB 处于 3 到 6 之间时，本集合计划中股票资产总市值占资产净值比例为 40%~80%；

当上证指数成份股的整体市净率 PB 处于 3 以下（不含），本集合计划中股票资产总市值占资产净值比例为 70%~95%。

此外，本集合计划将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。

##### 2、股票投资策略

本集合计划对股票的投资采用自上而下的行业配置策略和自下而上的个股精选策略，并结合定性分析与定量分析构建投资组合。

###### （1）行业配置策略

在行业配置层面，本集合计划将运用“自上而下”的行业配置方法，通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究，采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。

###### （2）个股精选策略

本集合计划主要投资于中国 A 股市场上高增长高分红能力的上市公司。在个股选择上，本集合计划将采用定量和定性分析相结合的系统方法精选受益于分红能力强、成长性较高且估值合理的股票构建股票组合。

个股投资策略方面，管理人主要关注基本面、价值、市场情绪及流动性等因素。基本面因子主要包括上市公司的盈利能力、现金流情况、财务杠杆水平以及

未来成长性等，如主营业务收入、毛利率、每股收益、总资产回报率、企业现金流、资产负债率等指标，通过深入分析各类基本面信息来挖掘上市公司的当前价值和成长潜力。价值方面，既包含上市公司基本面的信息，也包含股票价格的信息。对于不同行业的股票，根据上市公司经营的特点和历史实证检验结果，采用不同的估值指标，如市盈率、市净率、市现率、市销率、EV/EBITDA 等，挑选具有绝对或相对估值吸引力的股票。市场方面，管理人主要关注股票价格的动量/反转趋势、股票所处风格板块的轮动，股票价格的历史波动等。流动性方面，管理人主要关注成交量的变化、趋势、冲击成本等。

管理人通过对政策面、市场面、基本面等因素分析，判断各类目标资产的风险和收益，定期、不定期调整各类资产组合的配置比例。

### 3、债券投资策略

本集合计划在债券资产的投资过程中，将采用积极主动的投资策略，结合宏观经济政策分析、经济周期分析、市场短期和中长期利率分析、供求变化等多种因素分析来配置债券品种，在兼顾收益的同时，有效控制集合资产的整体风险。在个券的选择上，本集合计划将综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。

在分析宏观经济运行特征并对各类市场大势做出判断的前提下，本集合计划管理人对可转债所对应的基础股票进行分析和研究，从行业选择和个券选择两方面进行全方位的评估，对盈利能力或成长性较好的行业和上市公司的可转债进行重点关注，对可转债投资价值进行有效的评估，选择投资价值较高的个券进行投资。

可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值，本集合计划管理人将对可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可交换债券进行投资。此外，本集合计划管理人还将根据新发可交换债券的预计中签率、模型定价结果，积极参与可交换债券新券的申购。

### 4、资产支持证券投资策略

本集合计划将从原始权益人、ABS 计划管理人、外部信用评级、基础资产等多个维度精选期限较短、收益较高的 ABS 资产。

## 5、股指期货投资策略

本集合计划在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的量化研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，并与现货资产进行匹配，在法律法规允许的范围内，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

## 6、融资投资策略

本集合计划在法律法规和集合计划合同允许的范围内，在风险可控的整体原则下，适度参与部分经过深度研究的上市公司的融资交易，力争获得更好的风险调节后的收益。

## 7、现金类资产投资策略

在匹配集合计划产品流动性的基础上，将本集合计划现金投资于银行存款、债券逆回购等货币市场金融工具，力争获取高于银行活期存款的收益。

## 五、投资限制

### 1、组合限制

本集合计划在投资策略上兼顾投资原则以及集合计划的固有特点，通过分散投资降低集合计划资产的非系统性风险，保持集合计划组合良好的流动性。集合计划的投资组合将遵循以下限制：

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

(2) 本集合计划与本集合计划管理人管理的其他集合计划持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

(3) 本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得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得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(4) 投资于股票的资产占集合计划资产的比例范围为 0-95%；

(5) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于本集合计划资

产净值的 5%；其中，现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；

(6) 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%；本集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种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；

(7) 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本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前款所规定比例限制的，管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

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

(9) 本集合计划的资产总值不得超过本集合计划资产净值的 140%；

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

(11) 本集合计划参与股指期货交易，需满足下列规定：

1) 在任何交易日日终，持有的买入股指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；

2) 本集合计划在任何交易日日终，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%；

3) 本集合计划在任何交易日日终，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%；

4) 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;

5) 本集合计划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%;

(12) 本集合计划参与融资的,每个交易日日终,本集合计划持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过集合计划资产净值的 95%;

(13) 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%;

(14) 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%;

(15) 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%;

(16) 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%;

(17) 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;

(18) 投资同业存单不超过集合计划资产的 20%;

(19) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

除上述第(5)、(7)、(8)、(17)项外,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不符合前述投资比例的,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。

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

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

## 2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，本集合计划禁止从事下列行为：

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

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

## 六、业绩比较基准

$60\% \times \text{沪深 300 指数} + 40\% \times \text{上证国债指数}$

沪深 300 指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两个市场第一个统一指数；该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，不易被操纵，并且有较高的知名度和市场影响力。上证国债指数在编制方法上，借鉴了美林债券指数、JP 摩根债券指数等国际成熟市场主流债券指数的编制方法和特点，并充分考虑了国内债券市场发展的现状。在借鉴国外成熟市场经验的基础上，通过对实际数据的大量实证研究，所提出的编制方法具有科学性、合理性、简便性和易于复制等优点。

