

# 平安证券股份有限公司

## 平安证券安赢添利半年滚动持有债券型 集合资产管理计划

### 更新的招募说明书

管理人：平安证券股份有限公司

托管人：中信银行股份有限公司

二〇二二年五月

---

---

## 目 录

<b>重要提示</b> .....	1
第一部分 绪言 .....	3
第二部分 释义 .....	4
第三部分 集合计划的管理人 .....	10
第四部分 集合计划的托管人 .....	24
第五部分 相关服务机构 .....	27
第六部分 集合计划的历史沿革 .....	29
第七部分 集合计划的存续 .....	30
第八部分 集合计划份额的申购与赎回 .....	31
第九部分 集合计划的投资 .....	41
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 集合计划的收益与分配 .....	56
第十三部分 集合计划费用与税收 .....	58
第十四部分 集合计划的会计与审计 .....	61
第十五部分 集合计划的信息披露 .....	62
第十六部分 侧袋机制 .....	69
第十七部分 风险揭示 .....	72
第十八部分 合同的变更、终止与集合计划财产的清算 .....	78
第十九部分 资产管理合同内容摘要 .....	80
第二十部分 托管协议的内容摘要 .....	97
<b>第二十一部分 产品资料概要</b> .....	117
<b>第二十二部分 对集合计划份额持有人的服务</b> .....	139
<b>第二十三部分 其他应披露事项</b> .....	140
<b>第二十四部分 招募说明书的查阅方式</b> .....	143
<b>第二十五部分 备查文件</b> .....	144

## 重要提示

本集合计划由原平安证券稳健资本一号集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。原集合计划为非限定性集合资产管理计划，2011年8月5日经中国证监会证监许可【2011】1239号核准设立，自2011年10月11日起开始募集，于2011年11月11日结束募集工作，并于2011年11月18日正式成立。

根据中国证监会于2018年11月28日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，自2021年5月12日起，《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《平安证券稳健资本一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。

原集合计划变更为本集合计划经中国证监会批准，但中国证监会对原集合计划变更为本集合计划的批准，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划财产，但不保证投资于本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。

本集合计划投资于证券市场，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：市场风险、管理风险，流动性风险、本集合计划的特定风险、操作或技术风险、合规性风险、其他风险等。

本集合计划的投资范围包括资产支持证券，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。

本集合计划的国债期货，可能给本集合计划带来额外风险，包括杠杆风险、期货价格与集合计划投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本

集合计划净值的波动性。

为对冲信用风险，本计划可能投资信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

本集合计划根据销售方式或投资者申购本集合计划金额的不同将本集合计划份额分为 A、B、C、D 四个类别，就 A 类份额而言，不开放申购，每个开放日办理赎回。对于 B、C、D 类计划份额，每份计划份额设定六个月的运作期，每个运作期到期日前，B、C、D 类集合计划份额持有人不能提出赎回申请。投资者面临在运作期到期日前无法赎回的风险，以及错过当期运作期到期日未能赎回而进入下一运作期的风险。

对于 B、C、D 类计划份额的每份申购份额，第一个运作期指该计划份额申购确认日起（即第一个运作期起始日），至计划份额申购确认日满 6 个月对应的月度对日（即第一个运作期到期日）止。第二个运作期指计划份额申购确认日满 12 个月对应的月度对日止，第三个运作期指计划份额申购确认日满 18 个月对应的月度对日止。以此类推。每个运作期到期日，B、C、D 类集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果 B、C、D 类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工作日起该计划份额进入下一个运作期。

投资有风险，投资人申购集合计划时应当认真阅读本招募说明书。集合计划的过往业绩并不预示其未来表现，管理人管理的其他资产管理计划的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。管理人提醒投资人集合计划投资的“买者自负”原则，在投资人做出投资决策后，集合计划运营状况与集合计划净值变化导致的投资风险，由投资人自行承担。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。

投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本集合计划的《招募说明书》、《资产管理合同》、产品资料概要等信息披露文件，全面认识本集合计划的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险，谨慎做出投资决策，并通过管理人或管理人委托的具有基金销售业务资格的其他销售机构购买集合计划。

## 第一部分 绪言

《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关规定以及《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”或“《资产管理合同》”）编写。

本招募说明书阐述了平安证券安赢添利半年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”）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。

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，也不保证最低收益。集合计划根据招募说明书所载明资料发行。

本招募说明书依据资产管理合同编写，资产管理合同是约定集合计划当事人之间权利义务的法律文件。如本招募说明书内容与资产管理合同有冲突或不一致之处，均以资产管理合同为准。投资者自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和资产管理合同的当事人，其持有集合计划份额的行为本身即表明对资产管理合同的承认和接受，并按照《基金法》、资产管理合同及其它有关规定享有权利，承担义务。投资人欲了解集合计划份额持有人的权利和义务，应详细查阅资产管理合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合计划或本集合计划：指平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划

2、管理人：指平安证券股份有限公司

3、托管人：指中信银行股份有限公司

4、资产管理合同、《资产管理合同》：指《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》及对资产管理合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指管理人与托管人就本集合计划签订之《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

7、产品资料概要：指《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新

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

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

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

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

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

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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

19、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者

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

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

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

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

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

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

26、登记机构：指办理登记业务的机构。集合计划的登记机构为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、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、资产管理合同生效日：本《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日，《平安证券稳健资本一号集合资产管理计划资产管理合同》同日失效

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

31、存续期：指原《平安证券稳健资本一号集合资产管理计划资产管理合同》生效至资产管理合同终止之间的期限

32、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、运作期起始日：对于B、C、D类计划份额的每份申购份额而言，第一个运作期起始日指该计划份额申购确认日；对于上一运作期到期日未赎回的B、C、D类计划份额的下一运作期起始日，指该计划份额上一运作期到期日的下一

---

---

## 工作日

36、运作期到期日：对于 B、C、D 类计划份额的每份申购份额，第一个运作期到期日指计划份额申购确认日满 6 个月对应的月度对日，第二个运作期到期日为计划份额申购确认日满 12 个月对应的月度对日，第三个运作期到期日为计划份额申购确认日满 18 个月对应的月度对日，以此类推

37、月度对日：指计划份额申购确认日在后续日历月中的对应日期，如没有对应日期或该日为非工作日的，则顺延至下一工作日

38、开放日：指为投资人办理集合计划份额申购、赎回或其他业务的工作日，但投资人不能对 A 类计划份额提出申购申请，仅能在运作期到期日对 B、C、D 类计划份额提出赎回申请

39、开放时间：指开放日集合计划接受申购、赎回或其他交易的时间段

40、《业务规则》：指中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则及其不时做出的修订

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

42、赎回：指资产管理合同生效后，集合计划份额持有人按资产管理合同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

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

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

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

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

47、元：指人民币元

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

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

50、集合计划资产净值：指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值

51、集合计划份额净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划份额总数

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

53、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、计划份额类别：指本计划根据销售方式或投资者申购本集合计划金额的不同将本计划份额分为 A、B、C、D 四个类别，各计划份额类别分别设置代码，并分别计算和公告计划份额净值

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

56、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

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

58、信用衍生品：符合银行间市场相关业务规则，专门用于管理信用风险的信用衍生工具

59、信用保护买方：亦称信用保护购买方，指接受信用风险保护的一方

---

60、信用保护卖方：亦称信用保护提供方，指提供信用风险保护的一方

61、名义本金：亦称交易名义本金，是一笔信用衍生品交易提供信用风险保护的金额，各项支付和结算以此金额为计算基准

62、销售费用：指由销售机构在发售集合计划份额以及办理集合计划份额的申购、赎回等销售活动中收取的费用。费用主要包括认购费、申购费、赎回费、销售服务费、客户维护费以及销售增值服务等

63、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

64、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

65、不可抗力：指资产管理合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

## 第三部分 集合计划的管理人

### 一、管理人概况

名称：平安证券股份有限公司（以下简称“平安证券”）

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座 22-25 层

法定代表人：何之江

成立日期：1996-07-18

统一社会信用代码：914403001000234534

组织形式：非上市股份有限公司

注册资本：138 亿元

存续期限：长期

联系电话：95511

联系人：刁安然

股权结构：截至 2021 年 12 月 31 日，公司股权结构如下表所示：

股东名称	股份数量（股）	占股份总数的比例
平安信托有限责任公司	7,680,928,200.00	55.6589%
中国平安保险（集团）股份有限公司	5,652,424,800.00	40.9596%
江苏白雪电器股份有限公司	228,735,000.00	1.6575%
深圳市卓越创业投资有限责任公司	208,821,600.00	1.5132%
深圳市宏兆实业发展有限公司	29,090,400.00	0.2108%
合计	13,800,000,000.00	100.00%

### 二、主要人员情况

#### 1、集合计划管理人董事会、监事会成员、高级管理人员

何之江，2019 年 3 月起担任本公司董事长。何先生 2018 年 7 月加入平安证

券，现任公司执行委员会委员、总经理兼首席执行官，曾兼任财务负责人。加入平安证券前，何先生曾任平安银行副行长、行长特别助理、浙江稠州商业银行总行行长等职务。何先生获得山东大学外国语言文学专业硕士学位。

李锐，2021年4月起担任本公司董事。李先生于2017年10月加入平安集团，现任平安集团财务总监兼财务部总经理。李先生是平安信托、平安金服、平安科技、陆金所等多家平安集团控股子公司和联营公司的董事。加入平安之前，李先生曾在香港普华咨询、美国和加拿大德勤咨询担任关键管理岗位。李先生是美国注册会计师协会会员（AICPA）、全球特许管理会计师（CGMA），并获得美国明尼苏达州立大学工商管理硕士学位。

王芊，2016年8月起担任本公司董事。王女士自2002年加入平安集团，曾任平安集团内控管理中心稽核监察部上海分部产险室主任、综合金融室主任、平安数据科技稽核监察项目中心上海分部副总经理、平安集团稽核监察部高级稽核经理、平安集团首席风险执行官办公室高级经理、平安集团风险管理部总经理室高级经理、平安集团法律合规部总经理室高级经理。王女士获得同济大学工商管理硕士学位。

杨敬东，2019年12月起担任本公司董事，2018年10月起担任公司执行委员会委员。杨先生2014年9月加入本公司，曾任办公室总经理、机构业务管理部总经理、销售交易事业部总经理、公司总经理助理等职务。此前，曾任平安银行人力资源部副总经理、平安银行广州私人银行总经理等职务。杨先生获得复旦大学EMBA学位。杨先生于2021年当选深圳市福田区第八届人大代表。

