

华鑫证券有限责任公司

华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划 更新招募说明书 (2022年第2号)

管理人：华鑫证券有限责任公司

托管人：上海银行股份有限公司

重要提示

华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）由华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划变更而来，华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划由管理人依照《中华人民共和国合同法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《证券公司客户资产管理业务规范》等有关法律法规、《华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划资产管理合同》、《华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划说明书》及其他有关规定募集，并经中国证券业协会备案。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 30 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会 2021 年 6 月 23 日《关于准予华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2021〕1957 号）批准，《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》自 2021 年 8 月 3 日起生效，原《华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会批准，但中国证监会对华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划变更为本集合计划的批准，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。

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

投资有风险，投资者在投资本集合计划之前，请仔细阅读本集合计划的招募说明书、集合计划合同、集合计划产品资料概要等信息披露文件，全面认识本集合计划的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

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

当本集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，管理人履行相应程序后，可以启动侧袋机制，具体详见集合计划合同和本招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间，管理人将对基金简称进行特殊标识，并不办理侧袋账户的申购赎回。请集合计划份额持有人仔细阅读相关内容并关注本集合计划启用侧袋机制时的特定风险。

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

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

本集合计划的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本集合计划为债券型集合计划，其风险收益水平低于股票型集合计划和混合型集合计划，高于货币市场型集合计划，属于中低风险/收益的产品。

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。

本招募说明书所载内容更新内容截止日为 2022 年 5 月 6 日。本次更新事项：更新管理人董事会成员、监事会、高级管理人员信息及托管人信息。

目 录

重要提示.....	2
第一部分 绪言.....	6
第二部分 释义.....	7
第三部分 管理人.....	13
第四部分 托管人.....	24
第五部分 相关服务机构.....	28
第六部分 集合计划的历史沿革.....	30
第七部分 集合计划的存续.....	31
第八部分 集合计划份额的申购与赎回.....	32
第九部分 集合计划的投资.....	42
第十部分 集合计划的财产.....	49
第十一部分 集合计划资产估值.....	50
第十二部分 集合计划费用与税收.....	56
第十三部分 集合计划的会计与审计.....	59
第十四部分 集合计划的收益与分配.....	60
第十五部分 集合计划的信息披露.....	62
第十六部分 侧袋机制.....	68
第十七部分 风险揭示.....	71
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.....	76
第十九部分 集合计划合同的内容摘要.....	79
第二十部分 集合计划托管协议的内容摘要.....	96
第二十一部分 对集合计划份额持有人的服务.....	108
第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	110
第二十三部分 备查文件.....	111

第一部分 绪言

《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合计划合同”或“《集合计划合同》”）编写。

本招募说明书阐述了华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读招募说明书。

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

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

投资者欲了解集合计划份额持有人的权利和义务，应详细查阅集合计划合同。

第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合资产管理计划：指华鑫证券有限责任公司已通过监管机构验收的、对标公募基金投资运作的、投资者人数不受 200 人限制的集合资产管理计划

2、集合计划或本集合计划：指华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划

3、管理人：指华鑫证券有限责任公司

4、托管人：指上海银行股份有限公司

5、集合计划合同、《集合计划合同》：指《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》及对集合计划合同的任何有效修订和补充

6、托管协议：指管理人与托管人就本集合计划签订之《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

7、招募说明书或本招募说明书：指《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

8、集合计划产品资料概要：指《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划集合计划产品资料概要》及其更新

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

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

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

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

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

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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于集合资产管理计划的自然人

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

20、合格境外机构投资者：指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的集合资产管理计划的中国境外的机构投资者

21、人民币合格境外机构投资者：指按照《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

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

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

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

25、销售机构：指华鑫证券有限责任公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与管理人签订了集合计划销售服务协议，办理集合计划销售业务的机构

26、登记业务：指集合计划登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括

投资人集合计划账户的建立和管理、集合计划份额登记、集合计划销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管集合计划份额持有人名册和办理非交易过户等

27、**登记机构**：指办理登记业务的机构。本集合计划的登记机构为华鑫证券有限责任公司

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

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

30、**集合计划合同生效日**：指《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》的生效日，原《华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效

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

32、**存续期**：指《华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划资产管理合同》生效至集合计划合同终止之间的不定期期限

33、**工作日**：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、**T 日**：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

35、**T+n 日**：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

36、**开放期**：本集合计划可根据实际情况依法决定本集合计划开始办理申购的具体日期，之后本集合计划将每周开放集中申购。首个开放期详见管理人的公告，第二个开放期为首个开放期 1 周后的对应日（指自然周），如该对应日为非工作日，则管理人可以选择顺延、提前或暂停开放，详见管理人的公告。每个开放期不少于一个工作日、不超过二个工作日，开放期的具体时间以管理人届时公告为准

37、**运作期起始日**：对于每份持有华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划份额至集合计划合同生效日的份额的第一个运作期起始日，指集合计划合同生效日；对于每份申购份额的第一个运作期起始日，指该集合计划份额申购确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份集合计划份额的下一运作期起始日，指该集合计划份额上一运作期到期日后的下一日

38、运作期到期日：对于每份集合计划份额，第一个运作期到期日指集合计划合同生效日（对持有华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划份额至集合计划合同生效日的份额而言，下同）或集合计划份额申购申请日（对申购份额而言，下同）91 个自然日（13 周）后的对应日（指自然日，如该对应日为非工作日，则顺延到下一工作日），第二个运作期到期日为集合计划合同生效日或集合计划份额申购申请日 182 个自然日（26 周）后的对应日（指自然日，如该日为非工作日，则顺延至下一工作日），以此类推

39、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，开放期内集中办理申购的日期及办理赎回的运作期到期日均为本集合计划的开放日

40、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

41、《业务规则》：指本集合计划登记机构办理登记业务的相应规则，是规范管理人所管理的集合资产管理计划登记方面的业务规则，由管理人和投资人共同遵守

42、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

43、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

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

45、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

46、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

47、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）超过上一工作日集合计划总份额的 20%

48、元：指人民币元

49、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

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

51、集合计划资产净值：指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值

52、集合计划份额净值：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

53、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

54、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

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

56、集合计划份额类别：指根据申购费用、销售服务费收取方式的不同将份额分为不同的类别，各集合计划份额类别代码不同，集合计划份额净值和集合计划份额累计净值或有不同

57、A类份额：指投资人在申购集合计划时收取申购费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别集合计划资产中计提销售服务费的份额

58、C类份额：指投资人在申购集合计划时不收取申购费，而是从本类别集合计划资产中计提销售服务费，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的份额

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

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

61、侧袋机制：指将集合计划投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于

流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户

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

63、不可抗力：指集合计划合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

第三部分 管理人

一、管理人概况

名称：华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房

法定代表人：俞洋

成立日期：2001 年 3 月 6 日

批准设立机关及批准设立文号：证监机构字[2001]34 号

组织形式： 有限责任公司

注册资本：36 亿

存续期限：持续经营

股东名称及持股比例：上海华鑫股份有限公司、100%

联系人：卢楠

联系电话：021-54967562

二、主要人员情况

1、董事会成员

俞洋先生，汉族，1970 年 5 月出生，中共党员，本科学历、硕士学位，高级理财规划师，1988 年 11 月参加工作，曾任常州市证券公司计划部总经理、延陵东路营业部总经理，巨田证券有限责任公司无锡营业部总经理，东海证券有限责任公司常州延陵中路营业部兼常州地区中心营业部总经理，华鑫证券有限责任公司总经理助理、副总经理兼上海分公司总经理、总经理、财务负责人，华鑫期货有限公司董事，华鑫证券投资有限公司董事，摩根士丹利华鑫证券有限责任公司董事长、董事，华鑫思佰益融资租赁（上海）有限公司董事。现任上海华鑫股份有限公司总经理、董事，华鑫证券有限责任公司董事长，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司非独立董事、副董事长。

沈巍先生，汉族，1967 年 7 月出生，本科、EMBA，高级政工师，中共党员，1989 年 7 月参加工作。先后担任上海灯泡厂显象管车间团委书记（主持工作），上海真空电子器件股份有限公司团委书记、书记，上海海燕无线电厂副厂长，上海广电信息产业股份有限公司党委书记助理，上海广电（集团）有限公司党委办公室主任、宣

传部部长，上海广电资产经营管理有限公司党委副书记、纪委书记、工会主席，上海仪电资产经营管理（集团）有限公司党委副书记、纪委书记、工会主席，上海仪电（集团）有限公司党委组织部部长、干部部副部长、老干部办公室主任、本部党委副书记、纪委专职委员。现任华鑫证券有限责任公司党委书记、董事，上海华鑫股份有限公司党委书记、董事，上海金欣联合发展有限公司监事、监事会主席。

陈海东先生，汉族，1974年10月出生，中共党员，南开大学经济学学士，上海财经大学经济学硕士，高级经济师。1996年参加工作，曾任天津市住房公积金管理中心会计主管，厦门国际信托投资公司天津证券营业部业务主管，天同证券有限责任公司清算经理，兴安证券有限责任公司资产管理总部副总经理，华鑫证券有限责任公司计划财务部副总经理、存管中心总经理、合规稽核部总经理、华鑫证券有限责任公司副总经理、合规总监、首席风险官、董事会秘书、华鑫证券投资有限公司董事会秘书、华鑫证券有限责任公司常务副总经理（主持工作），摩根士丹利华鑫证券有限责任公司监事会主席，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监事，摩根士丹利华鑫证券有限责任公司董事。现任华鑫证券有限责任公司总经理、投资银行业务委员会主任、财务负责人、董事，华鑫期货有限公司董事。