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，或今后市场出现更具代表性的投资基准，或更科学的复合指数权重比例，在与托管人协商一致后，本集合计划管理人可调整或变更业绩比较基准，而无需



召开集合计划份额持有人大会。

七、集合计划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、集合计划管理人按照国家有关规定代表集合计划独立行使股东或债权人权利，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、风险收益特征

本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、股票型集合资产管理计划，高于债券型基金、债券型集合资产管理计划、货币市场基金及现金管理类集合资产管理计划。

九、集合计划的投资组合报告

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

集合计划托管人中国建设银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于2021年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2021年9月30日，本报告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	120,570,592.26	71.05
	其中：股票	120,570,592.26	71.05
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	33,400,000.00	19.68
	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	14,201,412.80	8.37
-	-	-	-
8	其他资产	1,535,739.71	0.90
9	合计	169,707,744.77	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	363,542.00	0.22
C	制造业	67,384,905.49	40.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	593,000.00	0.36
F	批发和零售业	13,628.95	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,949.04	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,039,467.20	26.13
J	金融业	3,892,500.00	2.36
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,241,735.04	1.36
M	科学研究和技术服务业	2,433,987.65	1.48
N	水利、环境和公共设施管理业	604,269.07	0.37
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	1,607.82	0.00
S	综合	-	-
	合计	120,570,592.26	73.19

### (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（%）
-	-	-
合计	-	-

注：本集合计划本报告期末未持有港股通投资股票

## 3、期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	176,500	9,707,500.00	5.89
2	300253	卫宁健康	625,500	9,088,515.00	5.52
3	000977	浪潮信息	208,000	5,932,160.00	3.60
4	002236	大华股份	242,000	5,740,240.00	3.48
5	002439	启明星辰	205,700	5,679,377.00	3.45
6	002230	科大讯飞	93,200	4,930,280.00	2.99
7	603859	能科科技	68,300	2,424,650.00	1.47
8	688300	联瑞新材	39,600	2,415,600.00	1.47
9	000938	紫光股份	95,000	2,369,300.00	1.44
10	300379	东方通	75,800	2,318,722.00	1.41

(2) 期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

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（%）
-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

注：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名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------

					(%)
-	-	-	-	-	-

注：本基金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名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属

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

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本集合计划本报告期末未持有权证

#### 9、报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明

##### （1）报告期末本集合计划投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

注：本报告期本集合计划无股指期货交易

##### （2）本集合计划投资股指期货的投资政策

本集合计划在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的量化研究，结合股指期货的定价模型寻求合理的估值水平，并与现货资产进行匹配，在法律法规允许的范围内，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保

值操作。

#### 10、报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明

##### (1) 本期国债期货投资政策

—

##### (2) 报告期末本集合计划投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
—	—	—	—	—	—
公允价值变动总额合计(元)					—
国债期货投资本期收益(元)					—
国债期货投资本期公允价值变动(元)					—

注：本报告期本集合计划无国债期货交易

##### (3) 本期国债期货投资评价

—

#### 11、投资组合报告附注

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

(2) 本集合计划本报告期末投资股票，没有出现投资的前十名股票超出集合计划合同规定的备选股票库的情况。

##### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	52,069.77
2	应收证券清算款	644,447.15
3	应收股利	—
4	应收利息	-1,937.04
5	应收申购款	841,159.83
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,535,739.71

##### (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
—	—	—	—	—

注：本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

---

---

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情 况说明
-	-	-	-	-	-

注：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。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

## 第十部分 集合计划的业绩

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

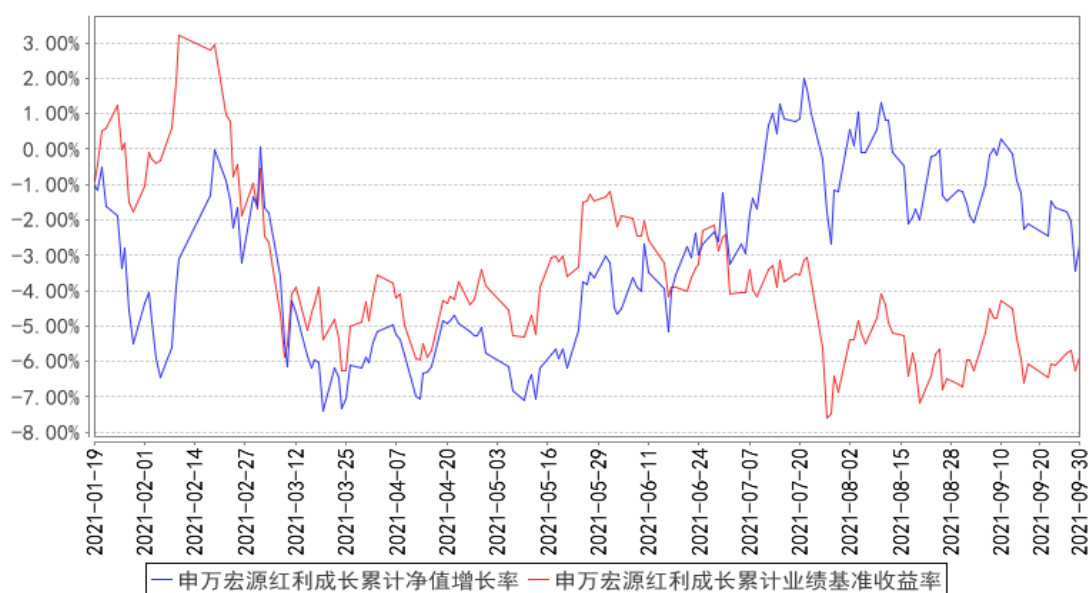
集合计划业绩截止日为2021年9月30日。

### 1、集合计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.47%	0.84%	-3.50%	0.72%	2.03%	0.12%
过去六个月	3.53%	0.75%	-1.09%	0.66%	4.62%	0.09%
自集合计划 合同生效起 至今	-2.70%	0.86%	-5.89%	0.76%	3.19%	0.10%