朱益勇，2020年7月起担任公司董事，2018年10月起担任公司执行委员会委员、董事会秘书。朱先生2011年加入本公司，曾任平安证券人力资源部副总经理、总经理、人力资源总监以及总经理助理等职。此前曾任平安寿险黑龙江分公司人事部室经理、平安寿险吉林分公司人力资源部部门经理、平安渠道人力资

源经理。朱先生获得黑龙江商学院会计学学士学位。

DAVID XIANGLIN LI (李祥林), 2021 年 11 月起担任本公司独立董事。2017 年 7 月至今, 任上海交通大学高级金融学院教授、中国金融研究院副院长、风险管理研究中心主任、金融科技研究中心主任、金融硕士项目联席负责人; 2021 年 1 月至今, 任陆金所独立董事。之前, 李先生曾在加拿大帝国商业银行、Risk Metrics 集团/摩根大通、AXA Financial、花旗集团、巴克莱资本、中金公司、AIG 资产管理、保诚信金融等企业担任管理岗位。李先生获得加拿大滑铁卢大学统计博士学位。

李伟东, 2016 年 9 月起担任本公司独立董事。2003 年 7 月至今, 任广东海派律师事务所主任。1992 年 9 月至 1994 年 1 月, 任南京中山律师事务所律师; 1994 年 2 月至 1997 年 4 月, 任江苏省经纬律师事务所律师。李先生获得香港城市大学法学院国际金融法博士学位。

张旭东, 2017 年 1 月起担任本公司独立董事。2018 年至今, 担任华控清交信息科技(北京)有限公司董事长兼首席执行官。之前, 张旭东先生曾任职于世德亚太控股有限公司、高盛集团、德意志银行、美国科氏工业集团及美国第一波士顿银行等企业, 并曾任中国证券监督管理委员会资产证券化领导小组顾问、中国国家开发银行资产证券化顾问等。张先生获得美国南新罕普什尔大学经济学硕士学位。

巢傲文, 2018 年 1 月起担任本公司监事会主席。2016 年 2 月至 2021 年 11 月 3 日期间, 任平安集团稽核监察部高级稽核经理, 自 2021 年 11 月 11 日起, 任平安不动产稽核监察部总经理。巢先生还曾担任广东南粤银行稽核部总经理, 平安银行(原深圳发展银行)稽核监察部总经理助理等职务。巢先生获得江西财经大学工业经济学硕士学位。

许黎, 2014 年 11 月起担任本公司监事。2017 年 7 月至今, 任平安金服稽核

监察项目中心银行投资审计部副总经理。许女士 2003 年 7 月至 2017 年 6 月，先后就职于平安寿险广东分公司稽核监察部、平安集团稽核监察部、合规部、平安金服稽核监察项目中心稽核咨询服务部。许女士获得中南财经政法大学法学和经济学学士学位。

朱勤保，毕业于苏州经济干部管理学院，大专学历，高级经济师。2007 年 9 月起担任本公司监事。1970 年 11 月参加工作，历任常熟农机厂苏州地区机械厂工人、支部书记、全质办负责人，国营常熟制冷设备厂副厂长、党委书记兼厂长，现任江苏白雪电器股份有限公司董事长。

卫淑琴，2011 年 2 月起担任本公司职工代表监事。2016 年 4 月至今，任公司稽核监察部总经理。卫女士于 1998 年加入本公司，曾先后任职于公司研究咨询部、财务企划部。卫女士获得南开大学经济学硕士学位。

杨润莲，2016 年 9 月起担任本公司职工代表监事。2014 年 3 月至今，任本公司办公室经理。杨女士于 1997 年 6 月加入平安集团，任职于组织人事部；2001 年 6 月至 2005 年 4 月，任平安集团人力资源中心经理；2005 年 6 月至 2014 年 3 月，任平安集团人力资源中心员工服务管理部经理。杨女士获得汕头大学文学学士学位。

郑霞，2018 年 10 月起担任公司执行委员会委员。郑女士 2014 年 4 月加入本公司，历任行政部总经理、办公室总经理、经纪事业部总经理、总经理助理等职务。此前，郑女士曾任侨兴电讯有限公司总经理助理、平安银行总行零售业务综合开拓部总经理、平安银行零售银行部副总经理等职务。郑女士获得浙江大学自动化仪表及应用专业学士学位及 MBA 学位。

于春洪，2018 年 10 月起担任公司执行委员会委员。于先生 2006 年 8 月加入本公司，历任债券融资部执行董事总经理、地方政府平台与国有企业债券部董事总经理、北京分公司总经理（兼任）、公司总经理助理等职务。此前，曾任长

城证券股份有限公司投行部质量控制部副总经理、投行部北京三部总经理。于先生获得首都经贸大学经济信息管理学学士学位。

吕涛，2020年4月起担任公司执行委员会委员。吕先生2020年加入平安证券，曾任总经理助理职务。此前曾担任中信建投证券股份有限公司资产管理部董事总经理、中信保诚基金管理有限公司总经理、中信资产管理公司副总经理、中信证券股份有限公司资产管理部总经理等职务。吕先生获英国克拉费尔德大学管理学硕士学位。

袁玉平，2020年11月起担任公司执行委员会委员。袁先生2020年1月加入平安证券，曾担任总经理助理职务。此前，袁先生曾先后担任联合证券有限责任公司投资银行部经理、中国证券监督管理委员会发行监管审核二处处长、兴业证券董事长助理兼合规总监、董事长助理兼投资银行事业部总经理、总裁助理兼投行质控部总经理等职务。袁先生获中国社科院金融研究所经济学博士学位。

邹丽，2020年7月起担任公司执行委员会委员、首席风险官。邹女士2006年8月加入平安证券，先后担任固定收益事业部结构性产品部执行总经理、债券资本市场部执行总经理、运营管理团队执行总经理、投资银行事业部质量控制部董事总经理（行政负责人），曾兼任产品中心董事总经理（行政负责人）。2000年7月至2006年7月，曾担任长城证券股份有限公司投资银行事业部资本市场执行总经理。邹女士获北京大学金融专业经济学硕士学位。

胡益民，2017年1月起担任公司合规总监，2018年8月13日起，担任公司执行委员会委员、合规总监。胡先生2016年3月加入本公司，担任首席投行内核官。胡先生自2002年以来，先后在中国证监会、全国中小企业股份转让系统有限公司工作。胡先生获得中国人民大学民商法硕士学位。

张朝晖，2019年10月起担任公司执行委员会委员、首席信息官。张先生2014年加入平安证券，担任公司信息技术总监职务。此前曾担任波士顿银行信息技术部程序主管、德意志银行信息技术部副总监、瑞士信贷信息技术部总监、美国银

行信息技术部（全球固定收益电子交易业务）董事总经理等职务。张先生获巴鲁克大学金融商业管理硕士学位。

罗琦，2021年6月起担任公司财务负责人。罗先生2018年3月加入平安证券，担任公司财务总监。此前曾担任平安人寿传统产品室精算经理、平安集团财务企划中心银行投资企划室经理、企划部高级项目经理等职务。罗先生获武汉大学数学学院计算数学及其应用软件专业学士学位。

## 2、集合计划投资经理

朱燕琼，现任平安证券资产管理事业部固定收益团队投资经理，北京大学经济学硕士。2013年-2014年就职于埃克森美孚（中国）投资有限公司，担任财务分析师。2014年-2017年就职于兴业信托，担任资产管理部投资经理。2017年加入平安证券资产管理事业部，自2017年8月31日起担任平安证券现金宝集合资产管理计划、平安证券稳健资本一号7期集合资产管理计划投资经理至今。

姜杰特，现任平安证券资产管理部固定收益团队投资经理，华东师范大学金融硕士。2014年7月至2015年10月就职于江海证券有限公司，担任债券融资承做经理，2015年11月加入平安证券股份有限公司，曾任固定收益投资经理助理。自2017年9月28日起至今担任平安证券稳健资本一号集合资产管理计划投资经理。自2017年9月28日起至2019年7月10日担任平安证券橙明1号集合资产管理计划投资经理、平安证券橙明2号集合资产管理计划、平安证券橙明3号集合资产管理计划投资经理。自2017年9月28日起至2018年12月25日担任平安证券橙明4号集合资产管理计划投资经理。自2017年9月28日起至2018年11月7日担任平安证券橙金1号集合资产管理计划投资经理。自2018年3月12日起至2018年11月25日担任平安证券安稳1号集合资产管理计划投资经理。自2020年3月6日起至今担任平安证券现金宝集合资产管理计划投资经理。

秦石，现任平安证券资产管理事业部权益投资团队投资经理，上海交通大学

硕士。2012年3月-2015年6月就职于东方证券股份有限公司自营部，从事二级市场研究，历任研究员、研究组长。2015年9月-2016年12月就职于鹰海医疗信息技术有限公司，职位总经理助理，负责投融资工作。2017年1月-2019年10月，就职于寻常投资有限公司，担任资深研究员。2019年10月加入平安证券资产管理事业部，担任投资经理。自2020年5月1日起至2021年4月29日担任平安证券集合-强债1-10号投资经理。2020年6月19日至2021年3月16日担任平安证券成长1-3号FOF集合资产管理计划投资经理。2021年1月26日至2021年4月29日担任平安证券集合-信享添利1号投资经理。

### 3、大集合投资决策委员会成员

平安证券股份有限公司大集合投资决策委员会的成员包括：主任委员秦石先生（投资经理）、常任委员朱燕琼女士（投资经理）、姜杰特先生（投资经理）。

### 4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 三、管理人的职责

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

（2）办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金；

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

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

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

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

（7）依法接受集合计划托管人的监督；

（8）采取适当合理的措施使计算集合计划份额申购、赎回和注销价格的方

法符合《资产管理合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告集合计划净值信息，确定集合计划份额申购、赎回的价格；

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议;

(25) 建立并保存集合计划份额持有人名册;

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

#### 四、管理人承诺

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

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

(1) 将集合计划管理人固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资;

(2) 不公平地对待管理的不同集合计划财产;

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

(4) 向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5) 侵占、挪用集合计划财产;

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

(7) 玩忽职守,不按照规定履行职责;

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、集合计划管理人承诺严格遵守资产管理合同,并承诺建立健全内部控制制度,采取有效措施,防止违反资产管理合同行为的发生;