刘绫女士，1969年11月出生，中共党员，本科学历、硕士学位，高级经济师，1989年7月参加工作，曾任中国建设银行长宁支行营业部主任、信贷科副科长，华鑫证券有限责任公司计划财务部职员，华鑫证券有限责任公司资金计划部职员，华鑫证券有限责任公司客户资产存管中心部门总经理助理，华鑫证券有限责任公司客户资产存管中心部门总经理，华鑫证券有限责任公司投资管理部部门总经理，华鑫证券有限责任公司自营分公司总经理，华鑫证券有限责任公司工会主席、党群工作部部长，上海华鑫股份有限公司职工监事、工会主席。现任华鑫证券有限责任公司董事、党委副书记、人力资源部总经理、党委组织部部长、总裁办公室主任，上海华鑫股份有限公司人力资源部总经理、党委组织部部长、综合事务部总经理，华鑫期货有限公司董事。

陈慧谷（HUI GU CHEN）先生，汉族，1965年1月出生，华东政法学院民法专业硕士研究生，同济大学经济管理学院管理专业博士研究生学位，1998年8月参加工作，先后在中国社会科学院任法学编辑，中国寰岛集团有限公司发展战略部任总经理，海南港澳国际信托投资公司任副总经理，中金投资集团有限公司任副总裁，第一证券有限公司任总裁，中金资本投资有限公司任总裁，上海秋枫投资管理有限公司任

总裁。现任上海天泽金牛资本管理股份有限公司总裁，海南中和药业股份有限公司独立董事，华鑫证券有限责任公司独立董事。

万波先生，汉族，1979年10月出生，中共党员，同济大学法学学士学位，复旦大学金融学硕士，擅长银行及金融业务，曾代理各类金融机构参与大量投融资项目的结构设计、商业谈判、尽职调查、文件起草、出具法律意见等工作。万波先生于2002年参加工作，曾先后任工商银行上海市分行业务经理，上海前和律师事务所律师助理，上海市金茂律师事务所律师。现为上海市金茂律师事务所合伙人律师，华东政法大学兼职教授，最高人民检察院民事行政公益诉讼监督案件咨询专家，上海市律师协会融资租赁业务研究委员会副主任，中国服务贸易协会专家委员会理事，上海市租赁行业协会特聘专家，上海市商业保理同业公会副会长，上海浦东商业保理行业协会副会长，海南国际仲裁院仲裁员，上海仲裁委员会仲裁员，华鑫证券有限责任公司独立董事。

刘凤委先生，汉族，1975年1月出生，中共党员，研究生学历、博士学位，教授。1998年7月参加工作，曾任西南财经大学教务处科员。现任上海国家会计学院会计系主任、教授，华鑫证券股份有限公司独立董事，上海仁会生物制药股份有限公司独立董事，上海美农生物科技股份有限公司独立董事，四川长虹集团财务有限公司独立董事，华鑫证券有限责任公司独立董事。

管一民先生，汉族，1950年4月出生，中共党员，本科学历、学士学位，教授。1983年2月参加工作，曾任上海财经大学会计系助教、讲师，上海财经大学成人教育学院副教授、教授、副院长，上海财经大学教授、校长助理，上海国家会计学院教授、副院长。现任上海复星医药（集团）股份有限公司外部监事，益海嘉里金龙鱼粮油食品股份有限公司独立董事，上海华谊集团股份有限公司独立董事，沈阳荣科科技股份有限公司独立董事、合肥杰事杰新材料股份有限公司独立董事，华鑫证券有限责任公司独立董事。

2、监事会

胡之奎先生，1965年5月生，本科学历，硕士学位，中共党员，高级经济师。1986年7月参加工作，曾任上海科技大学材料科学与工程系助教，上海交通大学校团委宣传部部长，上海真空电子器件股份有限公司下属显像管玻璃厂技术科科长，上海真空电子器件股份有限公司投资规划部科员、派驻上海润丰国际商品期货公司客户代表、总经理办公室主任助理、董事会秘书兼董办主任，上海金陵股份有限公司董事

会秘书兼董事会办公室主任。现任上海华鑫股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任，华鑫证券有限责任公司监事、监事会主席。

周昌娥女士，1980年6月生，大学本科，硕士学位，中共党员，高级会计师，曾任华鑫证券漕宝路证券营业部财务，华鑫证券计划财务部综合会计、华鑫证券计划财务部总经理助理、副总经理；现任华鑫证券有限责任公司监事、财务副总监、财务管理总部总经理，华鑫期货有限公司监事，华鑫宽众投资有限公司监事。

裴晨艳女士，1972年10月出生，中共党员，研究生学历、硕士学位，高级经济师、高级理财规划师、企业法律顾问。1994年7月参加工作，曾任中共丹阳市委政策研究室秘书，中共丹阳市委办公室秘书科副科长、科长，华鑫证券海宁路、斜土路证券营业部经理助理，华鑫证券总裁办公室机要秘书，华鑫证券总裁办公室主任助理，华鑫证券总裁办公室副主任，华鑫证券上海分公司办公室负责人。现任华鑫证券有限责任公司监事、总经理助理、督导、法律事务部主任，华鑫宽众投资有限公司董事、董事长。

吴云女士，1970年7月出生，本科学历，硕士学位，中共党员，高级理财规划师，1988年7月参加工作，曾任中国农业银行漕河泾支行营业部财务核算，上海浦东联合信托有限责任公司漕宝路营业部财务核算，华鑫证券有限责任公司漕宝路营业部财务核算、计划财务部财务核算、合规稽核部督导、漕宝路营业部副总经理、客户资产存管中心总经理。现任华鑫证券有限责任公司职工监事、工会主席、运营管理中心总经理。

卜健先生，1971年6月出生，本科学历，硕士学位，中共党员，1992年7月参加工作，先后中国农业银行上海市信托投资公司证券发行部职员、监察审计部职员、信贷管理部职员，中国农业银行上海市分行证券管理部管理员，华鑫证券有限责任公司上海武宁路证券营业部财务经理，华鑫证券有限责任公司稽核监察部稽核经理，华鑫证券有限责任公司稽核风控部风控主管、总经理助理，合规稽核部副总经理，华鑫证券有限责任公司合规稽核部总经理，华鑫证券有限责任公司董事会办公室主任。现任华鑫证券有限责任公司职工监事、纪委副书记、总经理助理、合规副总监及合规与风险管理总部总经理，华鑫宽众投资有限公司监事，华鑫证券投资咨询有限公司监事，上海华鑫股份有限公司职工监事。

3、高级管理人员

陈海东先生，汉族，1974年10月出生，中共党员，南开大学经济学学士，上海财经大学经济学硕士，高级经济师。1996年参加工作，曾任天津市住房公积金管理中心会计主管，厦门国际信托投资公司天津证券营业部业务主管，天同证券有限责任公司清算经理，兴安证券有限责任公司资产管理总部副总经理，华鑫证券有限责任公司计划财务部副总经理、存管中心总经理、合规稽核部总经理、华鑫证券有限责任公司副总经理、合规总监、首席风险官、董事会秘书、华鑫证券投资有限公司董事会秘书、华鑫证券有限责任公司常务副总经理（主持工作），摩根士丹利华鑫证券有限责任公司监事会主席，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司监事，摩根士丹利华鑫证券有限责任公司董事。现任华鑫证券有限责任公司总经理、投资银行业务委员会主任、财务负责人、董事，华鑫期货有限公司董事。

吴钧先生，汉族，1972年9月生，本科学历，中共党员。1993年8月参加工作，先后在兵器工业总公司南京528厂，江苏省联合信托投资公司南京城东证券营业部电脑部，江苏证监局工作，曾经任江苏证监局机构监管处副主任科员、稽查处主任科员、副处长，挂职天津证监局任机构处副处长，江苏省证券业协会专职秘书长（证监局委派，正处级调研员），期货处调研员（主持工作），期货处、法制处调研员，华宝证券风险合规部负责人，华鑫证券有限责任公司总经理助理，华鑫证券有限责任公司董事会秘书，华鑫证券有限责任公司董办主任、稽核审计部总经理，华鑫期货有限公司监事会主席，摩根士丹利华鑫证券有限责任公司监事会主席。现任华鑫证券有限责任公司合规总监、首席风险官、纪委副书记，华鑫证券投资有限公司董事。

何晓斌先生，汉族，1962年11月生，中共党员，博士研究生学历，高级经济师，享受国务院特殊津贴。曾就职于上海市计划委员会，先后在国土办/综合处工作，曾任上海市计委系统团委书记，上海市计委物资能源处副处长，上海市证管办期货部主任，中国证监会上海证监局期货监管处处长，国泰君安证券股份有限公司总裁办主任、大企业战略合作部总经理，国泰君安证券股份有限公司董事会秘书、董事会秘书处主任，国泰君安投资管理有限公司副董事长、总裁，国泰君安期货有限公司总裁、副董事长，国泰君安期货有限公司董事长，华鑫证券有限责任公司上海自营分公司总经理，华鑫期货有限公司监事会主席，华鑫证券投资有限公司董事，华鑫期货有限公司董事、董事长。现任华鑫证券有限责任公司副总经理、首席经济学家。