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

申万宏源红利成长累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本集合计划合同自2021年1月19日起生效，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，目前集合计划的投资组合比例已符合集合计划合同的有关约定。



---

---

## 第十一部分 集合计划的财产

### 一、集合计划资产总值

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

其构成主要有：

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

### 二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

### 三、集合计划财产的账户

托管人已为本集合计划开立证券账户、资金账户以及其他相关账户，资金账户名称为“宏源3号红利成长集合资产管理计划”，证券账户名称是“申万宏源证券—建行—申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划”（若届时需要变更，以届时变更后的资金账户、证券账户等名称为准）。开立的集合计划专用账户与管理人、托管人、集合计划销售机构和集合计划登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。

### 四、集合计划财产的保管和处分

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

---

合计划合同的规定处分外，集合计划财产不得被处分。

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

---

---

## 第十二部分 集合计划资产估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

集合计划所拥有的股票、债券、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

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

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

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

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

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

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券，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；

(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；

(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或未挂牌转让的股票、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。

(4) 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，按成本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。

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、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

6、股指期货合约一般以估值日的结算价估值。估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

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

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

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

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

仍无法达成一致的意见，按照集合计划管理人对集合计划资产净值的计算结果对外予以公布。

## 五、估值程序

1、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。集合计划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集合计划份额净值，并按规定公告。

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

## 六、估值错误的处理

集合计划管理人和集合计划托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当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，如果由于集合计划管理人或集合计划托管人、或登记机构、或销售机构、或投资人自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，由集合计划管理人先行赔付，再向有过错的当事人追偿。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。

由于证券/期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，集合计划管理人和集合计划托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划份额净值计算错误，集合计划管理人、集合计划托管人免除赔偿责任。但集合计划管理人、

集合计划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。

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

#### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### 七、暂停估值的情形

1、集合计划投资所涉及的证券/期货交易市场遇非工作日或因其他原因暂停营业时；

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

3、当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，经与集合计划托管人协商确认后，集合计划管理人应当暂停估值；

4、中国证监会和集合计划合同认定的其它情形。

#### 八、集合计划净值的确认

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



## 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

各方一致同意实施收益分配时应遵循以下原则：

- 1、本集合计划每一份额享有同等分配权；
- 2、在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，本集合计划每个会计年度收益分配次数至少为 1 次，本集合资产管理计划每年收益分配次数最多为 4 次，每个会计年度累计分配金额不得低于年末可供分配利润的 70%。若合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；
- 3、集合计划收益分配后，收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、本集合计划收益分配方式分为两种：现金红利与红利再投资，红利再投资增加的份额计入集合计划份额总规模，投资人可选择现金红利或将现金红利转为集合计划份额进行再投资；若投资人不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金红利；
- 5、选择采取红利再投资形式的，分红资金将按除息日的份额净值转成相应的份额。投资人在不同销售机构处可以选择不同的分红方式；
- 6、法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案的确定、公告与实施

集合计划收益分配方案包括集合计划收益的范围、集合计划净收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。本集合计划收益分配方案由管理人拟定，并须经托管人复核，在 2 日内在规定媒介公告。

---

## 五、集合计划收益分配中发生的费用

红利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，集合计划注册登记人可将投资者的现金红利按除息日集合计划的份额净值自动转为集合计划的份额。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》规定执行。

## 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、集合计划管理人的管理费；
- 2、集合计划托管人的托管费；
- 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、律师费和诉讼费；
- 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、账户开户费用、账户维护费用；
- 9、按照国家有关规定和集合计划合同约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

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

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### （一）集合计划管理人的管理费

集合计划管理人收取固定管理费。

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 1.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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提，逐日累计至每月末，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于每月结束起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。若遇非工作日等，支付日期顺延。

#### （二）集合计划托管人的托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月末，按月支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于每月结束起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。若遇非工作日等，支付日期顺延。

上述“一、集合计划费用的种类”中第 3—9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由集合计划托管人从集合计划财产中支付。

### 三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

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

2、集合计划管理人和集合计划托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；

3、集合计划合同生效前的相关费用，前述费用根据《宏源证券宏源 3 号红利成长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、集合计划税收

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

管理人应按照国家相关税务法规对本集合计划的应税行为缴纳增值税和相关附加税费，并向托管人如实告知税款计算方式和计算基础，按季度或年度向托管人提供税款缴纳金额明细。若托管人对税款计算方式、计算基础及缴税金额产生疑问，管理人应提供相关的合理解释。若由于管理人原因，使得本集合计划未能全额缴纳应缴税款，或使得本集合计划所缴纳的税款超过了其应缴税款，管理人应在得知该情况当日向托管人告知，对于由此造成的任何风险、后果和损失均

---

---

由管理人承担，托管人对此不承担任何责任。此外，涉及增值税和相关附加税费的任何事宜均由管理人与集合计划持有人协商确定，与托管人无关，托管人不承担任何责任。

---

---

## 第十五部分 集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

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

### 二、集合计划的年度审计

- 1、集合计划管理人聘请与集合计划管理人、集合计划托管人相互独立的具有证券、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，应事先征得集合计划管理人同意。
- 3、集合计划管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报集合计划托管人。更换会计师事务所需在2日内在规定媒介公告。