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

5、集合计划管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

## 五、集合计划投资经理承诺

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

2、不利用职务之便为自己、受雇人或任何第三者牟取利益；

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

4、不得以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 六、集合计划管理人的内部控制制度

### 1、内部控制和风险管理制度的综述

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

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

### 2、风险管理原则

（1）独立制衡原则：风险管理职能部门独立于公司其他部门，开展客观、独立的风险管理工作。在兼顾高效的基础上，对治理架构、业务流程、岗位设置等方面形成相互制约、互为监督的平衡机制。

（2）权责分明原则：公司通过政策、制度等方式，设立风险管理各防线、各层级、岗位明确的权责范围，各类人员应在岗位权责内开展充分、审慎风险管理或评估工作。

（3）客观透明原则：公司各部门对风险管理信息保持充分沟通，并建立顺畅有效的风险事项汇报机制。风险管理决策能够接受合理的质疑，且决策依据客观、公开、透明。

### 3、风险管理和内部风险控制体系

### （1）风险管理体系

公司风险管理组织架构由董事会及下设的风险控制委员会、经理层及风险管理委员会、风险管理职能部门、各业务部门四个层级构成。具体而言，包括如下组成部分：

#### 1) 董事会

公司风险管理的最高决策机构，承担公司风险管理的最终责任。负责推进风险文化建设；根据公司资本实力和经营战略，审议批准公司风险偏好、风险容忍度、重大风险限额、公司风险管理战略、重要的风险管理政策以及全面风险管理的基本制度；持续关注公司风险状况，定期审议风险评估报告，及时了解风险水平及管理状况；任免、考核首席风险官，确定其薪酬待遇，建立与首席风险官的直接沟通机制；监督经理层落实公司风险管控的有效性；公司章程规定的其他风险管理职责。

董事会可授权其下设的风险控制委员会履行其全面风险管理的部分职责，风险控制委员会就上述事项向董事会提供决策支持。

#### 2) 监事会

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

#### 3) 经理层

公司经理层承担全面风险管理的主要责任。

#### 4) 风险管理委员会

风险管理委员会协助公司经理层在董事会授权范围内审定重大风险限额和重要业务权限，评估和决策重大投融资项目和风险应急事项，监督指导公司全面风险管理的有效实施等。

#### 5) 首席风险官

公司设立首席风险官，负责公司全面风险管理工作。

#### 6) 各业务部门、分支机构

公司各业务部门、分支机构履行直接的风险管理职责，承担本部门风险管理的第一责任。

公司采取派驻式风险管理组织架构，在各业务部门、分支机构内嵌风险管理

团队。各风险管理团队的负责人应在首席风险官指导下开展风险管理工作，向首席风险官履行风险报告义务，并由首席风险官考核。

#### 7) 风险管理部

公司设立风险管理部，负责拟定公司风险管理政策、制度、流程和方法，提出风险管理系统建设和风险文化建设方案；拟定公司总体和各业务部门、分支机构及子公司的各类风险预算和风险限额，并在授权范围内进行风险决策；对公司各业务部门、子公司及分支机构各项风险管理相关制度的制定、修订、废止等进行审核评估；牵头识别、计量公司的市场风险、信用风险，协助识别、计量流动性风险；监测、预警各业务部门、分支机构及子公司的市场风险、信用风险的限额遵守情况，监控公司净资本等风险控制指标状况；评估、报告公司整体风险水平，分析风险的关联性，形成公司风险评估报告；评估对公司有重大影响的业务、项目和产品风险，参与重大风险事项应急处置等。

#### 8) 稽核监察部

稽核监察部负责将全面风险管理纳入内部审计范畴，对全面风险管理的充分性和有效性进行独立、可观的审查和评价，向董事会、监事会、经理层提交审计报告。对内部审计发现的问题，督促相关责任人及时整改，并跟踪检查整改措施的落实情况。

### (2) 合规管理体系

公司建立涵盖董事会、监事会、经营管理层、下属各单位及全体员工的全方位的合规管理架构体系，履行公司各项合规管理职责，落实公司合规管理目标，承担合规运营责任。

1) 公司董事会决定公司的合规管理目标，对合规管理的有效性承担责任。

2) 公司监事会对董事、高级管理人员履行合规管理职责的情况进行监督，对发生重大合规风险负有主要责任或者领导责任的董事、高级管理人员提出罢免的建议。

3) 公司高级管理人员负责落实合规管理目标，对合规运营承担责任。

4) 公司下属各单位负责人负责落实本单位的合规管理目标，对本单位合规运营承担责任。

5) 公司设合规总监，合规总监是高级管理人员，直接向董事会负责。公司

合规总监对公司及全体员工的经营管理和执业行为的合规性进行审查、监督和检查。

公司建立合规问责机制，对在经营管理及执业过程中违反法律、法规和准则的责任人或责任单位进行合规问责。

法律合规部及各事业部合规管理部为公司专职的合规管理部门，对合规总监负责，按照公司规定和合规总监的安排履行合规管理职责。合规总监、法律合规部及合规管理人员按照法律法规和准则要求独立履行合规管理职责。公司明确法律合规部与其他内部控制部门之间的职责分工，并建立内部控制部门协调互动的工作机制。

法律合规部为公司各项业务合规开展提供支持，通过推进公司合规制度、流程建设，促进业务稳健发展；通过建立健全合规管理机制，实现对合规风险的有效识别和管理，促进全面合规管理体系建设，确保依法合规经营；通过开展法律合规评审、合规检查、合规宣导培训等合规管理工作，监督公司内部规章制度的贯彻执行以及公司经营活动的合规开展；减少或杜绝因遭受监管处罚和法律诉讼而导致财务损失的可能，持续提升公司声誉和品牌价值。

#### 4、风险管理和内部风险控制的措施

(1) 建立、健全内控体系，完善内控制度。公司建立、内控结构，高管人员关于内控有明确的分工，确保各项业务活动有恰当的组织授权，确保风险管理工作有序开展。

(2) 建立相互分离、相互制衡的内控机制。公司建立、健全各项制度，大集合与小集合投资经理分开、投资决策分开、交易集中，形成不同岗位的制衡机制，从制度上减少和防范风险。

(3) 建立、健全岗位责任制。公司建立、健全了岗位责任制，每个员工明确自己的任务、职责，并及时将各自工作领域中的风险隐患上报，以防范和减少风险。

(4) 建立风险分类、识别、评估、报告、提示程序。公司建立了自下而上的风险报告程序，对风险隐患进行层层汇报，使各层级的人员及时掌握风险状况，从而以最快速度做出决策。

(5) 建立内部监控系统。公司建立了有效的内部监控系统，对可能出现的各

---

---

种风险进行全面和实时的监控。

#### 5、集合计划管理人关于内部合规控制声明书

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

## 第四部分 集合计划的托管人

### 一、基本情况

名称：中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）

注册地址：北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层

成立时间：1987年4月20日

法定代表人：朱鹤新

注册资本：489.35亿元人民币

联系电话：4006800000

联系人：中信银行资产托管部

### 二、主要人员情况

方合英先生，中信银行执行董事、行长兼财务总监。方先生于2018年9月加入中信银行董事会。方先生自2014年8月起任中信银行党委委员，2014年11月起任中信银行副行长，2017年1月起兼任中信银行财务总监，2019年2月起任中信银行党委副书记。方先生现同时担任信银（香港）投资有限公司、中信银行（国际）有限公司及中信国际金融控股有限公司董事。此前，方先生于2013年5月至2015年1月任中信银行金融市场业务总监，2014年5月至2014年9月兼任中信银行杭州分行党委书记、行长；2007年3月至2013年5月任中信银行苏州分行党委书记、行长；2003年9月至2007年3月历任中信银行杭州分行行长助理、党委委员、副行长；1996年12月至2003年9月在中信银行杭州分行工作，历任信贷部科长、副总经理，富阳支行行长、党组书记，国际结算部副总经理，零售业务部副总经理，营业部总经理；1996年7月至1996年12月任浦东发展银行杭州城东办事处副主任；1992年12月至1996年7月在浙江银行学校实验城市信用社信贷部工作，历任信贷员、经理、总经理助理；1991年7月至1992年12月在浙江银行学校任教师。方先生为高级经济师，毕业于北京大学，获高级管理人员工商管理硕士学位，拥有二十余年中国银行业从业经验。

谢志斌先生，中信银行副行长，分管托管业务。谢先生自2019年6月起担任中信银行副行长，自2019年2月起担任中信银行党委委员。此前，谢先生于2015年7月至2019年1月任中国光大集团股份公司纪委书记、党委委员。2012年3月至2015年7月任中国出口信用保险公司总经理助理，期间于2014年1月至2015年7月挂职任内蒙古自治区呼和浩特市委常委、副市长。2011年3月至

2012年3月任中国出口信用保险公司党委委员、总经理助理。2001年10月至2011年3月历任中国出口信用保险公司人力资源部职员、总经理助理、副总经理、总经理（党委组织部部长助理、副部长、部长），深圳分公司党委书记，河北省分公司负责人、党委书记、总经理。1991年7月至2001年10月历任中国人民保险公司科员、主任科员、副处长。谢先生为经济师，毕业于中国人民大学，获经济学博士学位。

杨璋琪先生，中信银行资产托管部副总经理（主持工作），硕士研究生学历。杨先生2018年1月至2019年3月，任中信银行金融同业部副总经理；2015年5月至2018年1月，任中信银行长春分行副行长；2013年4月至2015年5月，任中信银行机构业务部总经理助理；1996年7月至2013年4月，就职于中信银行北京分行（原总行营业部），历任支行行长、投资银行部总经理、贸易金融部总经理。

### 三、基金托管业务经营情况

2004年8月18日，中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准，取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，切实履行托管人职责。

截至2021年年底，中信银行托管263只公开募集证券投资基金，以及基金公司、证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产，托管总规模达到11.4万亿元人民币。

### 四、托管人的内部控制制度

1、内部控制目标。强化内部管理，确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行；建立完善的规章制度和操作规程，保证基金托管业务持续、稳健发展；加强稽核监察，建立高效的风险监控体系，及时有效地发现、分析、控制和避免风险，确保基金财产安全，维护基金份额持有人利益。

2、内部控制组织结构。中信银行总行建立了风险管理委员会，负责全行的风险控制和风险防范工作；托管部内设内控合规岗，专门负责托管部内部风险控制，对基金托管业务的各个工作环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核监察。

3、内部控制制度。中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定，以控制和防范基金托管业务风险为主线，制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业

---

---

务内控检查实施细则》等一整套规章制度，涵盖证券投资基金托管业务的各个环节，保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发展。