王习平先生，汉族，1972年9月出生，本科学历，硕士学位，九三学社，上海市国资委系统知联会会员。曾任建行枣庄分行对公开发组长，华夏银行济南分行科技

处运行开发部经理，复旦金仕达金融事业部项目经理、研发高级经理和技术副总监，上海期货信息技术公司资深项目经理、研发部门经理、总经理助理和副总经理，上海期货交易所总监，上海期货信息技术有限公司总经理，华鑫期货有限公司董事。现任华鑫证券有限责任公司副总经理、首席信息官、经纪业务管理委员会主任、IT 总监，摩根士丹利华鑫基金管理有限公司董事。

冯晓东先生，1974 年 1 月生，汉族，中共党员，大学本科学历，硕士学位。1997 年 8 月参加工作，先后在中国人民银行江苏省分行非银行金融机构监管处，江苏省证券管理办公室任综合处工作，曾任江苏证监局证券机构监管处科员、副主任科员、主任科员、副处长，江苏证监局上市公司监管处副处长、调研员、调研员（主持工作），新疆证监局机构监管处挂职副处长（挂职），江苏省涟水县挂职县委常委、副县长（挂职），上海恺讯企业管理咨询有限公司总裁助理，华鑫证券有限责任公司销售交易部总经理。现任华鑫证券有限责任公司副总经理、董事会秘书、董事会办公室主任、稽核审计部总经理。

王祖民先生，1970 年 3 月生，汉族，上海人，中共党员，硕士研究生学历，硕士学位。1990 年 7 月参加工作，先后在上海县航运公司任会计师，上海味利皇食品有限公司任财务经理，上海斯米克建筑陶瓷有限公司任财务主管，远纺工业（上海）有限公司任会计经理、稽核部经理，复星医药集团股份有限公司任审计评估部总经理，复星高科技集团有限公司任总裁助理兼审计部总经理，德邦证券股份有限公司任副总裁兼财务总监，复星高科技集团有限公司任风险管理部总经理，上海华鑫股份有限公司任财务管理部总经理，上海全创信息科技有限公司任董事，烟台山基金小镇（烟台）运营管理有限公司任董事、董事长。现任华鑫期货有限公司董事、董事长，华鑫证券有限责任公司副总经理、自营分公司总经理、销售交易部总经理、固定收益总部总经理。

胡映璐先生，1971 年 12 月生，汉族，大学本科学历，学士学位，中共党员。1993 年 7 月参加工作，先后在中铁进出口公司、深圳金世纪投资发展有限公司从事进出口及投资管理工作，深圳邦信投资发展有限公司从事投资管理工作，招商证券股份有限公司从事投资银行工作，深业集团深圳东欧集团公司从事资产管理工作，中山证券有限责任公司任研究所副经理、投资银行部副总经理、总经理、投资银行管理委员会副主任、副总裁、总裁，曾任中国证券业协会绿色证券专业委员会委员、上海证券交易所债券发展委员会委员、深圳证券业协会投资银行业务专业委员会委员。现任华鑫证

券有限责任公司副总经理，资产管理部、战略客户部分管领导。。

冯葆先生，1971年5月出生，汉族，硕士研究生学历，硕士学位，群众。1996年1月参加工作。先后在君安证券有限责任公司任上海投行部高级经理，联合证券有限责任公司任上海投行部总经理助理，西部证券有限责任公司任上海投行部总经理，爱建证券有限责任公司任投资银行总部总经理，财富证券有限责任公司上海投行部任投资银行总部总经理，财富里昂证券有限责任公司任投行部执行董事，华鑫证券有限责任公司任投资银行总部投行主管，摩根士丹利华鑫证券有限责任公司任投资银行部投行执行董事，上海华信证券有限责任公司任总裁助理，华宝证券股份有限公司任副总裁。现任华鑫证券有限责任公司副总经理。

4、本集合计划的投资经理

(1)徐鹏先生 2007年毕业于同济大学电路与系统专业，获得工学硕士学位，2016年2月成为CFA持证人。

徐鹏先生于2007年4月至2011年7月先后任职于科胜讯宽带通讯(上海)有限公司、恩智浦半导体(上海)有限公司、泰鼎多媒体技术(上海)有限公司等跨国半导体企业，担任高级工程师、项目组负责人。2011年8月至2013年5月任职于易唯思商务咨询(上海)有限公司，担任分析师。

徐鹏先生于2013年6月至今任职于华鑫证券，2013年6月至2020年3月先后担任研究发展部高级研究员、研究发展部副总经理、资产管理部所属创新投资部负责人，现任华鑫证券资产管理部大集合投资经理。

(2)王晗先生，中国人民大学金融学硕士，现任华鑫证券有限责任公司资产管理部固定收益负责人，曾任兴证证券资产管理有限公司研究员、投资经理，中融国际信托有限公司高级经理，在固定收益领域具有丰富的投资和研究经验。现任华鑫证券资产管理部大集合投资经理。

5、公募资产管理业务投资决策小组

陈辛润，华鑫证券资产管理部总经理

王晗，华鑫证券资产管理部所属固定收益部负责人

徐鹏，华鑫证券资产管理部所属创新投资部负责人

钱超玉，华鑫证券资产管理部合规风控经理

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、管理人的职责

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

2、办理集合计划备案手续；

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

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

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

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

7、依法接受托管人的监督；

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

9、进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

15、依据《基金法》、《集合计划合同》及其他有关规定召集集合计划份额持有

人大会或配合托管人、集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；

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

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

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

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

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

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

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

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

24、执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

25、建立并保存集合计划份额持有人名册；

26、法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他义务。

四、管理人承诺

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

2、管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《信息披露办法》、《运作办法》、《销售办法》及有关法律法规，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止以下行为发生：

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资；

-
-
- (2) 不公平地对待管理人管理的不同集合资产管理计划财产；
 - (3) 利用集合计划财产或者职务之便为集合计划份额持有人以外的第三人牟取利益；
 - (4) 向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
 - (5) 侵占、挪用集合计划财产；
 - (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
 - (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
 - (8) 法律法规或中国证监会禁止的其他行为。

3、集合计划投资经理承诺

- (1) 依照有关法律、法规和集合计划合同的规定，本着谨慎的原则为集合计划份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不能利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者谋取利益；
- (3) 不违反现行有效的有关法律法规、规章、集合计划合同和中国证监会的有关规定，不泄露在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密，尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息，或利用该信息从事或明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (4) 不协助、接受委托或以其它任何形式为其它组织或个人进行证券交易；
- (5) 不从事损害集合计划资产和集合计划份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、管理人的内部控制制度

1、内部控制制度概述

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

内部控制制度是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是公司各项基本管理制度的纲要和总揽，贯穿公司运营的所有环节，其内容包括公司内控目标、内控原则、控制环境、内控措施等。

2、内部控制目标

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

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

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

(4) 确保公司业务记录、财务信息和其它信息真实、准确、完整、及时。

(5) 保证公司内部规章制度的贯彻执行，提高公司经营效益。

3、内部控制原则

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

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

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

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

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

4、控制环境

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

5、内控措施

公司建立科学严密的风险控制评估体系，通过定期与不定期风险评估，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，发现风险来源和类型，及时防范和化解风险。

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

6、管理人关于内部控制的声明

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

第四部分 托管人

一、托管人情况

(一) 托管人简况

名称：上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

法定代表人：金煜

成立时间：1995 年 12 月 29 日

组织形式：股份有限公司（中外合资、上市）

注册资本：人民币 142.065287 亿元

存续期间：持续经营

基金托管业务批准文号：中国证监会 证监许可[2009]814 号

托管部门联系人：周直毅

电话：021—68475608

传真：021—68476936

上海银行股份有限公司（以下简称“上海银行”）成立于 1995 年 12 月 29 日，总部位于上海，是上海证券交易所主板上市公司，股票代码 601229。

上海银行以“精品银行”为战略愿景，以“精诚至上，信义立行”为核心价值观，近年来通过推进专业化经营和精细化管理，服务能级不断增强，普惠金融、供应链金融、科创金融、绿色金融、民生金融、投资银行、交易银行、跨境银行、金融市场、消费金融、养老金融、在线金融等特色逐步显现。近年来，上海银行把握金融科技趋势，以更智慧、更专业的服务，不断满足企业和个人客户日趋多样化的金融服务需求。

上海银行主动对接国家战略和上海“三大任务、一大平台”，发挥协同作用，提升区域服务能级；深化服务实体经济，加大小微信贷投放力度，搭建普惠金融线上模

式,形成了以“上行 e 链”为核心的供应链金融体系;将零售业务作为“重中之重”,从客户经营、基础支撑、生态建设等方面打造零售经营体系;开展数字化转型,以端到端的思维、全旅程的理念、颠覆式创新思维,推进科技与业务深度融合;稳健经营,规范管理,着力提升风险经营管理能力。

上海银行目前在上海、北京、深圳、天津、成都、宁波、南京、杭州、苏州、无锡、绍兴、南通、常州、盐城、温州等城市设立分支机构,形成长三角、京津冀、粤港澳大湾区和中西部重点城市的布局框架;发起设立四家村镇银行、上银基金管理有限公司、上海尚诚消费金融股份有限公司,设立境外子公司上海银行(香港)有限公司,并通过其设立了境外投行机构上银国际有限公司。