## 第十六部分 集合计划的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

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

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

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的集合计划信息

公开披露的集合计划信息包括：

（一）集合计划招募说明书、集合计划合同、集合计划托管协议、产品资料概要

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

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

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

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

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

（二）集合计划合同生效公告

集合计划管理人应当在规定媒介上登载集合计划合同生效公告。

（三）集合计划净值信息



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

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

集合计划管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的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

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

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

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

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

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

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

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

特殊情形除外。

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

#### （六）临时报告

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

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

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

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

13、集合计划收益分配事项；

14、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、集合计划份额净值计价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、集合计划管理人采用摆动定价机制进行估值；

22、集合计划扩募、延长集合计划合同期限；

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

#### （七）澄清公告

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

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。

#### （十一）参与融资业务的信息披露

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)等文件中披露参与融资交易的情况,包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及管理情况。

#### （十二）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

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

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

集合计划管理人、集合计划托管人除依法在规定媒介上披露信息外,还可以根据需要在其他公共媒介披露信息,但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信

---

息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

---

---

## 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，主要投资对象为境内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票，不包含港股）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

### (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) 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 10%时，集合计划管理人有权对其进行延期办理（被延期赎回的赎回申请，将自动转入下一个开放日继续赎回，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）；对于该集合计划份额持有人申请赎回的份额中未超过上一开放日集合计划总份额 10%的部分，集合计划管理人根据前段“（1）全部赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他集合计划份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该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) 本集合计划股票资产占集合计划资产的比例为 0%—95%（投资于境内依法发行上市的股票占集合计划资产的 0%-95%）；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。股指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之间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

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

#### (4) 投资科创板股票的风险

##### 1) 科创板股票的流动性风险

科创板投资门槛高，个人投资者需要满足一定条件才可参与科创板股票投资，科创板股票流动性可能弱于其他市场板块，若机构投资者对科创板股票形成一致性预期，存在股票无法成交的风险。

## 2) 科创板企业退市风险

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；且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节，上市公司退市风险更大，可能给本集合计划带来不利影响。

## 3) 投资集中的风险

因科创板上市企业均为科技创新成长型，其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似，基本难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值波动。

## 4) 市场风险

科创板股票集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，科创板股票市场风险加大。

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，科创板股票其后涨跌幅限制为20%，科创板股票投资者应当关注可能产生的股价波动的风险。

## 5) 系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板股票相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

## 6) 股价波动风险

科创板新股发行价格、规模、节奏等坚持市场化导向，询价、定价、配售等环节由机构投资者主导。科创板新股发行全部采用询价定价方式，询价对象限定在证券公司等七类专业机构投资者，而个人投资者无法直接参与发行定价。同时，因科创板企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，市场可比公司较少，传统估值方法可能不适用，发行定价难度较大，科创板股票上市

后可能存在股价波动的风险。

#### 7) 政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板股票也会带来政策影响。

#### 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，由集合计划管理人和集合计划托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

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

### 二、集合计划合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，集合计划合同应当终止：

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

### 三、集合计划财产的清算

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

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人、具有从事证券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规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

#### 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由集合计划托管人保存 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) 集合计划份额持有的权利义务

集合计划投资者持有本集合计划份额的行为即视为对集合计划合同的承认和接受，集合计划投资者自依据集合计划合同取得的集合计划份额，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) 监督集合计划管理人的投资运作；
- (8) 对集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和本集合计划合同约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守本集合计划合同、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资集合计划产品，了解自身风险承受能力，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；



- 
- 
- (3) 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本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本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本集合计划合同约定的其他义务。

## (二) 集合计划管理人的权利与义务

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

- (1) 依法募集资金；
- (2) 自集合计划合同生效之日起，根据法律法规和集合计划合同独立运用并管理集合计划财产；
- (3) 依照集合计划合同收取集合计划管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (4) 销售集合计划份额；
- (5) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；
- (6) 依据集合计划合同及有关法律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) 在集合计划托管人更换时，提名新的集合计划托管人；
- (8) 选择、更换集合计划销售机构，对集合计划销售机构的相关行为进行监督和处理；
- (9) 担任或委托其他符合条件的机构担任集合计划登记机构办理集合计划登记业务并获得集合计划合同规定的费用；
- (10) 依据集合计划合同及有关法律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融券及转融通证券出借业务；

(14) 以集合计划管理人的名义，代表集合计划份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

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

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他权利。

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

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

(2) 办理集合计划备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受集合计划托管人的监督；

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

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

- 
- (10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；
  - (11) 严格按照《基金法》、集合计划合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；
  - (12) 保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、集合计划合同及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
  - (13) 按集合计划合同的约定确定集合计划收益分配方案，及时向集合计划份额持有人分配集合计划收益；
  - (14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
  - (15) 依据《基金法》、集合计划合同及其他有关规定召集集合计划份额持有人大会或配合集合计划托管人、集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；
  - (16) 按规定保存集合计划财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料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集合计划托管人；
  - (20) 因违反集合计划合同导致集合计划财产的损失或损害集合计划份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
  - (21) 监督集合计划托管人按法律法规和集合计划合同规定履行自己的义务，集合计划托管人违反集合计划合同造成集合计划财产损失时，集合计划管理人应为集合计划份额持有人利益向集合计划托管人追偿；
  - (22) 当集合计划管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关集合计划事务的行为承担责任；
  - (23) 以集合计划管理人名义，代表集合计划份额持有人利益行使诉讼权利