4、内部控制措施。建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规范等，从制度上、人员上保证基金托管业务稳健发展；建立了安全保管基金财产的物质条件，对业务运行场所实行封闭管理，在要害部门和岗位设立了安全保密区，安装了录像、录音监控系统，保证基金信息的安全；建立严密的内部控制防线和业务授权管理等制度，确保所托管的基金财产独立运行；营造良好的内部控制环境，开展多种形式的持续培训，加强职业道德教育。

#### 五、托管人对管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定，对基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金托管人发现基金管理人重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

---

---

## 第五部分 相关服务机构

### 一、集合计划销售机构

#### 1、平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座 22-25 层

办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座 22-25 层。

法定代表人：何之江

统一社会信用代码： 914403001000234534

组织形式：非上市股份有限公司

联系电话： 95511

联系人： 刁安然

传真：

集合计划管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售本集合计划，并在管理人网站公示。

### 二、集合计划登记机构

#### 1、中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人： 戴文华

统一社会信用代码： 91100000710927994X

组织形式： 其他有限责任公司

联系电话： 010-50938782

联系人： 赵亦清

传真： 010-50938991

### 三、出具法律意见书的律师事务所与经办律师：

---

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：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

联系电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：丁媛

经办律师：黎明、丁媛

#### 四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

负责人：毛鞍宁

联系电话：0755-23385651

传真：0755-25026156

联系人：罗佳

经办会计师：罗佳

---

---

## 第六部分 集合计划的历史沿革

本集合计划由原平安证券稳健资本一号集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。

原集合计划为非限定性集合资产管理计划，2011年8月5日经中国证监会证监许可【2011】1239号核准设立，自2011年10月11日起开始募集，于2011年11月11日结束募集工作，并于2011年11月18日正式成立。

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

经中国证监会批准，自2021年5月12日起，《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《平安证券稳健资本一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

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

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

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

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

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

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

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

A 类计划份额每个开放日办理集合计划份额的赎回，B、C、D 类计划份额每个运作期到期日，集合计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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

管理人不得在资产管理合同约定之外的日期或者时间办理集合计划份额的

申购、赎回或者转换。投资者在资产管理合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，该申购、赎回或转换申请视为下一开放日提出的有效申购、赎回或转换申请，但投资者不能对 A 类计划份额提出申购申请，仅能在运作期到期日对 B、C、D 类计划份额提出赎回申请。

### 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内（资产管理合同另有约定的除外）提出申购或赎回的申请。

#### 2、申购和赎回的款项支付

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

集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；集合计划份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或资产管理合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照资产管理合同有关条款处理。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至前述因素消除后的下一个工作日划出。

### 3、申购和赎回申请的确认

管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），在正常情况下，登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请，投资人可在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项本金退还给投资人。管理人可以在法律法规允许的范围内，在不对份额持有人利益造成损害的前提下，对上述业务办理时间进行调整，并在调整开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

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

### 五、申购和赎回的数量限制

#### 1、申购金额的限制

A类计划份额不开放申购；B类计划份额投资人首次申购的最低金额为【1】元，单笔申购的最低金额为【1】元；C类计划份额投资人首次申购的最低金额为【500,000】元，单笔申购的最低金额【100】元；D类计划份额投资人首次申购的最低金额为【10,000,000】元，单笔申购的最低金额【1,000】元。各销售机构对本集合计划最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

#### 2、赎回份额的限制

集合计划份额持有人可将其全部或部分集合计划份额赎回。单笔赎回申请最低份额为【1】份，若某集合计划份额持有人赎回时在销售机构保留的集合计划份额不足【1】份，则该次赎回时必须一起赎回。

3、管理人可以规定投资人每个集合计划交易账户的最低集合计划份额余额，具体规定请参见相关公告。

4、管理人可以规定单个投资人累计持有的集合计划份额上限，具体规定请参见相关公告。

5、当接受申购申请对存量集合计划份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或集合计划单日净申购比例上

限、拒绝大额申购、暂停集合计划申购等措施，切实保护存量集合计划份额持有人的合法权益。管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对集合计划规模予以控制。具体见管理人相关公告。

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

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、申购费用

本集合计划 A 类份额不开放申购。管理人仅办理本集合计划 B、C、D 类份额的申购业务，B、C、D 类集合计划份额均不收取申购费用。

### 2、赎回费用

本集合计划 A 类份额，每个开放日办理赎回。

每个运作期到期日，B、C、D 类集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果 B、C、D 类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工作日起该计划份额进入下一个运作期。

赎回费用由赎回 A、B、C、D 类份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。本集合计划 A 类份额对持有时间少于 7 日的该类集合计划份额持有人收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入集合计划资产。A 类份额持有期限自原集合计划份额确认日起连续计算。

本集合计划 B、C、D 类份额因设置最短持有期限，不收取赎回费。

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

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

5、管理人可以在不违反法律法规规定及资产管理合同约定且对存量集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定促销计划，定期或不定期地开展促销活动。在促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续

后，管理人可以适当调低集合计划的销售费用。

## 七、申购份额和赎回金额的计算

### 1、申购份额的计算

本集合计划 A 类计划份额不开放申购。管理人在开放日办理集合计划 B、C、D 类计划份额的申购，申购的有效份额为净申购金额除以当日该类集合计划份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

B、C、D 类集合计划份额的申购份额计算方法如下：

申购份额=申购金额/申购当日该类集合计划份额净值

例 1：假设 T 日 C 类集合计划份额净值为 1.0150 元，某投资人投资 10 万申购本集合计划 C 类集合计划份额，则可得到的申购份额为：

申购份额=100,000/1.0150=98,522.17 份

即：该投资人投资 10 万元申购本集合计划 C 类集合计划份额，假设申购当日本集合计划 C 类集合计划份额净值为 1.0150 元，则其可得到 98,522.17 份该类集合计划份额。

### 2、赎回金额的计算

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

赎回金额的计算方法如下：

赎回费用=赎回份额×T 日该类集合计划份额净值×相应的赎回费率

赎回金额=赎回份额×T 日该类集合计划份额净值-赎回费用

例 2：某投资人赎回 10,000 份 D 类集合计划份额，假设该份额于运作期到期日赎回，对应的赎回费率为 0%，假设赎回当日 D 类集合计划份额净值为 1.2500 元，则其获得的赎回金额计算如下：

赎回费用=0 元

赎回金额=10,000×1.2500-0=12500.00 元

即：投资人赎回 10,000 份 D 类集合计划份额，假设赎回当日 D 类集合计划份额净值为 1.2500 元，则可得到赎回金额 12500.00 元。

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

#### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

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

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

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。
- 5、发生继续接受赎回申请将损害现有集合计划份额持有人利益的情形时，管理人可暂停接受集合计划份额持有人的赎回申请。
- 6、当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受集合计划赎回申请。
- 7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

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

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，管理人应当通过邮寄、传真或者管理人网站等方式在 3 个交易日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在指定媒介上刊登公告。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，管理人应在规定期限内在规定媒介上

刊登暂停公告。

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

## 十二、集合计划转换

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

## 十三、集合计划的非交易过户

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

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

## 十四、集合计划的转托管

集合计划份额持有人可办理已持有集合计划份额在不同销售机构之间的转托管，销售机构可以按照规定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、集合计划的冻结和解冻与质押

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

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

## 十七、集合计划份额的转让

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

## 十八、实施侧袋机制期间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”部分的规定。

## 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,力求实现计划资产的长期稳定增值,为投资者实现超越业绩比较基准的收益。

### 二、投资范围

本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、信用衍生品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)。

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

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

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

### 三、投资策略

精选信用债做底仓配置,在获取稳健收益的基础上,通过债券波段操作、利率中性策略交易、权益资产投资等方式博取超额收益。本集合计划投资策略具有攻守兼备的特点,在谨慎投资的基础上,力争实现组合的稳健增值。

具体策略:

#### 1、大类资产轮动投资策略

大类资产配置采用自上而下的投资视角,定性分析与定量分析并用,结合国内外政治经济环境、宏观政策、利率变化等,合理确定在不同类别债券、货币市

场工具、可转债、衍生品等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整投资于各类债券、货币市场工具等资产的比例与期限结构。

## 2、债券久期及骑乘策略

通过对宏观经济形势、财政及货币政策、利率环境、债券市场资金供求等因素的分析，主动判断利率和收益率曲线可能移动的方向和方式，并据此确定固定收益资产组合的平均久期。原则上，利率处于上行通道时，缩短目标久期；利率处于下降通道时，则延长目标久期。

## 3、利率中性策略

利率中性策略是指一系列旨在利用各种固定收益证券或固定收益衍生工具估值和走势差异构建多空头寸，在基本维持久期中性的条件下，实现跨期限、跨品种以及在相同品种不同标的之间套利的投资策略，包括但不限于曲线平陡策略、国债与政策性金融债税差策略、国债期货与利率债的基差策略等。

## 4、杠杆套利策略

买入债券资产，将债券资产质押通过交易所或银行间回购融入资金，并将融入资金继续投资于债券资产，放大资产规模，获取债券资产收益率与资金成本间的利差，实现杠杆套利。

## 5、资产支持证券投资策略

通过对资产支持证券的信用风险、资产池现金流变化、流动性溢价、提前偿付风险等因素的分析，对资产支持证券的投资价值进行综合评估，精选信用风险可控、绝对收益率较有优势的资产支持证券标的，控制资产占比，在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合收益。

## 6、国债期货投资策略

本集合计划在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，以流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货定价模型寻求其合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。集合管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险；利用金融衍生品的杠杆作用以达到降低投资组合的整体风险的目的。

## 7、信用债投资策略

本集合计划对信用债投资采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。信用债的收益率由无风险利率和信用利差两部分构成，通过自上而下对宏观经济、政策环境等因素的分析判断无风险利率走势，通过自下而上运用行业研究方法、财务分析方法等对债券发行人的信用风险进行评估，选择风险收益比更优的投资标的。本集合计划将采用以下投资策略：

### （1）信用分析策略

本集合计划将以内部信用评级为主，研究债券发行人所处行业的景气度、市场竞争地位、盈利能力、偿债能力、现金流、外部支持等要素，综合评估发行人的基本面情况，谨慎选择基本面良好、信用利差合理的投资标的。通过投资、信用、风险团队建立投前、投中、投后三道防线，把控信用风险，选取高性价比的行业个券。