上海银行自成立以来市场影响力不断提升,截至 2021 年末,上海银行总资产 26531.99 亿元,较上年末增长 7.76%;实现营业收入 562.30 亿元,同比增长 10.81%;归属于母公司股东的净利润 220.42 亿元,同比增长 5.54%。在英国《银行家》杂志 2021 年公布的全球银行 1000 强榜单中,按一级资本位列第 67 位,较去年上升 6 位。

(二) 主要人员情况

上海银行总行下设资产托管部,是从事资产托管业务的职能部门,内设托管产品部、托管运作部、行管运作部(内设系统管理团队)、稽核监督部,100%员工拥有大学本科及以上学历,业务岗位人员均具有基金从业资格。

(三) 基金托管业务经营情况

上海银行于 2009 年 8 月 18 日获得中国证监会、中国银监会核准开办证券投资基金托管业务,批准文号:中国证监会证监许可[2009]814 号。

近年来,上海银行顺应市场发展趋势和监管导向,持续深化业务转型,把握市场热点,积极拓展公募基金、银行理财、保险、资产证券化四大重点细分市场,大力提升同业托管竞争力,保险托管规模突破 1200 亿元,公募基金托管规模突破 2100 亿元。同时,上海银行持续探索并积极推进托管产品创新,为包括基金公司、证券公司、信托公司、商业银行、保险公司、期货公司和私募投资机构等各类机构提供资产托管服务,形成了托管产品及服务多元化发展的格局,资产托管规模超过 2.4 万亿元,其中同业机构托管规模超过 1.5 万亿元。

截至 2022 年 3 月末,上海银行托管的公募证券投资基金已达 118 只,产品类型涵盖了股票型、债券型、货币型、指数型、ETF、QDII 等,基金资产净值规模合计约 2177 亿元。

二、托管人的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关法律法规、行业监管规章和上海银行有关规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

上海银行基金托管业务内部风险控制组织结构是由总行风险管理部门和资产托管部共同组成。托管业务风险控制纳入全行的风险管理体系；资产托管部配备专职人员负责托管业务内控稽核工作，各业务部室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部控制的原则

(1) 全面性原则：监督制约必须渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖到资产托管部所有的部室、岗位和人员。

(2) 独立性原则：资产托管部内设独立的稽核监督团队，保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3) 相互制约原则：各业务部室在内部组织结构上形成相互制约，建立不同岗位之间的制衡体系。

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

(5) 有效性原则：内部控制体系应与所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正。

4、内部控制制度及措施

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

(2) 建立托管业务前后台分离，不同岗位相互牵制的管理结构。

(3) 专门的稽核监督人员组织各业务部室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4) 托管业务操作间实施门禁管理和音像监控。

(5) 定期开展业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6) 制定完备的应急预案，并组织员工定期演练；建立异地灾备，保证业务连续不中断。

三、托管人对管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

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

托管人发现管理人有违反法律法规和基金合同的行为，应及时以书面形式通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对托管人发出回函。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。

托管人发现管理人有重大违规行为，立即报告中国证监会，同时，通知管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

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

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

第五部分 相关服务机构

一、集合计划销售机构

1、销售机构

名称：华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房

法定代表人：俞洋

设立日期：2001 年 3 月 6 日

批准设立机关及批准设立文号：证监机构字[2001]34 号

组织形式： 有限责任公司

注册资本：36 亿

存续期限：持续经营

联系人：卢楠

联系电话：021-54967562

2、其他销售机构

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，将在管理人网站公示。

二、集合计划登记机构

名称：华鑫证券有限责任公司

住所：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房

法定代表人：俞洋

设立日期：2001 年 3 月 6 日

批准设立机关及批准设立文号：证监机构字[2001]34 号

组织形式： 有限责任公司

注册资本：36 亿

存续期限：持续经营

联系人：郭毅

联系电话：021-54967233

三、出具法律意见的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

经办律师：黎明、陆奇

四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市黄浦区南京东路61号四楼

办公地址：上海市黄浦区南京东路61号四楼

执行事务合伙人：杨志国、朱建弟

电话：021-23280000

传真：无

联系人：吴琼

经办注册会计师：刘梦娴

第六部分 集合计划的历史沿革

华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划由华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划变更而来。

华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划，于 2013 年 4 月 15 日开始募集，2013 年 5 月 17 日成立，2013 年 5 月 31 日取得《关于华鑫证券有限责任公司发起设立华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函【2013】524 号）。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 30 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号）的规定，华鑫证券鑫财富乐享 2 号集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，《华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》自集合计划管理人公布的生效之日起生效，原《华鑫证券鑫财富乐享 2 号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

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

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

第八部分 集合计划份额的申购与赎回

一、申购和赎回场所

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

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

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

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

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

管理人可根据实际情况依法决定本集合计划开始办理申购的具体日期，之后本集合计划将每周开放集中申购。首个开放期详见管理人的公告，第二个开放期为首个开放期1周后的对应日（指自然周），如该对应日为非工作日，则管理人可以选择顺延、提前或暂停开放，详见管理人的公告。每个开放期不少于一个工作日、不超过二个工作日，开放期的具体时间以管理人届时公告为准。

对于每份集合计划份额，第一个运作期指集合计划合同生效日（对持有华鑫证券鑫财富乐享2号集合资产管理计划份额至集合计划合同生效日的份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对本集合计划的申购份额而言，下同）起（即第一个运作起始日），至集合计划合同生效日或集合计划份额申购申请日91个自然日（13周）后的对应日（指自然日，即第一个运作期到期日。如该对应日为非工作日，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至集合计划合同生效日或集合计划份额申购申请日182个自然日（26周）后的对应日（指自然日，如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。以此类推。每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申

请赎回，则自该运作期到期日下一日起该集合计划份额进入下一个运作期。

如发生不可抗力或其他情形致使集合计划无法按时开放或需依据集合计划合同暂停申购与赎回业务的，管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。

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、赎回价格为该类下一开放日集合计划份额申购、赎回的价格。但若投资者在开放期最后一日业务办理时间结束之后提出申购申请的，其申购申请将被拒绝。

三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

四、申购与赎回的程序

1、申购和赎回的申请方式

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

2、申购和赎回的款项支付

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

集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非管理人及托管人所能控制的因素影响业务办理流程时，赎回款项顺延至上述情形消

除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或集合计划合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照集合计划合同有关条款处理。

3、申购和赎回申请的确认

管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日)，在正常情况下，登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

集合计划销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回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，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

五、申购和赎回的数量限制

1、投资人首次申购的最低金额为10元，投资人追加申购每笔最低金额为10元，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

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

3、单个投资人累计持有的集合计划份额不设上限。

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

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

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A类份额时，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。C类份额不收取申购费。投资者可以多次申购A类份额，A类份额的申购费率按单笔分别计算。具体申购费率如下表所示：

单笔申购金额 (含申购费, M)	申购费率
M < 100 万元	0.5%
100 万元 ≤ M < 1000 万元	0.3%
M ≥ 1000 万	每笔 500 元

(2) A 类份额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。本集合计划的 A 类份额和 C 类份额根据份额持有人的持有期限不同收取不同的赎回费, 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 日 ≤ N < 180 日	0.50%
N ≥ 180 日	0

本集合计划对持续持有期少于 7 日的投资人收取的赎回费, 将全额计入集合计划财产; 对持续持有期大于等于 7 日少于 180 日的投资人, 将赎回费总额的 50% 计入集合计划财产; 未归入集合计划财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

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

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

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

七、申购份额、赎回金额的计算方式

1、申购份额的计算

当投资者选择申购本集合计划份额时，申购份额的计算方法如下：

(1) 申购费用适用比例费率时：

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

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

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

(2) 申购费用为固定金额时：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

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

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

例：某投资者投资 5 万元申购本集合计划 A 类份额，则对应的申购费率为 0.50%，假设申购当日 A 类集合计划份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 0.50\%) = 49,751.24 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000 - 49,751.24 = 248.76 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49,751.24 / 1.0500 = 47,382.13 \text{ 份}$$

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 47,382.13 份的 A 类集合计划份额。

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 日的该类集合计划份额净值为基准进行计算，本集合计划的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。

当投资者赎回集合计划份额时，赎回金额的计算方法如下：

$$\text{赎回总额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日该类集合计划份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回总额} - \text{赎回费用}$$

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

例：某持有人赎回 5 万份本集合计划 A 类份额，持有 3 个月后申请赎回，则对

应的赎回费率为 0.50%，假设赎回当日 A 类集合计划份额净值为 1.0500 元，则可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 50,000 \times 1.0500 = 52,500 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 52,500 \times 0.50\% = 262.50 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 52,500 - 262.50 = 52,237.5 \text{ 元}$$

即：持有人赎回 5 万份本集合计划份额，持有 3 个月后申请赎回，假设赎回当日 A 类集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 52,237.5 元。

3、集合计划份额净值计算

T 日某类集合计划份额净值 = T 日该类集合计划资产净值 / T 日发行在外的集该类集合计划份额总数。

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 日的各类集合计划份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

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

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

九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

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

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

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

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

6、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告，且开放期按暂停赎回的期间相应顺延。

十、巨额赎回的情形及处理方式

1、巨额赎回的认定

若本集合计划单个开放日内的集合计划份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上集合计划转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及集合计划转换中转入