或实施其他法律行为；

- (24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；
- (25) 建立并保存集合计划份额持有人名册；
- (26) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他义务。

### (三) 集合计划托管人的权利义务

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

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

(6) 在集合计划管理人更换时，提名新的集合计划管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和集合计划合同约定的其他权利。

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

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

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

等方面相互独立；

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

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

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

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

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

(11) 保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料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集合计划管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和集合计划合同的规定监督集合计划管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决定；

(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。

## 二、集合计划份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

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

### (一)、召开事由

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

- (1) 终止集合计划合同；
- (2) 更换集合计划托管人或（和）管理人；
- (3) 转换集合计划运作方式；
- (4) 调整集合计划管理人、集合计划托管人的报酬标准；
- (5) 变更集合计划类别；
- (6) 本集合计划与其他集合计划的合并；
- (7) 变更集合计划投资目标、范围或策略；
- (8) 变更集合计划份额持有人大会程序；
- (9) 集合计划管理人或集合计划托管人要求召开集合计划份额持有人大会；
- (10) 单独或合计持有本集合计划总份额10%以上（含10%）集合计划份额的

集合计划份额持有人（以集合计划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；

（11）对集合计划当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

（12）法律法规、集合计划合同或中国证监会规定的其他应当召开集合计划份额持有人大会的事项。

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

（1）法律法规要求增加的集合计划费用的收取；

（2）增加、减少、调整本集合计划份额类别设置或调整本集合计划的申购费率、赎回费率或调整收费方式；

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

（4）因相应的法律法规发生变动而应当对集合计划合同进行修改；

（5）对集合计划合同的修改对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及集合计划合同当事人权利义务关系发生变化；

（6）集合计划管理人获得公募基金管理业务资格且对本集合计划合同无实质性修改的前提下将本计划变更注册为公募基金；

（7）集合计划管理人将本集合计划合同项下权利义务转让给其以独资或控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司；

（8）按照法律法规和集合计划合同规定不需召开集合计划份额持有人大会的其他情形。

## （二）会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或集合计划合同另有约定外，集合计划份额持有人大会由集合计划管理人召集。

2、集合计划管理人未按规定召集或不能召开时，由集合计划托管人召集。

3、集合计划托管人认为有必要召开集合计划份额持有人大会的，应当向集合计划管理人提出书面提议。集合计划管理人应当自收到书面提议之日起10日内决定是否召集，并书面告知集合计划托管人。集合计划管理人决定召集的，应当自

出具书面决定之日起60日内召开；集合计划管理人决定不召集，集合计划托管人仍认为有必要召开的，应当由集合计划托管人自行召集，并自出具书面决定之日起60日内召开并告知集合计划管理人，集合计划管理人应当配合。

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

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

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

### （三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；



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

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

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

#### (四) 集合计划份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

集合计划份额持有人大会。重新召集的集合计划份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的集合计划份额应不少于本集合计划在权益登记日集合计划总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指集合计划份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或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集合计划托管人（如果集合计划托管人为召集人，则为集合计划管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在集合计划托管人（如果集合计划托管人为召集人，则为集合计划管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取集合计划份额持有人的表决意见；集合计划托管人或集合计划管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

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

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

3、在不与法律法规冲突的前提下，集合计划份额持有人大会亦可采用网络、

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

4、在不与法律法规冲突的前提下，集合计划份额持有人可采用其他书面或非书面方式授权他人代为出席集合计划份额持有人大会并行使表决权，授权方式可以采用书面、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、更换集合计划管理人、更换集合计划托管人、与其他集合计划合并、法律法规及集合计划合同规定的其他事项以及会议召集人认为需提交集合计划份额持有人大会讨论的其他事项。

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为集合计划管理人授权出席会议的代表，在集合计划管理人授权代表未能主持大会的情况下，由集合计划托管人授权其出席会议的代表主持；如果集合计划管理人授权代表和集合计划托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的集合计划份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名集合计划份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人。集合计划管理人和集合计划托管人拒不出席或主持集合计划份额持有人大会，不影响集合计划份额持有人大会作出的决议的效力。

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

托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## （七）计票

### 1、现场开会

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

或集合计划托管人召集，但是集合计划管理人或集合计划托管人未出席大会的，集合计划份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的集合计划份额持有人中选举三名集合计划份额持有人代表担任监票人。集合计划管理人或集合计划托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

(3) 如果会议主持人或集合计划份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，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，集合计划管理人或集合计划托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

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

## (八) 生效与公告

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

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

(九) 本部分关于集合计划份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关

内容被取消或变更的，集合计划管理人提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

### 三、集合计划合同的终止事由、程序与集合计划资产的清算

#### （一）集合计划合同的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，集合计划合同应当终止：

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

#### （二）集合计划财产的清算

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

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人、具有从事证券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，清算期限相应顺延。

### (三) 清算费用

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

### (四) 集合计划财产清算剩余资产的分配

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

### (五) 集合计划财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经具有证券、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规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

### (六) 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由集合计划托管人保存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，可向管理人所在地的人民法院起诉。争议处理期间，集合计划合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行集合计划合同规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