### （2）信用利差曲线策略

分析宏观经济周期、政策环境、市场结构、流动性、信用利差历史统计数据等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值 and 风险以及信用利差曲线的未来走势，并结合流动性、息票率、提前偿付与赎回等，确定信用债的配置。

## 8、可转债博弈及套利策略

可转债因内含期权价值使其与公司股票价格走势和波动率水平密切相关。通过对转债对应正股进行深入研究，采用定性分析（行业地位、竞争优势、治理结构、市场开拓、创新能力等）与定量分析（P/B、P/E、PEG、DCF、DDM、NAV等）相结合的方式精选成长性好且估值合理的正股，同时考虑证券市场的环境，在对应转债估值合理的前提下集中投资，以分享正股上涨带来的收益。

本集合计划投资于可转债及可交债的比例为资产净值的 0-20%。

## 9、权益投资策略

（1）聚焦成长期行业和成熟期行业龙头。通过对各行业生命周期的分析，重点研究处于成长期的细分行业，以及成熟期行业的龙头企业。成长期行业的需求处于快速爆发阶段，产品渗透率快速提升，整个行业都有巨大的机遇。成熟期行业需求稳定，龙头企业依靠其各方面的优势不断提升市场份额，也有巨大的发

展空间。

(2) 精选优势企业。在重点行业或领域内，通过对企业行业背景、市场地位、产销规模、核心技术、股东和管理层情况、持续经营与盈利能力等各方面的研究，选择管理优秀、竞争力突出的优势企业。我们关注这种优势的本质，更关注企业维持优势的持续性，与善良、诚实、勤奋的优秀企业为伍。

(3) 通过对估值和景气的分析寻找买点。在优选行业和优势企业的基础上，结合标的的估值水平和景气变化，寻找投资时机，力争在控制风险的情况下，获取优质资产。

(4) 量化手段控制风险。基于风险溢价模型建立了一套系统化的量化手段评估市场风险，并在此基础上进行大类资产配置调整和决定股票整体仓位，以此来淡化主观情绪波动带来的贪婪与恐惧。

#### 四、投资限制

##### 1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

(1) 本计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的 80%；

(2) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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

(4) 管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

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

1) 本集合计划投资于 AAA 信用评级的信用债的比例不低于全部信用债资产的 30%；

2) 本集合计划投资于 AA+信用评级的信用债的比例不超过全部信用债资产

的 70%；

3) 本集合计划投资于 AA 信用评级的信用债的比例不超过全部信用债资产的 20%；

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

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

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

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

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

(13) 管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的公开募集性质的集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(14) 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；

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

(16) 集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的 140%；

(17) 本集合计划参与国债期货投资，应遵循下列限制：

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）应当符合资产管理合同关于债券投资比例的有关约定；

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

(18) 本计划不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品，不持有合约类信用衍生品；

(19) 本计划持有的信用衍生品名义本金不得超过本计划中所对应受保护债券面值的 100%；

(20) 本计划投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品名义本金合计不得超过计划资产净值的 10%；

(21) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（10）、（14）、（15）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。

管理人应当自资产管理合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。在上述期间内，本集合计划的投资范围、投资

策略应当符合资产管理合同的约定。托管人对集合计划的投资的监督与检查自本合同生效之日起开始。

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

## 2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

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

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交管理人董事会审议，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资产管理合同进行变更，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：中债综合财富（总值）指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%

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

## 六、风险收益特征

本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。

## 七、管理人代表集合计划行使相关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相关权利，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资产管理合同的约定启用侧袋机制。

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

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

---

---

## 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集合计划登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。

### 四、集合计划财产的保管和处分

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

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

---

---

## 第十一部分 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、股票、国债期货合约、信用衍生品和银行存款本息、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

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

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

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

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

（三）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

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

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

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

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

#### 5、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

#### 6、同业存单的估值方法

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

7、本集合计划投资国债期货，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

#### 8、信用衍生品估值方法

信用衍生品按照第三方估值机构提供的当日估值价格进行估值，但管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除。

选定的第三方估值机构未提供估值价格的，依照有关法律法规及企业会计准则的要求采用合理估值技术确定其公允价值。

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

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

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

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

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

## 五、估值程序

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

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

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

## 六、估值错误的处理

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

资产管理合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

(2) 错误偏差达到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) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4、中国证监会和资产管理合同认定的其它情形。

## 八、集合计划净值的确认

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

## 九、特殊情形的处理

1、管理人或托管人按估值方法的第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。

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

## 十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

---

---

## 第十二部分 集合计划的收益与分配

### 一、集合计划利润的构成

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

### 二、集合计划可供分配利润

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

### 三、集合计划收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可进行收益分配，具体分配方案以公告为准；

2、本集合计划收益分配方式为：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、由于本计划各份额类别收取的销售服务费不同，各份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本计划同一类别的每一计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

### 六、集合计划收益分配中发生的费用

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

计划份额。

#### 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。

## 第十三部分 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、计划份额的销售服务费；
- 4、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 5、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、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《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、管理人的管理费

本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 0.4%年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times \text{管理费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，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。

#### 2、托管人的托管费

本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05%年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times \text{托管费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划托管费划付指令，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。

### 3、销售服务费

本计划 A 类及 D 类计划份额不收取销售服务费，B 类计划份额的销售服务费年费率为 0.3%，C 类计划份额的销售服务费年费率为 0.1%。本计划销售服务费主要用于本计划份额持有人服务等各项费用。销售服务费按前一日 B 类或 C 类计划份额资产净值的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应计提的 B 类或 C 类计划份额销售服务费

E 为前一日的 B 类或 C 类计划份额的资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送集合计划销售服务费划付指令，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划出。若遇法定节假日、公休日等，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、《资产管理合同》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、实施侧袋机制期间的集合计划费用

本集合计划实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取

---

---

管理费，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### 五、集合计划税收

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

对于集合计划份额持有人必须自行缴纳的税收，由集合计划份额持有人自行负责，管理人和托管人不承担代扣代缴或纳税的义务。

---

---

## 第十四部分 集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

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

### 二、集合计划的年度审计

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

## 第十五部分 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》、《资产管理合同》及其他有关规定。

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

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

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

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的集合计划信息

公开披露的集合计划信息包括：

（一）集合计划招募说明书、《资产管理合同》、集合计划托管协议、产品资料概要

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

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

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

4、产品资料概要是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。《资产管理合同》生效后，产品资料概要的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新产品资料概要，并登载在规定网站及销售机构网站或营业网点；产品资料概要其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新集合计划产品资料概要。

经中国证监会批准后，管理人将集合计划招募说明书提示性公告和《资产管理合同》提示性公告登载在规定报刊上，将集合计划招募说明书、产品资料概要、

《资产管理合同》和集合计划托管协议登载在规定网站上，并将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《资产管理合同》、集合计划托管协议登载在网站上。

（二）《资产管理合同》生效公告

管理人在规定媒介上登载《资产管理合同》生效公告。

（三）集合计划净值信息

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

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

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

#### （四）集合计划份额申购、赎回价格

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

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

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

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

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

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

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

## （六）临时报告

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

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

- 1、集合计划份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《资产管理合同》终止、集合计划清算；
- 3、转换集合计划运作方式、集合计划合并；
- 4、更换管理人、托管人、集合计划份额登记机构，集合计划改聘会计师事务所；
- 5、管理人委托服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；
- 6、管理人、托管人的法定名称、住所发生变更；
- 7、管理人变更持有百分之五以上股权的股东、管理人的实际控制人变更；
- 8、管理人的高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门托管部门负责人发生变动；
- 9、管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，管理人、托管人专门托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；
- 10、涉及集合计划财产、集合计划管理业务、集合计划托管业务的诉讼或仲裁；
- 11、管理人或其高级管理人员、投资经理因集合计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，托管人或其专门托管部门负责人因托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；
- 12、管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；
- 13、集合计划收益分配事项；
- 14、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

- 15、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、管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 22、集合计划信息披露义务人认为可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和资产管理合同约定的其他事项。

#### （七）澄清公告

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

#### （八）集合计划份额持有人大会决议

集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （九）投资资产支持证券信息披露

管理人应在年度报告、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）投资国债期货信息披露

管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，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。

#### （十一）信用衍生品的投资情况

管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告及招募说明书（更新）等文件中详细披露信用衍生品的投资情况，包括投资策略、持仓情况等，并充分揭示投资信用衍生品对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目标及策略。

#### （十二）实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### （十三）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

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

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

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

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

---

终止后 10 年。

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

#### 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，管理人和托管人可暂停或延迟披露集合计划相关信息：

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

## 第十六部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

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

管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并在五个工作日内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《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。

### 二、实施侧袋机制期间集合计划份额的申购与赎回

1、启用侧袋机制当日，登记机构以集合计划份额持有人的原有账户份额为基础，确认相应侧袋账户集合计划份额持有人名册和份额；当日收到的申购申请，按照启用侧袋机制后的主袋账户份额办理；当日收到的赎回申请，仅办理主袋账户的赎回申请并支付赎回款项。

2、实施侧袋机制期间，管理人不办理侧袋账户份额的申购、赎回和转换；同时，管理人按照资产管理合同和招募说明书的约定办理主袋账户份额的赎回，并根据主袋账户运作情况确定是否暂停申购。

3、除管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“集合计划份额的申购与赎回”部分的申购、赎回规定适用于主袋账户份额。巨额赎回按照单个开放日内主袋账户份额净赎回申请超过前一开放日主袋账户总份额的10%认定。

### 三、实施侧袋机制期间的集合计划投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“集合计划的投资”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。管理人计算各项投资运作指标和集合计划业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

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，因资产流动性受限等中国证监会规定的情形除外。

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。

#### 四、实施侧袋机制期间的集合计划估值

本集合计划实施侧袋机制的，管理人和托管人应对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的集合计划净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### 五、实施侧袋账户期间的集合计划费用

1、本集合计划实施侧袋机制的，管理费和托管费按主袋账户集合计划资产净值作为基数计提。

2、与侧袋账户有关的费用可从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费。

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

特定资产以可出售、可转让、恢复交易等方式恢复流动性后，管理人应当按照集合计划份额持有人利益最大化原则，采取将特定资产予以处置变现等方式，及时向侧袋账户份额持有人支付对应变现款项。

侧袋机制实施期间，无论侧袋账户资产是否全部完成变现，管理人都应当及时向侧袋账户全部份额持有人支付已变现部分对应的款项。若侧袋账户资产无法一次性完成处置变现，管理人在每次处置变现后均应按照相关法律法规要求及时发布临时公告。

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，管理人应及时聘请符合《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。