申请份额总数后的余额)超过前一工作日的集合计划总份额的 20%，即认为是发生了巨额赎回。

2、巨额赎回的处理方式

当集合计划出现巨额赎回时，管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额赎回、延缓支付或部分延期办理赎回申请。

(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) 延缓支付：管理人认为支付投资人的赎回款项有困难或认为因支付投资人的赎回款项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，管理人可以接受并确认所有的赎回申请，当日按比例办理的赎回份额不得低于前一工作日集合计划总份额的 20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限不得超过二十个工作日，并应当在规定媒介上刊登公告。

(3) 延期办理：若本集合计划发生巨额赎回且单个集合计划份额持有人赎回申请超过集合计划总份额 20%时，管理人有权延期办理赎回申请：

1) 对于该集合计划份额持有人当日赎回申请超过上一工作日集合计划总份额 20%以上的部分，进行延期办理。集合计划份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销，对应的集合计划份额进入下一个运作期；选择延期赎回的，当日未获受理的赎回申请对应的集合计划份额不进入下一个运作期，并以下一工作日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，直至全部赎回。如集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，集合计划份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

2) 对于该集合计划份额持有人当日赎回申请未超过上述比例的部分，根据“（1）全额赎回”或“（2）延缓支付”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。

3、巨额赎回的公告

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

十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，管理人应在规定期限内规定媒介上刊登

暂停公告。

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

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

十二、集合资产管理计划转换

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

十三、集合计划的非交易过户

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

继承是指集合计划份额持有人死亡，其持有的集合计划份额由其合法的继承人继承；捐赠指集合计划份额持有人将其合法持有的集合计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将集合计划份额持有人持有的集合计划份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按登记机构的规定办理，并按登记机构规定的标准收费。

十四、集合计划的转托管

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

十五、定期定额投资计划

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

十六、集合计划份额的冻结和解冻

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

十七、集合计划份额的转让

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

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

十九、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回

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

第九部分 集合计划的投资

一、投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求实现集合计划资产的长期稳定增值,力争为投资者实现超越业绩比较基准的收益。

二、投资范围

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括债券(含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债、政府机构债、地方政府债、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债的纯债部分))、国债期货、资产支持证券、债券回购、债券逆回购、同业存单、货币市场工具、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款等)以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

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

集合计划的投资组合比例为:本集合计划投资于债券资产比例不低于集合计划资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本集合计划应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

三、投资策略

本集合计划将在限定的投资范围内,根据国家货币政策和财政政策实施情况、市场收益率曲线变动情况、市场流动性情况来预测债券市场整体利率趋势,同时结合各具体品种的供需情况、流动性、信用状况和利率敏感度等因素进行综合分析,在严格控制风险的前提下,构建和调整债券投资组合。力争为投资者提供长期稳定投资回报。

1、利率债投资策略

本集合计划对固定收益类证券的投资,综合采用自上而下(利率预期策略)和自下而上(债券选择策略)相结合的投资策略,对固定收益类证券进行科学合理的配置。自上而下部分主要是根据宏观经济发展状况、货币政策等的分析对市场利率进行动态

预测,以此为基础对债券的类属和期限等进行配置;自下而上部分主要从到期收益率、流动性、信用风险、久期、凸性等因素对债券的价值进行分析,对优质债券进行重点配置。利率预期策略旨在对市场利率进行动态预测,并以此为基础进行债券类属配置并调整债券组合久期。本集合计划根据宏观经济发展状况、货币政策以及债券市场供需状况等来预测利率走势。主要考虑的因素有:GDP 增长率、通货膨胀率、固定资产投资增长率、出口状况、居民消费、货币供应增长率、新债发行量、其它央行的利率政策等。

2、信用债投资策略

本集合计划通过对经济环境及信号环境的判断,构建适合集合计划风险收益特征的信用债投资组合。

本集合计划将通过自上而下的研究方式,选择适应不同市场环境的信用组合。

宏观层面,一方面,分析宏观经济所处周期及相应的货币及信用政策走向,判断信用环境,并据此构建信用组合的期限结构。另一方面,跟据市场供求关系、再融资环境、信用债流动性变化等因素,选择适合的配置时点。

中观层面,依据对不同行业信用利差趋势的研究,及行业周期所处位置的判断,选择信用利差趋于收窄、行业景气度上升、信用安全边际较高的品种,确定信用债行业配置及各信用等级债券所占投资比例。

微观层面,运用公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行具体的分析和度量,精选个券,结合债券收益和组合流动性及风险控制要求进行配置。并及时跟踪标的债券发行人的经营状况及市场舆情,分析信用风险并确定信用利差的合理水平,对信用债券进行价值评估,在确定的信用组合框架下,选择更有价值的投资标的。

投资信用债券债项评级为 AA(含)以上(若无债项评级,主体评级或担保机构评级需为 AA(含)以上,且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考);投资信用债券和利率债券中,债项或主体或担保机构评级为 AA 级的债券市值不高于集合计划资产的 20%,AA+级的债券市值不高于集合计划资产的 50%,AAA 级的债券市值不低于集合计划资产的 50%。

3、国债期货投资策略

(1)国债期货方向性交易策略

通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析,预测宏观经济的发展趋势,判断利率市场走势,进行趋

势性交易。

(2) 国债期货与现货的避险交易策略

利用国债期货对冲持仓债券组合的利率风险进行套期保值交易，实现风险中性交易策略。

(3) 国债期货与现货的基差交易策略

a. 期现套利策略：国债期货价格和现货价格之间的基差暂时性偏离正常基差水平时，可以通过买进低价资产卖出高价资产，待期、现货之间的基差恢复到正常基差水平后再进行相反的交易，从而获取套利收益。

b. 跨期套利策略：当同一品种的不同期货合约之间的基差暂时性偏离正常基差水平时，可以通过买入某一期限的合约同时卖出另一期限的合约，待合约基差回归到正常基差水平时再同时进行反向交易，从而获取套利收益。

c. 跨市套利：当某个在不同交易所上市的同一品种同一交割月份的合约之间出现非合理基差时，在某个交易所买入（卖出）某一交割月份的某个国债期货的同时，在另一个交易所卖出（买入）同一交割月份的同种期货合约，以期在有利时机分别在两个交易所对冲掉所有持有的合约而获利。

d. 跨品种套利：利用两个具有较高的相关性、交割月份相同的国债期货价格差进行套利。

4、可转换债券的投资策略

可转换债券由于兼顾权益证券和固定收益类证券的特性，具有抵御股价下行风险、分享股票上涨的投资回报，管理人将通过可对转换债券股性和债性的分析，把握可转换债券的价值投向，同时紧密依托对于个股基本面的走势判断，综合考虑上市公司基本情况、转债的股性债性等特性以及流动性等要素，选择适当的可转换债券品种。投资方式可以选择二级市场买入也可一级市场申购。

本集合计划投资于可转换债券资产比例不超过集合计划资产的 10%。

5、资产支持证券投资策略

管理人筛选市场上的证券化资产，从主体资质、基础资产、交易结构这三个层次识别风险。主体资质关注股东背景、管理团队、资产服务能力、信息系统和风控系统；基础资产关注现金流的稳定性和可预测性；交易结构关注账户设置、现金流分配顺序、信用触发机制、循环购买机制；评估其内在价值，获取稳健收益。

四、投资限制

1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本集合计划投资于债券资产比例不低于集合计划资产的 80%；
- (2) 本集合计划投资于可转换债券资产比例不超过集合计划资产的 10%；
- (3) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；
- (4) 本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的 10%；
- (5) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；
- (6) 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%；
- (7) 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%；
- (8) 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%；
- (9) 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%；
- (10) 投资信用债券债项评级为 AA（含）以上（若无债项评级，主体评级或担保机构评级需为 AA（含）以上，且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考），资产支持证券（票据）及可转换公司债券不受此条限制；
- (11) 投资信用债券和利率债券中，债项或主体或担保机构评级为 AA 级的债券市值不高于集合计划资产的 20%，AA+级的债券市值不高于集合计划资产的 50%，AAA 级的债券市值不低于集合计划资产的 50%。
- (12) 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；
- (13) 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；

(14) 本集合计划投资国债期货时，应当遵守下列限制：

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

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

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

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

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

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

(17) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的 140%；

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他投资限制。

除上述第（3）、（12）、（15）、（16）项情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

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

2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，本集合计划可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定为准。经与托管人协商一致，管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对集合计划合同进行变更，该变更无须召开集合计划份额持有人大会审议。

五、业绩比较基准

本集合计划的业绩比较基准为中证全债指数收益率。

中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所市场的跨市场债券指数，样本券涵盖范围全面，具有广泛的市场代表性，能够较好的反映中国债券市场的总体价格水平和变动趋势。

本集合计划的资产配置根据对经济周期及信用环境的判断，综合考虑债券组合的安全边际、利差水平及市场流动性，根据不同时点，从全市场债券中选择投资标的，构建适合本集合计划的债券投资组合。

基于本集合计划的投资范围和投资策略,该业绩基准能够较好的反映本集合计划的风险收益特征,适合作为本集合计划的业绩比较基准。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称,或今后法律法规发生变化,或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,本管理人可依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则,调整业绩比较基准应经托管人同意,并报中国证监会备案。管理人应在调整实施前在规定媒介上予以公告,无需召开集合计划份额持有人大会审议。