集合计划合同受中国法律管辖。

## 五、集合计划合同的存放地及投资者取得方式

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

## 第二十部分 集合计划托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 集合计划管理人

名称：申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址：上海市徐汇区长乐路989号40层

邮政编码：200031

法定代表人：杨玉成

成立日期：2015年01月16日

批准设立机关及批准设立文号：中华人民共和国经营证券期货业务许可证  
000000011962号

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币肆佰柒拾亿元整

存续期间：持续经营

经营范围：证券经纪、证券投资咨询、融资融券、代销金融产品、证券投资基金代销、为期货公司提供中间介绍业务（以上各项业务限新疆、甘肃、陕西、宁夏、青海、西藏以外区域），证券资产管理，证券承销与保荐（限国债、非金融企业债务融资工具、政策性银行金融债、企业债承销），证券自营（除服务新疆、甘肃、陕西、宁夏、青海、西藏区域证券经纪业务客户的证券自营外），股票期权做市，证券投资基金托管，国家有关管理机关批准的其他业务。

#### (二) 集合计划托管人

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

邮政编码：100033

法定代表人：田国立

成立日期：2004年09月17日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】12号



组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 二、集合计划托管人对集合计划管理人的业务监督和核查

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

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括境内依法发行的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票，不包含港股）、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等）、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本集合计划可以参与融资交易；不可以参与融券交易，不得将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司，但法律法规另有规定的除外。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

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

(1) 本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不得超过本集合计划资

产净值的10%;

(2) 本集合计划与本集合计划管理人管理且由本集合计划托管人托管的其他集合计划持有一家公司发行的证券, 不得超过该证券的10%, 完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种可以不受此条款规定的比例限制;

(3) 本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得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得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(4) 投资于股票的资产占集合计划资产的比例范围为0-95%;

(5) 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 本集合计划持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于本集合计划资产净值的5%; 其中, 现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(6) 本集合计划管理人管理且由本集合计划托管人托管的全部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%; 本集合计划管理人管理且由本集合计划托管人托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的30%; 完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种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;

(7) 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本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前款所规定比例限制的, 管理人不得主动新增流动性受限资产的投资。

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

(9) 本集合计划的资产总值不得超过本集合计划资产净值的140%;

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

为1年，债券回购到期后不展期；

(11) 本集合计划参与股指期货交易，需满足下列规定：

1) 在任何交易日日终，持有的买入股指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；

2) 本集合计划在任何交易日日终，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%；

3) 本集合计划在任何交易日日终，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%；

4) 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；

5) 本集合计划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%；

(12) 本集合计划参与融资的，每个交易日日终，本集合计划持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的95%；

(13) 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%；

(14) 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%；

(15) 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%；

(16) 本集合计划管理人管理且由本集合计划托管人托管的全部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%；

(17) 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；

(18) 投资同业存单不超过集合计划资产的20%；

(19) 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

除上述第(5)、(7)、(8)、(17)项外，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不符合前述投资比例的，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。

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

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

(三)集合计划托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对本托管协议集合计划投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，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的原则，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集合计划托管人的同意，并履行信息披露义务。

(四)集合计划托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对集合计划管理人参与银行间债券市场进行监督。集合计划管理人应在集合计划投资运作之前向集合计划托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本集合计划适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。集合计划管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。集合计划托管人监督集合计划管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。集合计划管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如集合计划管理人根据市场情况需

要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向集合计划托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与集合计划托管人协商解决。

集合计划管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失，集合计划托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在集合计划托管人与集合计划管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，集合计划管理人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。集合计划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。如集合计划托管人事后发现集合计划管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，集合计划托管人应及时提醒集合计划管理人，集合计划托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

(五)集合计划托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对集合计划管理人投资流通受限证券进行监督。

集合计划管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确集合计划投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。集合计划托管人对集合计划管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

1. 本集合计划投资的流通受限证券与上文约定的流动性受限资产的定义不一致，流通受限证券须为由于法律法规、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、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等。本集合计划不投资有锁定期但锁定期不明确的证券。

本集合计划投资的流通受限证券限于可由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

本集合计划投资的流通受限证券应保证登记存管在本集合计划名下，集合计划管理人负责相关工作的落实和协调，并确保集合计划托管人能够正常查询。因

集合计划管理人原因产生的流通受限证券登记存管问题,造成集合计划托管人无法安全保管本集合计划资产的责任与损失,及因流通受限证券存管直接影响本集合计划安全的责任及损失,由集合计划管理人承担。

本集合计划投资流通受限证券,不得预付任何形式的保证金。

2. 集合计划管理人投资非公开发行股票,应制订流动性风险处置预案并经董事会批准。风险处置预案应包括但不限于因投资流通受限证券需要解决的集合计划投资比例限制失调、集合计划流动性困难以及相关损失的应对解决措施,以及有关异常情况的处置。集合计划管理人应在首次投资流通受限证券前向集合计划托管人提供集合计划投资非公开发行股票相关流动性风险处置预案。

集合计划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,集合计划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,集合计划托管人不承担任何责任。如因集合计划管理人原因导致本集合计划出现损失致使集合计划托管人承担连带赔偿责任的,集合计划管理人应赔偿集合计划托管人由此遭受的损失。

3. 本集合计划投资非公开发行股票,集合计划管理人应至少于投资前三个工作日向集合计划托管人提交有关书面资料,并保证向集合计划托管人提供的有关资料真实、准确、完整。有关资料如有调整,集合计划管理人应及时提供调整后的资料。上述书面资料包括但不限于:

- (1) 中国证监会批准发行非公开发行股票的批准文件。
- (2) 非公开发行股票有关发行数量、发行价格、锁定期等发行资料。
- (3) 非公开发行股票发行人与中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司签订的证券登记及服务协议。
- (4) 集合计划拟认购的数量、价格、总成本、账面价值。