#### 七、侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

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管理人应及时发布临时公告。

##### 2、集合计划净值信息

管理人应按照招募说明书“集合计划的信息披露”部分规定的集合计划净值信息披露方式和频率披露主袋账户份额的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。实施侧袋机制期间本集合计划暂停披露侧袋账户份额净值和累计净值。

---

### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，管理人应当在集合计划定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，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。会计师事务所对集合计划年度报告进行审计时，应对报告期内集合计划侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

---

---

## 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) 信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

(4) 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，集合计划投资于债券，其收益水平会受到利率变化的影响。

(5) 购买力风险。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。

(6) 债券收益率曲线风险。债券收益率曲线风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

(7) 再投资风险。再投资风险反映了利率下降对债券利息收入再投资收益的影响。这与利率上升所带来的价格风险(即前面所提到的利率风险)互为消长。具体为当利率下降时，集合计划从投资的债券所得的利息收入进行再投资时，将获得与之前相比较少的收益率。

#### 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，可能会由于个券的市场流动性相对不足而无法按预期的价格将债券买进或卖出；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债券，以及当集合计划出现巨额赎回，致使没有足够的现金应付赎回支付。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

就 A 类份额而言，不开放申购，每个开放日办理赎回。

就 B、C、D 类计划份额而言：

①每个运作期到期日前，B、C、D 类集合计划份额持有人不能提出赎回申请。

对于 B、C、D 类计划份额的每份申购份额，第一个运作期指该计划份额申购确认日起（即第一个运作期起始日），至计划份额申购确认日满 6 个月对应的月度对日（即第一个运作期到期日）止。第二个运作期指计划份额申购确认日满 12 个月对应的月度对日止，第三个运作期指计划份额申购确认日满 18 个月对应的月度对日止。以此类推。

②每个运作期到期日，B、C、D 类集合计划份额持有人可提出赎回申请

每个运作期到期日，B、C、D 类集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果 B、C、D 类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工作日起该计划份额进入下一个运作期。

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

#### (2) 投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期

货、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、信用衍生品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)。

本集合计划的投资比例限制采用分散投资原则，债券市场容量较大，能够满足本集合计划日常运作要求，不会对市场造成冲击。债券的市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，虽然可以通过投资组合多样化来分散非系统风险，但不能完全规避。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

集合计划出现巨额赎回情形下，管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全部赎回或部分延期赎回。集合计划出现连续巨额赎回情形的，管理人可以暂停赎回，对于已经接受的赎回申请，可以延缓支付赎回款项。同时，如本集合计划单个集合计划份额持有人在单个开放日申请赎回集合计划份额超过集合计划总份额一定比例以上的，管理人有权对其赎回申请实施部分延期办理。投资人具体请参见资产管理合同“第六部分 集合计划份额的申购与赎回”和本招募说明书“第八部分 集合计划份额的申购与赎回”之“十、巨额赎回的情形及处理方式”，详细了解本集合计划巨额赎回情形下的流动性风险管理措施。

### （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资产管理合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停集合计划估值、摆动定价、实施侧袋机制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，管理人将严格依照法律法规及资产管理合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户

进行处置清算，并以处置变现后的款项向集合计划份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但集合计划启用侧袋机制后，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，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有集合计划份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应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。

实施侧袋机制期间，因本集合计划不披露侧袋账户份额的净值，即便管理人在定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，管理人不承担任何保证和承诺的责任。

管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，管理人计算各项投资运作指标和集合计划业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，集合计划业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本集合计划披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

#### 4、特定风险

(1)本集合计划为债券型集合计划，债券资产不低于集合计划资产的80%。因此，本集合计划需要承担债券市场整体下跌的风险。

(2)本集合计划就A类份额而言，不开放申购，每个开放日办理赎回。

就B、C、D类计划份额而言：每个运作期到期日前，B、C、D类集合计划份额持有人不能提出赎回申请。

对于B、C、D类计划份额的每份申购份额，第一个运作期指该计划份额申购确认日起（即第一个运作期起始日），至计划份额申购确认日满6个月对应的月度对日（即第一个运作期到期日）止。第二个运作期指计划份额申购确认日满12个月对应的月度对日止，第三个运作期指计划份额申购确认日满18个月对应的月度对日止。以此类推。

每个运作期到期日，B、C、D类集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果B、C、D类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

期到期日下一工作日起该计划份额进入下一个运作期。

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

(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) 本集合计划可投资于国债期货。国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，相应期限国债收益率微小的变动就可能使投资者权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

(5) 为对冲信用风险，本计划可能投资信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

## 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管理人公司、登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。

## 6、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资产管理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) 对主要业务人员如投资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、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。

## 第十八部分 合同的变更、终止与集合计划财产的清算

### 一、《资产管理合同》的变更

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

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

### 二、《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

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

### 三、集合计划财产的清算

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

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

(2)对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、集合计划财产清算的公告

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

#### 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 15 年以上。

## 第十九部分 资产管理合同内容摘要

### 一、集合计划份额持有人、管理人及托管人的权利义务

#### （一）集合计划份额持有人的权利、义务

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

同一类别每份集合计划份额具有同等的合法权益。

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

- （1）分享集合计划财产收益；
- （2）参与分配清算后的剩余集合计划财产；
- （3）依法转让或者申请赎回其持有的集合计划份额；
- （4）按照规定要求召开集合计划份额持有人大会或者召集集合计划份额持有人大会；
- （5）出席或者委派代表出席集合计划份额持有人大会，对集合计划份额持有人大会审议事项行使表决权；
- （6）查阅或者复制公开披露的集合计划信息资料；
- （7）监督管理人的投资运作；
- （8）对管理人、托管人、集合计划服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- （9）法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

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

- （1）认真阅读并遵守《资产管理合同》、招募说明书等信息披露文件；
- （2）了解所投资集合计划产品，了解自身风险承受能力，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- （3）关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；

- 
- 
- (4) 交纳集合计划申购款项及法律法规和《资产管理合同》所规定的费用；
  - (5) 在其持有的集合计划份额范围内，承担集合计划亏损或者《资产管理合同》终止的有限责任；
  - (6) 不从事任何有损集合计划及其他《资产管理合同》当事人合法权益的活动；
  - (7) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决定；
  - (8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；
  - (9) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## (二) 管理人的权利、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) 自《资产管理合同》生效之日起，根据法律法规和《资产管理合同》独立运用并管理集合计划财产；
- (2) 依照《资产管理合同》收取集合计划管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用；
- (3) 销售集合计划份额；
- (4) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；
- (5) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定监督集合计划托管人，如认为集合计划托管人违反了《资产管理合同》及国家有关法律的规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护集合计划投资者的利益；
- (6) 在集合计划托管人更换时，提名新的集合计划托管人；
- (7) 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；
- (8) 担任或委托其他符合条件的机构担任集合计划登记机构办理集合计划登记业务并获得《资产管理合同》规定的费用；
- (9) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；
- (10) 在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
- (11) 依照法律法规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；

(12) 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;

(13) 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;

(14) 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;

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

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,管理人的义务包括但不限于:

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

(2) 办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金;

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

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

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

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

(7) 依法接受集合计划托管人的监督;

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

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告;

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告;

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

### (三) 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，托管人的权利包括但不限于：

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

(6) 在管理人更换时，提名新的管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

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

(4) 除依据《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定外，不得利用集

---

---

合计划财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管集合计划财产；

(5) 保管由管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；

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

(15) 依据《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定，召集集合计划份额持有人大会或配合管理人、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《资产管理合同》的规定监督管理人的投资运作；

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

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

(19) 因违反《资产管理合同》导致集合计划财产损失时，应承担赔偿责任，

其赔偿责任不因其退任而免除；

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

(21) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决定；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## 二、集合计划份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

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

### (一) 召开事由

1、除法律法规另有规定或本合同另有约定外，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：

(1) 终止《资产管理合同》；

(2) 更换管理人（集合计划管理人更换为本集合计划管理人独资或控股设立的从事资产管理业务的子公司除外）；

(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提高销售服务费费率；

(6) 变更集合计划类别；

(7) 本集合计划与其他集合计划的合并；

(8) 变更集合计划投资目标、范围或策略；

(9) 变更集合计划份额持有人大会程序；

(10) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；

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

要求召开集合计划份额持有人大会；

(12) 对集合计划当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

(1) 法律法规要求调整的集合计划费用的收取；

(2) 调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率、销售服务费率或变更收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《资产管理合同》进行修改；

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

(5) 集合计划推出新业务或服务；

(6) 调整本集合计划份额类别的设置；

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

(8) 管理人将本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子公司；

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

(二) 会议召集人及召集方式

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

2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集。

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

书面决定之日起 60 日内召开并告知管理人，管理人应当配合。

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

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

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

（三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

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

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

#### （四）集合计划份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

2、通讯开会。通讯开会系指集合计划份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或资产管理合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定

的地址或系统。通讯开会应以书面方式或资产管理合同约定的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

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

4、在不与法律法规冲突的前提下，集合计划份额持有人可采用其他书面或非书面方式授权他人代为出席集合计划份额持有人大会并行使表决权，授权方式

可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第（七）条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为管理人授权出席会议的代表，在管理人授权代表未能主持大会的情况下，由托管人授权其出席会议的代表主持；如果管理人授权代表和托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的集合计划份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名集合计划份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人。管理人和托管人拒不出席或主持集合计划份额持有人大会，不影响集合计划份额持有人大会作出的决议的效力。

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

###### （2）通讯开会

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

#### （六）表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

#### （七）计票

##### 1、现场开会

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

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

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

进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

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

## 2、通讯开会

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

## (八) 生效与公告

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

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

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

## (十) 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。

### 三、资产管理合同的终止事由、程序与集合计划资产的清算

#### （一）《资产管理合同》的变更

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

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

#### （二）《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

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

### （三）集合计划财产的清算

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

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

（2）对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

（3）对集合计划财产进行估值和变现；

（4）制作清算报告；

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

（6）将清算报告报中国证监会备案并公告；

（7）对集合计划剩余财产进行分配。

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

### （四）清算费用

清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所

有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。

#### （五）集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### （六）集合计划财产清算的公告

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

#### （七）集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 15 年以上。

### 四、争议解决方式

因履行本合同发生的争议，由各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交管理人所在地有管辖权法院进行诉讼解决。争议处理期间，资产管理合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

《资产管理合同》受中国法律管辖。

### 五、资产管理合同的存放地及投资者取得方式

1、《资产管理合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，管理人、托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。