六、风险收益特征

本集合计划为债券型集合计划,其风险收益水平低于股票型集合计划和混合型集合计划,高于货币市场型集合计划,属于中低风险/收益的产品。

七、管理人代表集合计划行使股票或债权人权利的处理原则及方法

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

2、不谋求对上市公司的控股;

3、有利于集合计划财产的安全与增值;

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

八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

第十部分 集合计划的财产

一、集合计划资产总值

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

二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

三、集合计划财产的账户

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

四、集合计划财产的保管和处分

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

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

第十一部分 集合计划资产估值

一、估值日

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

二、估值对象

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

三、估值原则

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

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

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

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

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

四、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市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；

(2) 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；

(3) 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；

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

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

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

7、银行存款、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

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

9、当发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合

计划估值的公平性。

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

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

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

五、估值程序

1、集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，集合计划资产净值除以当日集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

管理人每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。

2、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或集合计划合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人按规定对外公布。

六、估值错误的处理

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

集合计划合同的当事人应按照以下约定处理：

1、估值错误类型

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

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

2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

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

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

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

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

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

(4) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。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。

七、暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4、中国证监会和集合计划合同认定的其它情形。

八、集合计划净值的确认

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

九、特殊情况的处理

管理人或托管人按集合计划合同约定的估值方法第 8 项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理；

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

十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

第十二部分 集合计划费用与税收

一、集合计划费用的种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、C类份额的销售服务费；
- 4、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 5、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费等；
- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券、期货交易费用；
- 8、集合计划的银行汇划费用；
- 9、集合计划的开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《集合计划合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% \div 365$$

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划款指令，经托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

2、托管人的托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划托管费划款指令，经托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

3、C 类份额的销售服务费

本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.30%。本集合计划销售服务费将专门用于本集合计划的销售与集合计划份额持有人服务，管理人将在年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。销售服务费计提的计算公式如下：

$$H=E \times 0.30\% \div 365$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日的集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付，由管理人向托管人发送销售服务费划款指令，经托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人，并由管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

上述“一、集合计划费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。

三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

- 1、管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划财产的损失；
- 2、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；
- 3、《集合计划合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目。

四、集合计划税收

本集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执

行。集合计划财产投资的相关税收，由集合计划份额持有人承担，管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

五、实施侧袋机制期间的集合计划费用

本集合计划实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可根据法律法规、监管规定酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书“侧袋机制”章节或相关公告。

第十三部分 集合计划的会计与审计

一、集合计划会计政策

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

二、集合计划的年度审计

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

第十四部分 集合计划的收益与分配

一、集合计划利润的构成

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

二、集合计划可供分配利润

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

三、集合计划收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下,本集合计划可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准,若《集合计划合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

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

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

4、同一类别每一集合计划份额享有同等分配权;由于本集合计划A类份额不收取销售服务费,C类份额收取销售服务费,各份额类别对应的可供分配利润将有所不同;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

四、收益分配方案

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

五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

六、集合计划收益分配中发生的费用

集合计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当

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

七、实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书“侧袋机制”章节规定。

第十五部分 集合计划的信息披露

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

二、信息披露义务人

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

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

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

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息,不得有下列行为:

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

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

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字;除特别说明外,货币单位为人民币元。

五、公开披露的集合计划信息

公开披露的集合计划信息包括:

（一）招募说明书、《集合计划合同》、托管协议、集合计划产品资料概要

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

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

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

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

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

（二）《集合计划合同》生效公告

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

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

管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年

度最后一日的各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

（四）集合计划份额申购、赎回价格

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

（五）集合计划定期报告，包括年度报告、中期报告和季度报告（含资产组合季度报告）

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

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

管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成季度报告，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，管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。

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

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

（六）临时报告

本集合计划发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在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、更换管理人、托管人、份额登记机构，集合计划改聘会计师事务所；
 - 5、管理人委托相关服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托相关服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；
 - 6、管理人、托管人的法定名称、住所发生变更；
 - 7、管理人变更持有百分之五以上股权的股东、管理人的实际控制人变更；
 - 8、管理人的高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门基金托管部门负责人发生变动；
 - 9、管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，管理人、托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
 - 10、涉及集合计划财产、集合资产管理计划管理业务、集合资产管理计划托管业务的诉讼或仲裁；
 - 11、管理人或其高级管理人员、集合计划投资经理因集合资产管理计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，托管人或其专门基金托管部门负责人因集合资产管理计划托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
 - 12、管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
 - 13、集合计划收益分配事项，但本资产管理合同另有约定的除外；
 - 14、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
 - 15、集合计划份额净值估值错误达集合计划份额净值百分之零点五；
 - 16、本集合计划进入开放期；
 - 17、本集合计划发生巨额赎回并延期办理或延缓支付赎回款项；
 - 18、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；
 - 19、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；
 - 20、管理人采用摆动定价机制进行估值；
 - 21、连续三十个工作日、四十个工作日、四十五个工作日出现集合计划份额持有人数量不满 200 人或者集合资产净值低于 5000 万元情形；
 - 22、本集合计划按照法律法规约定延长合同期限；
 - 23、调整集合计划份额类别的设置；

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

（七）澄清公告

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

（八）集合计划份额持有人大会决议

集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

（九）清算报告

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

（十）投资资产支持证券的信息披露

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

（十一）投资国债期货的信息披露

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

（十二）实施侧袋机制期间的信息披露

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

（十三）中国证监会规定的其他信息。

六、信息披露事务管理

管理人、托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员

负责管理信息披露事务。

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

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

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

管理人、托管人除依法在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。

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

七、信息披露文件的存放与查阅

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

八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，管理人和托管人可暂停或延迟披露集合计划相关信息：

- (1) 不可抗力；
- (2) 发生暂停估值的情形；
- (3) 法律法规、《集合计划合同》或中国证监会规定的情况。

第十六部分 侧袋机制

一、侧袋机制的实施条件、实施程序

当集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护集合计划份额持有人利益的原则，管理人经与集合计划托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及集合合同的约定启用侧袋机制，无需召开集合份额持有人大会。管理人应当在启用侧袋机制当日报中国证监会及公司所在地中国证监会派出机构备案。

启用侧袋机制当日，集合管理人和集合计划服务机构应以集合计划份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户持有人名册和份额。

二、侧袋机制实施期间的集合计划运作安排

（一）集合计划份额的申购与赎回

1、侧袋账户

侧袋机制实施期间，管理人不办理侧袋账户的申购、赎回和转换。集合计划份额持有人申请申购、赎回或转换侧袋账户基金份额的，该申购、赎回或转换申请将被拒绝。

2、主袋账户

集合计划管理人将依法保障主袋账户份额持有人享有集合计划合同约定的赎回权利，并根据主袋账户运作情况合理确定申购事项，具体事项届时将由管理人在相关公告中规定。

对于启用侧袋机制当日收到的赎回申请，集合计划管理人仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。在启用侧袋机制当日收到的申购申请，视为投资者对侧袋机制启用后的主袋账户提交的申购申请。管理人应依法向投资者进行充分披露。

（二）集合计划的投资

侧袋机制实施期间，本集合计划的各项投资运作指标和集合计划业绩指标应当以主袋账户资产为基准。

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

集合管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

（三）集合计划的费用

侧袋机制实施期间，侧袋账户资产不收取管理费。

集合计划管理人可以将与处置侧袋账户资产相关的费用从侧袋账户资产中列支，但应待特定资产变现后方可列支。因启用侧袋机制产生的咨询、审计费用等由管理人承担。

（四）集合计划的收益分配

侧袋机制实施期间，在主袋账户份额满足集合计划合同收益分配条件的情形下，管理人可对主袋账户份额进行收益分配。侧袋账户不进行收益分配。

（五）集合计划的信息披露

1、基金净值信息

侧袋机制实施期间，集合计划管理人应当暂停披露侧袋账户的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

2、定期报告

侧袋机制实施期间，集合计划定期报告中的集合计划会计报表仅需针对主袋账户进行编制。侧袋账户相关信息在定期报告中单独进行披露，包括但不限于：报告期内的特定资产处置进展情况；特定资产可变现净值或净值区间，该净值或净值区间并不代表特定资产最终的变现价格，不作为管理人对特定资产最终变现价格的承诺。

3、临时报告

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

启用侧袋机制的临时公告内容应当包括启用原因及程序、特定资产流动性和估值情况、对投资者申购赎回的影响、风险提示等重要信息。

处置特定资产的临时公告内容应当包括特定资产处置价格和时间、向侧袋账户份额持有人支付的款项、相关费用发生情况等重要信息。

侧袋机制实施期间，若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，集合计划管理人将在每次处置变现后按规定及时发布临时公告。

（六）特定资产处置清算

集合计划管理人将按照集合计划份额持有人利益最大化原则制定变现方案，将侧袋账户资产处置变现。无论侧袋账户资产是否全部完成变现，集合计划管理人都应及时向侧袋账户对应的集合计划份额持有人支付已变现部分对应的款项。

（七）侧袋的审计

管理人应当在启用侧袋机制和终止侧袋机制后，及时聘请符合《中华人民共和国

证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见，具体如下：

管理人应当在启用侧袋机制时，就特定资产认定的相关事宜取得符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所的专业意见。

管理人应当在启用侧袋机制后五个工作日内，聘请于侧袋机制启用日发表意见的会计师事务所针对侧袋机制启用日本集合计划持有的特定资产情况出具专项审计意见，内容应包含侧袋账户的初始资产、份额、净资产等信息。