4. 集合计划管理人应在本集合计划投资非公开发行股票后两个交易日内,在中国证监会规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。

本集合计划有关投资流通受限证券比例如违反有关限制规定，在合理期限内未能进行及时调整，集合计划管理人应在两个工作日内编制临时报告书，予以公告。

5. 集合计划托管人根据有关规定有权对集合计划管理人进行以下事项监督：

(1) 本集合计划投资流通受限证券时的法律法规遵守情况。

(2) 在集合计划投资流通受限证券管理工作方面有关制度、流动性风险处置预案的建立与完善情况。

(3) 有关比例限制的执行情况。

(4) 信息披露情况。

6. 相关法律法规对集合计划投资流通受限证券有新规定的，从其规定。

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

(七) 集合计划托管人发现集合计划管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《集合计划合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知集合计划管理人限期纠正。集合计划管理人应积极配合和协助集合计划托管人的监督和核查。集合计划管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给集合计划托管人发出回函，就集合计划托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，集合计划托管人有权随时对通知事项进行复查，督促集合计划管理人改正。集合计划管理人对集合计划托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，集合计划托管人应报告中国证监会。

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

(九)若集合计划托管人发现集合计划管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《集合计划合同》约定的，应当立即通知集合计划管理人，由此造成的损失由集合计划管理人承担。

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

### 三、集合计划管理人对集合计划托管人的业务核查

(一)集合计划管理人对集合计划托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括集合计划托管人安全保管集合计划财产、开设集合计划财产的资金账户和证券账户、复核集合计划管理人计算的集合计划资产净值和集合计划份额净值、根据集合计划管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督集合计划投资运作等行为。

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

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



#### 四、集合计划财产的保管

##### （一）集合计划财产保管的原则

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

##### （二）集合计划募集期间及募集资金的验资

1. 集合计划募集期间募集的资金应存于集合计划管理人开立的“集合计划募集专户”。该账户由集合计划管理人开立并管理。
2. 集合计划募集期满或集合计划停止募集时，募集的集合计划份额总额、集合计划募集金额、集合计划份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后，集合计划管理人应将属于集合计划财产的全部资金划入集合计划托管人开立的集合计划银行账户，同时在规定时间内，聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资，出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的2名或2名以上中国注册会计师签字方为有效。

3. 若集合计划募集期限届满，未能达到《集合计划合同》生效的条件，由集合计划管理人按规定办理退款等事宜。

（注：本集合计划已于2011年3月21日成立。本次为集合计划管理人根据《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》（以下简称“《指引》”）及相关公募基金监管制度要求对集合计划进行第三次合同变更。因此，本集合计划不适用本条款）

### （三）集合计划银行账户的开立和管理

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

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

3. 集合计划银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

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

### （四）集合计划证券账户和结算备付金账户的开立和管理

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

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

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

证券账户开户费由集合计划管理人先行垫付，待托管产品启始运营后，集合计划管理人可向集合计划托管人发送划款指令，将代垫开户费从本集合计划托管资金账户中扣还集合计划管理人。账户开立后，集合计划托管人应及时将证券账户开通信息通知集合计划管理人。

4. 集合计划托管人以集合计划托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的集合计划完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，集合计划管理人应予以积极协助。结算备付金、结算保证金、交收资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定以及集合计划管理人与集合计划托管人签署的《托管银行证券资金结算协议》执行。

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

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

#### （五）债券托管专户的开设和管理

《集合计划合同》生效后，集合计划管理人负责以集合计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表集合计划进行交易；集合计划托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定，在银行间市场登记结算机构开立债券托管账户，持有人账户和资金结算账户，并代表集合计划进行银行间市场债券的结算。集合计划管理人和集合计划托管人共同代表集合计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

#### （六）其他账户的开立和管理

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

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （七）集合计划财产投资的有关有价凭证等的保管

集合计划财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由集合计划托管人存放于集合计划托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司/北京分公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由集合计划托管人持有。实物证券、银行定

期存款证实书等有价凭证的购买和转让,按集合计划管理人和集合计划托管人双方约定办理。集合计划托管人对由集合计划托管人以外机构实际有效控制或保管的资产不承担任何责任。

#### (八) 与集合计划财产有关的重大合同的保管

与集合计划财产有关的重大合同的签署,由集合计划管理人负责。由集合计划管理人代表集合计划签署的、与集合计划财产有关的重大合同的原件分别由集合计划管理人、集合计划托管人保管。除本协议另有规定外,集合计划管理人代表集合计划签署的与集合计划财产有关的重大合同包括但不限于集合计划年度审计合同、集合计划信息披露协议及集合计划投资业务中产生的重大合同,集合计划管理人应保证集合计划管理人和集合计划托管人至少各持有一份正本的原件。集合计划管理人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给集合计划托管人,并在三十个工作日内将正本送达集合计划托管人处。重大合同的保管期限为《集合计划合同》终止后15年。

### 五、集合计划资产净值计算与复核

#### (一) 集合计划资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

1. 集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的金额。集合计划份额净值是按照每个交易日闭市后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,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,小数点后第五位四舍五入。集合计划管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的,从其规定。