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

---

---

## 第二十部分 托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### （一）管理人

名称：平安证券股份有限公司

住所：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座 22-25 层

法定代表人：何之江

成立时间：1996 年 07 月 18 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：证监许可【2011】1239 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：138 亿元人民币

经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；代销金融产品。

存续期间：持续经营

#### （二）托管人

名称：中信银行股份有限公司

住所：北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层

法定代表人：朱鹤新

成立时间：1987 年 4 月 20 日

批准设立机关：中华人民共和国国务院办公厅

批准设立文号：国办函[1987]14 号

基金托管业务批准文号：证监基金字[2004]125 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：489.35 亿元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：保险兼业代理业务；吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；

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；提供保管箱服务；结汇、售汇业务；代理开放式基金业务；办理黄金业务；黄金进出口；开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。（企业依法自主选择经营项目，开展经营活动；依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动；不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。）

## 二、托管人对管理人的业务监督和核查

### （一）托管人对管理人的投资行为行使监督权

1、托管人根据有关法律法规的规定和资管合同的约定，对下述集合计划投资范围、投资对象进行监督。本集合计划将投资于以下金融工具：

本集合计划的投资范围包括具有良好流动性的金融工具，包括：国内依法发行的债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、信用衍生品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）。

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

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

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

2、托管人根据有关法律法规的规定及资管合同的约定对下述投融资比例进行监督：

(1) 本计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的 80%；

(2) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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

(4) 管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

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

1) 本集合计划投资于 AAA 信用评级的信用债的比例不低于全部信用债资产的 30%；

2) 本集合计划投资于 AA+信用评级的信用债的比例不超过全部信用债资产的 70%；

3) 本集合计划投资于 AA 信用评级的信用债的比例不超过全部信用债资产的 20%；

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

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

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

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

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

(13) 管理人管理的全部公开募集性质的集合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%；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公开募集性质的集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

(14) 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；

(15) 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管合同约定的投资范围保持一致；

(16) 集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的 140%；

(17) 本集合计划参与国债期货投资，应遵循下列限制：

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）应当符合资管合同关于债券投资比例的有关约定；

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

(18) 本计划不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品，不持有合约类信用衍生品；

(19) 本计划持有的信用衍生品名义本金不得超过本计划中所对应受保护债券面值的 100%；

(20) 本计划投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品名义本金合计不得超过计划资产净值的 10%；

(21) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（10）、（14）、（15）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。

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

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

3、托管人根据有关法律法规的规定及资管合同的约定对下述投资禁止行为进行监督：

根据法律法规的规定及资管合同的约定，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或基金份额，但法律法规或中国证监会另有规

定的除外；

- (5) 向集合计划管理人、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其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循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资管合同进行变更，该变更无须召开集合计划份额持有人大会审议。

4、托管人依据有关法律法规的规定和资管合同的约定对于关联投资限制进行监督：

根据法律法规有关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，加盖公章并书面提交，并确保所提供名单的真实性、完整性、全面性。名单变更后变更方应及时发送对方，被告知方于2个工作日内进行回函确认已知名单的变更。名单变更时间以被告知方回函确认的时间为准。如果托管人在运作中严格遵循了监督流程，管理人仍违规进行交易，并造成集合计划资产损失的，由管理人承担责任，托管人不承担任何损失和责任。

若托管人发现管理人与关联方进行法律法规禁止集合计划从事的交易时，

托管人应及时提醒并协助管理人采取必要措施阻止该交易的发生，若托管人采取必要措施后仍无法阻止该交易发生时，托管人有权向中国证监会报告，由此造成的损失和责任由管理人承担。对于交易所场内已成交的违规交易，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，托管人不承担由此造成的损失和责任。

5、托管人依据有关法律法规的规定和资管合同的约定对管理人参与银行间债券市场进行监督：托管人根据有关法律法规的规定及资管合同的约定，对管理人选择存款银行进行监督：

6、投资银行定期存款的，管理人应根据法律法规的规定及资管合同的约定，选择符合条件的存款银行，并向托管人提供存款银行协议，托管人应据以对集合计划银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。

本集合计划投资银行存款应符合如下规定：

(1) 管理人、托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保银行存款业务账目及核算的真实、准确。

(2) 管理人与托管人应根据相关规定，就本集合计划银行存款业务另行签订书面协议，明确双方在相关协议签署、账户开设与管理、投资指令传达与执行、资金划拨、账目核对、到期兑付、文件保管以及存款证实书的开立、传递、保管等流程中的权利、义务和职责，以确保集合计划财产的安全，保护份额持有人的合法权益。

(3) 托管人应加强对银行存款业务的监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

(4) 管理人与托管人在开展存款业务时，应严格遵守《基金法》、《运作办法》等有关法律法规，以及国家有关账户管理、利率管理、支付结算等的各项规定。

7、托管人对管理人业务进行监督和核查的有关措施：

(1) 托管人应根据有关法律法规的规定及资管合同的约定，对集合计划资

产净值计算、份额净值计算、应收资金到账、费用开支及收入确定、收益分配、相关信息披露、宣传推介材料中登载业绩表现数据等进行监督和核查。

(2) 托管人发现管理人的投资运作及其他运作违反《基金法》、资管合同、本托管协议及其他有关规定时，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在下一个工作日及时核对，并以书面形式向托管人发出回函，进行解释或举证。

(3) 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。

(4) 托管人发现管理人的投资指令违反法律法规规定或者违反资管合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人。

(5) 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，或者违反资管合同约定的，应当立即通知管理人，并及时向中国证监会报告，管理人应依法承担相应责任。

(6) 管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查，必须在规定时间内答复托管人并改正，就托管人的合理疑义进行解释或举证，对托管人按照法规要求需向中国证监会报送监督报告的，管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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

(8) 管理人无正当理由，拒绝、阻挠托管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。

(9) 管理人应遵守中华人民共和国反洗钱法律法规，不参与涉嫌洗钱、恐怖融资、扩散融资等违法犯罪活动；主动配合托管人客户身份识别与尽职调查，提供真实、准确、完整客户资料，遵守托管人反洗钱与反恐怖融资相关管理规定。对具备合理理由怀疑涉嫌洗钱、恐怖融资的客户，托管人将按照中国

---

人民银行反洗钱监管规定采取必要管控措施。

### 三、管理人对托管人的业务核查

1、管理人对托管人履行托管职责情况进行核查，核查事项包括但不限于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等投资所需的其他账户、复核管理人计算的集合计划资产净值和份额净值、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。

2、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》、资管合同、本托管协议及其他有关规定时，管理人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确认并以书面形式向管理人发出回函。在限期内，管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正，并予协助配合。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正或未在合理期限内确认的，管理人应报告中国证监会。管理人有义务要求托管人赔偿集合计划因此所遭受的损失。

3、管理人发现托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会和银行业监督管理机构，同时通知托管人限期纠正。

4、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。

5、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。

### 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。除依据法律法规规定、资管合同和本托管协议约定及管理人的正当指令外，不得自行运用、处分、分配集合计划的

任何财产。

3、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的其他账户。

4、托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，与托管人的其他业务和其他集合计划或基金的托管业务实行严格的分账管理，确保集合计划财产的完整与独立。

5、托管人根据管理人的指令，按照资管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。

6、除依据法律法规和资管合同的规定外，托管人不得委托第三人托管集合计划资产。

#### （二）集合计划的银行账户的开立和管理

1、托管人以本集合计划的名义在其营业机构开立集合计划的银行账户，并根据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托管人刻制、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。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、集合计划银行账户的开立和管理应符合有关法律法规以及银行业监督管理机构的有关规定。

#### （三）集合计划证券账户与证券交易资金账户的开设和管理

1、托管人以集合计划托管人和本集合计划联名的方式在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司开设证券账户。

2、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上海分公司/深圳分公司开立证券交易资金账户，用于证券清算。

3、集合计划证券账户的开立和使用，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出借和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。

#### （四）债券托管账户的开立和管理

1、资管合同生效后，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；托管人负责以集合计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并由托管人负责集合计划的债券的后台匹配及资金的清算。

2、管理人和托管人应一起负责为集合计划对外签订全国银行间国债市场回购主协议，正本由托管人保管，管理人保存副本。

#### （五）其他账户的开设和管理

在本托管协议生效之后，本集合计划被允许从事符合法律法规规定和资管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，由管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和资管合同的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

（六）集合计划财产投资的有关实物证券、银行定期存款存单等有价凭证的保管

集合计划财产投资的有关实物证券由托管人存放于托管人的保管库；其中实物证券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。实物证券的购买和转让，由托管人根据管理人的指令办理。属于托管人控制下的实物证券在托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由托管人承担。托管人对托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （七）与集合计划财产有关的重大合同的保管

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有关的重大合同的原件分别应由托管人、管理人保管。管理人在代表集合计划签署与集合计划有关的重大合同时在保证集合计划一方持有两份以上的正本原件，以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件。管理人在合同签署后30个工作日内通过专人送达、挂号邮寄等安全方式将合同送达托管人处。合同应存放于管理人和托管人各自文件保管部门15年以上，法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。对于无法取得二份以上的正本的，管理人应向托管人提供加盖公章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移，由管理人保管。

## 五、集合计划资产净值计算和会计核算

### （一）集合计划资产净值的计算、复核的时间和程序

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净资产值。某一类别份额净值是指计算日某一类别集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额总份额后的数值。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，由此产生的误差计入集合计划财产。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。国家另有规定或资管合同另有约定的，从其规定。

2、管理人应每工作日对集合计划资产估值，但管理人根据法律法规或资管合同的规定暂停估值时除外。估值原则应符合资管合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定。集合计划资产净值和份额净值由管理人负责计算，托管人复核。管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的集合计划份额净值并以双方认可的方式发送给托管人。托管人对净值计算结果复核后以双方认可的方式发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。

3、根据《基金法》，管理人计算并公告集合计划净值信息，托管人复核、审查管理人计算的集合计划净值信息。因此，本集合计划的会计责任方是管理人，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，按照管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布。

### （二）集合计划资产估值方法

## 1、估值对象

集合计划所拥有的债券、股票、国债期货合约、信用衍生品和银行存款本息、其他投资等资产及负债。

## 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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

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

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

(3) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于

含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

（4）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

（5）存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

（6）同业存单的估值方法

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

（7）本集合计划投资国债期货，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

（8）信用衍生品估值方法

信用衍生品按照第三方估值机构提供的当日估值价格进行估值，但管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除。