会计师事务所对集合计划年度报告进行审计时，应对报告期间集合计划侧袋机制运行相关的会计核算和年报披露，执行适当程序并发表审计意见。

当侧袋账户资产全部完成变现后，集合计划管理人应参照基金清算报告的相关要求，聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所对侧袋账户进行审计并披露专项审计意见。

三、本部分关于侧袋机制的相关规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，集合计划管理人经与集合计划托管人协商一致并履行适当程序后，在对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，可直接对本部分相应内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

第十七部分 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

管理人可根据实际情况依法决定本集合计划开始办理申购的具体日期，之后本集合计划将每周开放集中申购。每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该集合计划份额进入下一个运作期。

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具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债、政府机构债、地方政府债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分））、国债期货、资产支持证券、债券回购、债券逆回购、同业存单、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款等）以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）；同时，本集合计划基于分散投资的原则在行业和个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本集合计划的流动性风险适中。

(3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

当集合计划出现巨额赎回时，管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决定全额赎回、延缓支付或部分延期办理赎回申请。

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) 延缓支付：管理人认为支付投资人的赎回款项有困难或认为因支付投资人的赎回款项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，管理人可以接受并确认所有的赎回申请，当日按比例办理的赎回份额不得低于前一工

作日集合计划总份额的 20%，其余赎回申请可以延缓支付赎回款项，但延缓支付的期限不得超过二十个工作日，并应当在规定媒介上刊登公告。

3) 延期办理：若本集合计划发生巨额赎回且单个集合计划份额持有人赎回申请超过集合计划总份额 20%时，管理人有权延期办理赎回申请：

①对于该集合计划份额持有人当日赎回申请超过上一工作日集合计划总份额 20%以上的部分，进行延期办理。集合计划份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销，对应的集合计划份额进入下一个运作期；选择延期赎回的，当日未获受理的赎回申请对应的集合计划份额不进入下一个运作期，并以下一工作日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，直至全部赎回。如集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，集合计划份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

②对于该集合计划份额持有人当日赎回申请未超过上述比例的部分，根据“1) 全额赎回”或“2) 延缓支付”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。

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

(4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及集合计划合同的规定，谨慎选取暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、延期办理巨额赎回申请、收取短期赎回费、暂停集合计划估值、摆动定价等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，管理人将密切关注市场资金动向，提前调整投资和头寸安排，尽可能的避免出现不得不实施上述流动性风险管理工具的流动性风险，将对投资者可能出现的潜在影响降至最低。

4、本集合计划特有风险

(1) 本集合计划的投资组合比例：本集合计划投资于债券资产比例不低于集合计划资产的 80%；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国债期货。国债期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

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

(4) 流通受限证券的风险

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

(5) 集合计划份额在运作期内无法赎回的风险

每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该集合计划份额进入下一个运作期。

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、启用侧袋机制的风险

本集合计划启用侧袋机制时，实施侧袋机制期间，侧袋账户份额将停止披露集合计划份额净值，并不得办理申购、赎回和转换。因特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，集合计划份额持有人可能因此面临损失。

8、其他风险

- (1) 因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- (2) 因集合计划业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- (3) 因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈等行为产生的风险；
- (4) 对主要业务人员如集合计划经理的依赖而可能产生的风险；
- (5) 因战争、自然灾害等不可抗力导致的管理人、集合计划其他销售机构等机构无法正常工作，从而影响集合计划的申购、赎回按正常时限完成的风险。

二、声明

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

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

第十八部分 集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算

一、《集合计划合同》的变更

- 1、变更集合计划合同涉及法律法规规定或集合计划合同约定应经集合计划

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

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

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

三、集合计划财产的清算

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

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

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

4、集合计划财产清算程序：

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

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

四、清算费用

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

五、集合计划财产清算剩余资产的分配

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

六、集合计划财产清算的公告

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

七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

第十九部分 集合计划合同的内容摘要

一、集合计划份额持有人、管理人及托管人的权利义务

(一) 管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

(1) 依法募集资金；

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

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

(4) 销售集合计划份额；

(5) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；

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

(7) 在托管人更换时，提名新的托管人；

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

(9) 担任或委托其他符合条件的机构担任登记机构办理集合计划登记业务并获取《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、赎回与转换申请；

(12) 依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使股东权利，为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利；

(13) 在法律法规允许的前提下，为集合计划的利益依法为集合计划进行融资；

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

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

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

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

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

(2) 办理集合计划备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受托管人的监督；

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

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

(13) 按《集合计划合同》的约定确定集合计划收益分配方案，及时向集合

计划份额持有人分配集合计划收益；

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他义务。

(二) 托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

(6) 在管理人更换时，提名新的管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

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

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

(5) 保管由管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 从管理人或其委托的登记机构处接收并保存集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《集合计划合同》的规定监督管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他义务。

(三) 集合计划份额持有人的权利与义务

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

同一类别每份集合计划份额具有同等的合法权益。

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

- (1) 分享集合计划财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余集合计划财产；
- (3) 依法转让或者申请赎回其持有的集合计划份额；
- (4) 按照规定要求召开集合计划份额持有人大会或者召集集合计划份额持有人大会；

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

(6) 查阅或者复制公开披露的集合计划信息资料；

(7) 监督管理人的投资运作；

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

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守《集合计划合同》、招募说明书等信息披露文件；

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

(3) 关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳集合计划申购款项及法律法规和《集合计划合同》所规定的费用；

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

(6) 不从事任何有损集合计划及其他《集合计划合同》当事人合法权益的活

动；

- (7) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他义务。

二、集合计划份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

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

（一）召开事由

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

- (1) 终止《集合计划合同》；
- (2) 更换管理人；
- (3) 更换托管人；
- (4) 转换集合计划运作方式；
- (5) 调整管理人、托管人的报酬标准或调高销售服务费率；
- (6) 变更集合计划类别；
- (7) 本集合计划与其他集合资产管理计划的合并；
- (8) 变更集合计划投资目标、范围或策略；
- (9) 变更集合计划份额持有人大会程序；
- (10) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；
- (11) 单独或合计持有本集合计划总份额 10%以上（含 10%）集合计划份额的集合计划份额持有人（以管理人或托管人收到提议当日的集合计划份额计算，下同）就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会；
- (12) 对本合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；
- (13) 法律法规、《集合计划合同》或中国证监会规定的其他应当召开集合

计划份额持有人大会的事项。

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

(1) 法律法规要求增加或调整的集合计划费用的收取；

(2) 调低集合计划管理费、集合计划托管费及其他应由集合计划承担的费用；调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式；

(3) 增加或调整份额类别设置、停止现有份额的发售；

(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) 集合计划推出新业务或服务；

(7) 管理人、登记机构、销售机构在法律法规规定或中国证监会许可的范围内调整有关认购、申购、赎回、转换、集合计划交易、非交易过户、转托管等业务规则；

(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管理人召集。

2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集。

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

4、代表集合计划份额 10%以上（含 10%）的集合计划份额持有人就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会，应当向管理人提出书面提议。管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的集合计划份额持有人代表和托管人。管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日

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

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

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

（三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（四）集合计划份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

（2）召集人按集合计划合同约定通知托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取份额持有人的书面表决意见；托管人或管理人经通知不参加收取书面表决意见

的，不影响表决效力；

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

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

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

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

(五) 议事内容与程序

1、议事内容及提案权

议事内容为关系集合计划份额持有人利益的重大事项，如《集合计划合同》的重大修改、决定终止《集合计划合同》、更换管理人、更换托管人、与其他集合资产管理计划合并、法律法规及《集合计划合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交集合计划份额持有人大会讨论的其他事项。

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

2、议事程序

(1) 现场开会

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

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

(2) 通讯开会

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

(六) 表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交

符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的集合计划份额持有人所代表的集合计划份额总数。

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

（七）计票

1、现场开会

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

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

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

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

2、通讯开会

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

（八）生效与公告

集合计划份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证

监会备案。

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

（九）实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。

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

三、集合计划合同的终止事由、程序与集合计划资产的清算

(一) 《集合计划合同》的变更

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

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

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

(三) 集合计划财产的清算

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

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

3、集合计划财产清算小组职责：集合计划财产清算小组负责集合计划财产的

保管、清理、估价、变现和分配。集合计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、集合计划财产清算程序：

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

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

(四) 清算费用

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

(五) 集合计划财产清算剩余资产的分配

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

(六) 集合计划财产清算的公告

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

(七) 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存不低于法律法规规定的最低

期限。

四、争议解决方式

各方当事人同意，凡因《集合计划合同》引起的或与《集合计划合同》有关的任何争议，如经友好协商未能解决的，均应提交上海国际经济贸易仲裁委员会依据届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，管理人和托管人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行集合计划合同规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

《集合计划合同》受中华人民共和国法律（为集合计划合同之目的，不含港澳台立法）管辖。

五、集合计划合同存放地和投资者取得集合计划合同的方式

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

第二十部分 集合计划托管协议的内容摘要

一、 托管协议当事人

(一) 管理人

名称：华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房

办公地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房

邮政编码：200030

法定代表人：俞洋

设立日期：2001年3月6日

批准设立机关及批准设立文号：证监机构字[2001]34号

组织形式： 有限责任公司

注册资本：36亿

存续期限：持续经营

联系电话：95323

(二) 托管人

名称：上海银行股份有限公司(简称：上海银行)