每个交易日及国家法律法规规定需要对外披露集合计划净值的非交易日计算集合计划资产净值及集合计划份额净值,并按规定公告。

2. 集合计划管理人应在每个本集合计划相关的证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露集合计划净值的非交易日对集合计划资产估值。但集合计划管理人根据法律法规或《集合计划合同》的规定暂停估值时除外。集合计划管理人每个交易日对集合计划资产估值后,将集合计划份额净值结果发送集合计划托管人,经集合计划托管人复核无误后,由集合计划管理人对外公布。T日的集合计划份额净值在T日计算,并在T+1日进行公告。

#### (二) 集合计划资产估值方法和特殊情形的处理

## 1. 估值对象

本集合计划所拥有的股票、债券、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。

## 2. 估值方法

### (1) 证券交易所上市的有价证券的估值

①交易所上市的有价证券，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；

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；

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或未挂牌转让的股票、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；

④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，按成本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。

(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) 同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。

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

(6) 股指期货合约一般以估值日的结算价估值。估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的，从其规定。

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

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

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

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

### (三) 集合计划份额净值错误的处理方式

1. 当集合计划份额净值小数点后4位以内(含第4位)发生差错时,视为集合计划份额净值错误;集合计划份额净值出现错误时,集合计划管理人应当立即予以纠正,通报集合计划托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大;错误偏差达到集合计划份额净值的0.25%时,集合计划管理人应当通报集合计划托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到集合计划份额净值的0.5%时,集合计划管理人应当公告,并报中国证监会备案;当发生净值计算错误时,由集合计划管理人负责处理,由此给集合计划份额持有人和集合计划造成损失的,应由集合计划管理人先行赔付,集合计划管理人按差错情形,有权向其他当事人追偿。

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

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

(2) 若集合计划管理人计算的集合计划份额净值已由集合计划托管人复核确认后公告,而且集合计划托管人未对计算过程提出疑义或要求集合计划管理人书面说明,集合计划份额净值出错且造成集合计划份额持有人损失的,应根据法律法规的规定对投资者或集合计划支付赔偿金,就实际向投资者或集合计划支付的赔偿金额,集合计划管理人与集合计划托管人按照管理费和托管费的比例各自承担相应的责任。

(3) 如集合计划管理人和集合计划托管人对集合计划份额净值的计算结果,虽然多次重新计算和核对,尚不能达成一致时,为避免不能按时公布集合计划份

额净值的情形，以集合计划管理人的计算结果对外公布，由此给集合计划份额持有人和集合计划造成的损失，由集合计划管理人负责赔付。

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

3. 由于证券/期货交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，集合计划管理人和集合计划托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划份额净值计算错误，集合计划管理人、集合计划托管人免除赔偿责任。但集合计划管理人、集合计划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。

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

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

#### （四）暂停估值与公告集合计划份额净值的情形

1. 集合计划投资所涉及的证券交易市场遇非工作日或因其他原因暂停营业时；

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

3. 当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，经与集合计划托管人协商确认后，集合计划管理人应当暂停估值；

4. 中国证监会和《集合计划合同》认定的其他情形。

#### （五）集合计划会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### （六）集合计划账册的建立

集合计划管理人进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告。集合计划管理人、托管人分别独立地设置、记录和保管本集合计划的全套账册。若集



合计划管理人和集合计划托管人对会计处理方法存在分歧,应以集合计划管理人的处理方法为准。若当日核对不符,暂时无法查找到错账的原因而影响到集合计划资产净值的计算和公告的,以集合计划管理人的账册为准。

#### (七) 集合计划财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

集合计划财务报表由集合计划管理人编制,集合计划托管人复核。

##### 2. 报表复核

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

##### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

###### (1) 报表的编制

集合计划管理人应当在每月结束后5个工作日内完成月度报表的编制;在季度结束之日起15个工作日内完成集合计划季度报告的编制;在上半年结束之日起两个月内完成集合计划中期报告的编制;在每年结束之日起三个月内完成集合计划年度报告的编制。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务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,集合计划管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

###### (2) 报表的复核

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

集合计划管理人应留足充分的时间,便于集合计划托管人复核相关报表及报告。

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

## 五、集合计划持有人名册的登记与保管

集合计划份额持有人名册至少应包括集合计划份额持有人的名称和持有的集合计划份额。集合计划份额持有人名册由集合计划登记机构根据集合计划管理

人的指令编制和保管，集合计划管理人和集合计划托管人应分别保管集合计划份额持有人名册，保存期不少于15年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

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

## 六、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权向管理人所在地人民法院提起诉讼。

争议处理期间，双方当事人应恪守集合计划管理人和集合计划托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行《集合计划合同》和本托管协议规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 七、托管协议的修改与终止

### （一）托管协议的变更程序

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

### （二）托管协议终止的情形

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

## 第二十一部分 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）交易资料的确认服务

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

### （二）客服电话服务

申万宏源证券客服电话人工座席每个交易日（9：00-17：00）为集合计划投资人提供服务，客服热线服务内容包括业务咨询、服务投诉等专项服务。

客服热线：95523

### （三）电子查询服务

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

官方网站：www.swhysc.com

### （四）投诉受理服务

集合计划投资者可以拨打申万宏源证券客服电话，对集合计划管理人和管理人及其子公司的销售网点所提供的服务进行投诉。

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

### （五）请确保投资前，您/贵机构已经全面理解了本招募说明书。

---

---

## 第二十二部分 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。

---

---

## 第二十三部分 备查文件

- （一）中国证监会准予宏源证券宏源3号红利成长集合资产管理计划变更为申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划的文件
- （二）申万宏源红利成长灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同
- （三）申万宏源红利成长灵活配置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。

申万宏源证券有限公司

二〇二二年 月 日