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号

办公地址：中国(上海)自由贸易试验区银城中路168号

邮政编码：200120

法定代表人：金煜

成立日期：1995年12月29日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行 银复[1995]469号《关于上海城市合作银行开业的批复》，中国人民银行 银复[1998]215号《关于上海城市合作银行更改行名的批复》

基金托管业务批准文号：中国证监会证监许可[2009]814号

组织形式：股份有限公司（中外合资、上市）

注册资本：人民币142.065287亿元

存续期间：持续经营

经营范围：人民币存贷款等

二、托管人与管理人之间的业务监督、核查

托管人对管理人的业务监督和核查

（一）托管人根据有关法律法规的规定及《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，管理人应按照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主要为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债、政府机构债、地方政府债、可交换债券、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分））、国债期货、资产支持证券、债券回购、债券逆回购、同业存单、货币市场工具、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款等）以及法律法规或中国证监会允许集合资产管理计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券资产比例不低于集合计划资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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

（1）本集合计划投资于债券资产比例不低于集合计划资产的 80%；

(2) 本集合计划投资于可转换债券资产比例不超过集合计划资产的 10%;

(3) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后, 本集合计划应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%, 其中, 现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

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

(5) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的10%;

(6) 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%;

(7) 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%;

(8) 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%;

(9) 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%;

(10) 投资信用债券债项评级为AA(含)以上(若无债项评级, 主体评级或担保机构评级需为AA(含)以上, 且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考), 资产支持证券(票据)及可转换公司债券不受此条限制;

(11) 投资信用债券和利率债券中, 债项或主体或担保机构评级为AA级的债券市值不高于集合计划资产的20%, AA+级的债券市值不高于集合计划资产的50%, AAA级的债券市值不低于集合计划资产的50%。

(12) 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;

(13) 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;

(14) 本集合计划投资国债期货时, 应当遵守下列限制:

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

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

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

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

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

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

(17) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的140%;

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他投资限制。

除上述第(3)、(12)、(15)、(16)项情形之外,因证券、期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的,管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

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

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

持有人大会审议。

侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、组合限制等约定仅适用于助贷账户。

侧袋机制的具体规则依照相关法律法规的规定和集合计划合同的约定执行。

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

（三）托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对本托管协议第十五条第（九）款集合计划投资禁止行为通过事后监督方式进行监督。

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。根据法律法规有关集合计划从事关联交易的规定，管理人和托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，并确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。

若托管人发现管理人与关联交易名单中列示的关联方进行的关联交易违反法律法规规定时，托管人应及时提醒并协助管理人采取必要措施阻止该关联交易的发生，若托管人采取必要措施后仍无法阻止关联交易发生时，托管人有权向中国证监会报告。对于交易所场内已成交的违规关联交易，托管人应按相关法律法规和交易所规则的规定进行结算，同时向中国证监会报告。

（四）托管人根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，对管理人参与银行间债券市场进行监督。管理人在银行间债券市场进行非券款兑付（DVP）交易的，应在集合计划投资运作之前向托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本集合计划适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。托管人监督管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行非券款兑付（DVP）交易。

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，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托管人与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，管理人可以对相关交易对手追偿，托管人应提供必要的协助与配合。托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如托管人事后发现管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，托管人应及时提醒管理人，托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）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、相关信息披露中登载集合计划业绩表现数据等进行监督和核查。

如果管理人未经托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

（六）托管人发现管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、《集合计划合同》和本托管协议的规定，应及时以电话提醒或书面提示等方式通知管理人限期纠正。管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查。管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给托管人发出回函，就托管人的合理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，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。

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

（八）若托管人发现管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《集合计划合同》约定的，应当立即以书面或双方认可的其他方式通知管理人，由此造成的损失由管理人承担。

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

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

托管人依照相关法律法规的规定和集合计划合同的约定，对侧袋机制启用、特定资产处置和信息披露等方面进行复核和监督。侧袋机制实施期间的具体规则依照相关法律法规的规定和集合计划合同的约定执行。

管理人对托管人的业务核查

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

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

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

三、集合计划财产的保管

(一) 集合计划财产保管的原则

1. 集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。
2. 托管人应安全保管集合计划财产, 不对处于托管人实际控制之外的账户或财产承担责任。
3. 托管人按照规定开设集合计划财产的资金账户、证券账户等投资所需其他账户。
4. 托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户, 确保集合计划财产的完整与独立。
5. 托管人按照《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。托管人未经管理人的指令, 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、托管资产开户银行扣收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，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日集合计划财产没有到达集合计划账户的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收。由此给集合计划财产造成损失的，管理人应向有关当事人追偿集合计划财产的损失，托管人对此不承担任何责任，但应提供必要的协助和配合。

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

（二）集合计划托管账户的开立和管理

1. 托管人应以本集合计划的名义在其营业机构开立集合计划的托管账户，并根据管理人合法合规的指令办理资金收付。

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

3. 集合计划托管账户的开立和管理应符合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，托管人可以通过托管人专用账户办理集合计划资产的支付。

（三）证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1. 托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为集合计划开立证券账户。

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

3. 证券账户的开立、变更和证券账户卡的保管由托管人负责，账户资产的管理和运用由管理人负责。

证券账户开户费由本集合计划财产承担，若因集合计划银行存款余额不足导致证券账户开户费无法扣收，由管理人先行垫付。

4. 托管人以托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的集合计划完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清

算工作，管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差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执行。

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

（四）债券托管账户的开立和管理

《集合计划合同》生效后，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；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。管理人和托管人共同代表集合计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

（五）其他账户的开立和管理

1. 在本托管协议订立日之后，本集合计划被允许从事符合法律法规规定和《集合计划合同》约定的其他投资品种的投资业务时，如果涉及相关账户的开设和使用，按有关规则进行开立和使用。

2. 法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

（六）集合计划财产投资的有关有价凭证等的保管

集合计划财产投资的有关实物证券、银行存款开户证实书等有价凭证由托管人存放于托管人的保管库，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、银行间市场清算所股份有限公司或票据营业中心的代保管库，保管凭证由托管人持有。实物证券、银行定期存款证实书等有价凭证的购买和转让，按管理人和托管人双方约定办理。托管人对由托管人以外机构实际有效控制的资产不承担保管责任，但应妥善保管有关凭证。

（七）与集合计划财产有关的重大合同的保管

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

人应在重大合同签署后及时以加密方式将重大合同传真给托管人，并在三十个工作日内将正本送达托管人处。重大合同的保管期限不低于法律法规规定的最低期限。

对于无法取得二份以上的正本的，管理人应向托管人提供合同复印件，并在复印件上加盖公章，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

四、集合计划资产净值计算与复核

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，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

管理人每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。

管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或《集合计划合同》的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人按约定对外公布。

五、集合计划份额持有人名册的登记与保管

集合计划份额持有人名册至少应包括集合计划份额持有人的名称和持有的集合计划份额。集合计划份额持有人名册由登记机构根据管理人的指令编制和保管，管理人应保管集合计划份额持有人名册，保存期不少于法律法规规定的最低期限。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在托管人要求或编制中期报告和年度报告前，管理人应将有关资料送交托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其的真实性、准确性和完整性。管理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，均应提交上海国际经济贸易仲裁委员会依据届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。仲

裁费用由败诉方承担。

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

本协议受中国法律（为本协议之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）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。托管协议的变更报中国证监会备案。

（二）托管协议终止出现的情形

1. 《集合计划合同》终止；
2. 托管人解散、依法被撤销、破产或由其他托管人接管集合计划资产；
3. 管理人解散、依法被撤销、破产或由其他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。

（三）集合计划财产的清算

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

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

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

4. 集合计划财产清算程序：

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

（2）对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

- (3) 对集合计划财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

6. 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。

7. 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。

8. 集合计划财产清算的公告

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

9. 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

第二十一部分 对集合计划份额持有人的服务

对本集合计划份额持有人的服务主要由管理人、集合计划销售机构提供。以下是管

理人提供的主要服务内容，管理人根据集合计划份额持有人的需要和市场的变化，有权增加和修改相关服务项目。

一、客户服务中心受理客户咨询的方式

客服服务中心通过客服热线95323、4001099918，在线客服、邮箱等方式受理客户的业务咨询。

客服热线受理的时间为：周一至周五，每个交易日8:30时——16:30时（法定节假日除外）；

在线客服受理的时间为：周一至周五，每个交易日8:30时——16:30时（法定节假日除外）；

二、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过12386服务热线、管理人客服热线、在线客服、书信、电子邮件、传真等渠道对管理人和销售渠道提供的服务进行投诉或提出建议。

管理人将与集合计划业务相关的投资人信访、投诉事件纳入管理人日常投资人投诉、上访和纠纷处理机制，按《华鑫证券客户投诉管理办法规定的流程进行处理》。

三、网站资讯服务

管理人网站（www.cfsc.com.cn）为投资人提供理财刊物查阅、热点问答、市场波动点评、研究资讯等信息服务。同时，网站还设有在线客服、客服电子邮箱等，投资人可在线提问或留言。

四、如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请通过上述方式联系管理人。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) 中国证监会准予华鑫证券鑫财富乐享2号集合资产管理计划变更为华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划的文件

(二) 华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同

(三) 华鑫证券乐享周周购三个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议

(四) 法律意见书

(五) 管理人业务资格批件、营业执照

(六) 托管人业务资格批件、营业执照

(七) 中国证监会要求的其他文件

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