选定的第三方估值机构未提供估值价格的，依照有关法律法规及企业会计准则的要求采用合理估值技术确定其公允价值。

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

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

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

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

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

### （三）估值差错处理

1、因集合计划估值错误给投资人造成损失的应先由管理人承担，管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

2、当管理人计算的集合计划资产净值、份额净值已由托管人复核确认后公告的，由此造成的投资人或集合计划的损失，应根据法律法规的规定对投资人或集合计划支付赔偿金，就实际向投资人或集合计划支付的赔偿金额，由管理人与托管人按照管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

3、由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致集合计划资产净值、份额净值计算错误造成投资人或集合计划的损失，以及由此造成以后交易日集合计划资产净值、份额净值计算顺延错误而引起的投资人或集合计划的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

4、由于不可抗力，或证券、期货交易所、证券经纪机构、期货公司及登记结算公司发送的数据错误等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，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。

5、当管理人计算的集合计划资产净值与托管人的计算结果不一致时，相关各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对，如果最后仍无法达成一致，应以管理人的计算结果为准对外公布，由此造成的损失由管理人承担赔偿责任，托管人不负赔偿责任。

### （四）集合计划账册的建立

1、管理人和托管人在资管合同生效后，应按照相关各方约定的同一记账方

法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本集合计划的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证集合计划资产的安全。若双方对会计处理方法存在分歧，应以管理人的处理方法为准。

2、经对账发现相关各方的账目存在不符的，管理人和托管人必须及时查明原因并纠正，保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。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，以管理人的账册为准。

#### （五）集合计划定期报告的编制和复核

1、集合计划财务报表由管理人和托管人每月分别独立编制。月度报表的编制，应于每月终了后 5 个工作日内完成。

2、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，将年度报告登载于规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成集合计划中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成集合计划季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。

3、《资管合同》生效后，集合计划招募说明书、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，更新招募说明书、产品资料概要，并登载在规定网站上，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。基招募说明书、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。

4、管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供托管人复核；托管人应当在收到报告之日起 2 个工作日内完成月度报表的复核；在收到报告之日起 7 个工作日内完成集合计划季度报告的复核；在收到报告之日起 20 日内完成集合计划中期报告的复核；在收到报告之日起 30 日内完成集合计划年度报告的复核。托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，管理人和托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。

5、核对无误后，托管人在管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，相关各方各自留存一份。

6、托管人在对财务会计报告、季度、中期报告或年度报告复核完毕后，需盖章确认或出具相应的复核确认书，以备有权机构对相关文件审核时提示。

#### （六）暂停估值的情形

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

（2）因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

（4）法律法规、中国证监会和资管合同认定的其他情形。

### 六、集合计划份额持有人名册的保管

1、管理人和托管人须分别妥善保管的集合计划份额持有人名册，份额持有人名册的内容必须包括份额持有人的名称和持有的集合计划份额。

2、基份额持有人名册由集合计划的登记机构根据管理人的指令编制和保管，管理人和托管人应按照目前相关规则分别保管份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限为15年，法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。

3、管理人应当及时向托管人定期或不定期提交下列日期的份额持有人名册。份额持有人名册的内容必须包括份额持有人的名称和持有的集合计划份额。托管人可以采用电子或文档的形式妥善保管份额持有人名册，保存期限为15年。托管人不得将所保管的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。法律法规或监管规则另有规定的，从其规定。

4、若管理人或托管人由于自身原因无法妥善保管份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

### 七、争议解决方式

因履行本协议发生的争议，由各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交管理人所在地有管辖权法院进行诉讼解决。争议处理期间，本协议当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资管合同和本协议规定的义务，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。

## 八、托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算

### （一）托管协议的变更与终止

#### 1、托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议的内容进行变更。变更后的托管协议，其内容不得与资管合同的规定有任何冲突。本托管协议的变更报中国证监会注册或备案。

#### 2、托管协议终止的情形

发生以下情况，本托管协议终止：

- （1）资管合同终止；
- （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、破产或由其他管理人接管管理权；
- （4）发生法律法规或资管合同规定的终止事项。

### （二）集合计划财产的清算

#### 1、集合计划财产清算小组：

（1）自出现资管合同终止事由之日起 30 个工作日内成立集合计划财产清算小组，管理人组织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) 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。财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

(3) 在集合计划财产清算过程中，管理人和托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资管合同和本托管协议规定的义务，维护份额持有人的合法权益。

(4) 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。

## 2、集合计划财产清算程序

资管合同终止，应当按法律法规和资管合同的有关规定对集合计划财产进行清算。集合计划财产清算程序主要包括：

- (1) 资管合同终止情形出现时，由财产清算小组统一接管集合计划财产；
- (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。

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。

## 3、清算费用

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

## 4、集合计划财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿集合计划债务；
- (4) 对集合计划剩余财产进行分配。

---

集合计划财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给份额持有人。

5、集合计划财产清算的公告：

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，律师事务所出具法律意见书后，由集合计划财产清算小组报中国证监会备案并公告，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。

6、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存15年以上。

## 第二十一部分 产品资料概要

### 一、 A类份额产品资料概要（更新）

本概要提供本集合计划的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

#### （一） 产品概况

基金简称	平安安赢添利半年债券	基金代码	970011
基金简称A	平安安赢添利半年债券A	基金代码A	970011
基金管理人	平安证券股份有限公司	基金托管人	中信银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年05月12日	上市交易所及上市日期	
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	平安安赢添利半年债券A：不开放申购，每个开放日开放赎回。
基金经理	朱燕琼	开始担任本基金基金经理的日期	2021年05月12日
		证券从业日期	2017年06月05日
基金经理	姜杰特	开始担任本基金基金经理的日期	2021年05月12日
		证券从业日期	2015年03月01日
基金经理	秦石	开始担任本基金基金经理的日期	2021年05月12日
		证券从业日期	2012年10月25日

#### （二） 基金投资与净值表现

##### 1、 投资目标与投资策略

请仔细阅读《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划招募

---

说明书》的“第九部分 集合计划的投资”了解详细情况。

---

投资目标

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

本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、信用衍生品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)。

投资范围

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

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

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

主要投资策略

精选信用债做底仓配置，在获取稳健收益的基础上，通过债券波段操作、利率中性策略交易、权益资产投资等方式博取超额收益。本集合计划投资策略具有攻守兼备的特点，在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。

具体策略：大类资产轮动投资策略、债券久期及骑乘策略、利率中性策略、杠杆套利策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、信用债投资策略、可转债博弈及套利策略、权益投资策略。

业绩比较基准

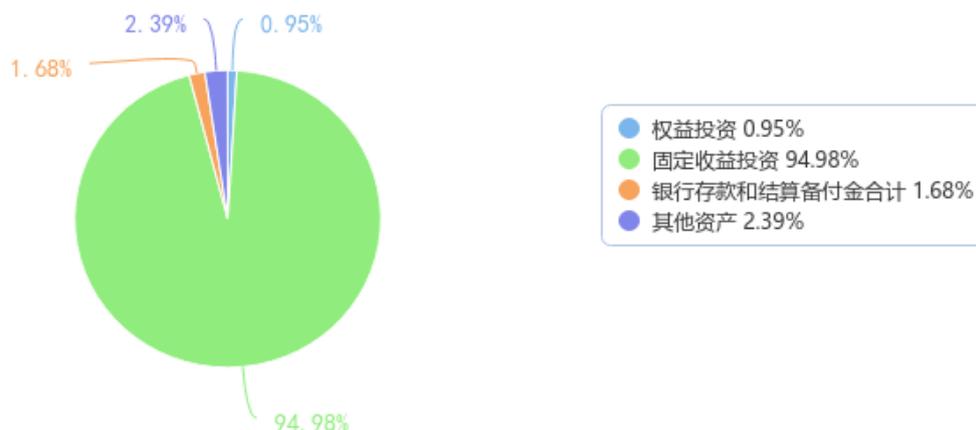
中债综合财富(总值)指数收益率\*90%+沪深300指数收益率\*10%

---

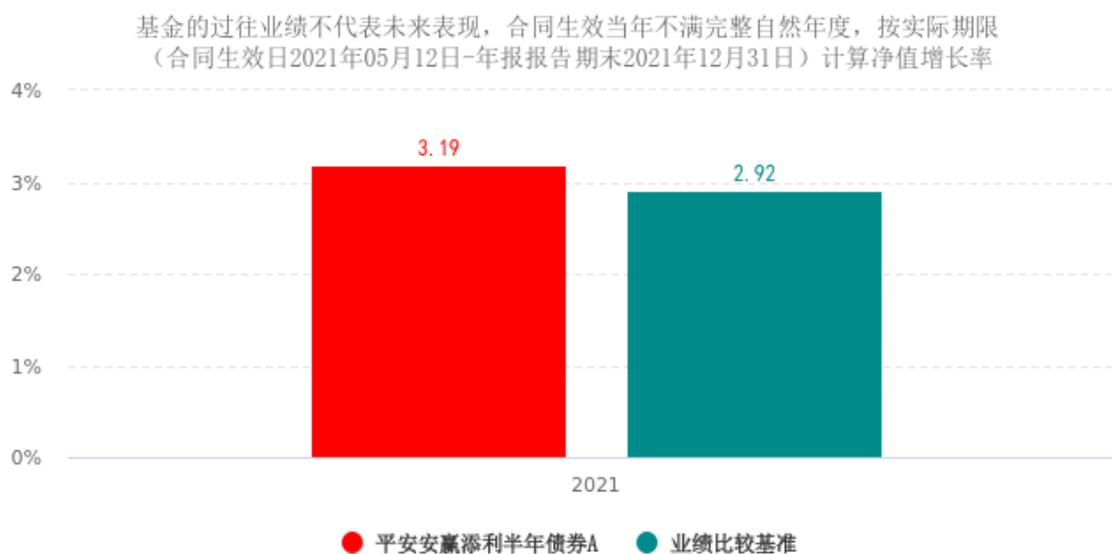
本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平高于风险收益特征 货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。

## 2、投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表（数据截至日期：2022年03月31日）



## 3、自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



### （三） 投资本基金涉及的费用

## 1、基金销售相关费用

注：本集合计划 A 类份额不开放申购；本集合计划 A 类份额对持有时间少于 7 日的该类集合计划份额持有人收取不低于 1.5% 的赎回费，并全额计入集合计划资产。A 类份额持有期限自原集合计划份额确认日起连续计算。

## 2、基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.4%
托管费	0.05%

注：1、其他费用包括与集合计划相关的信息披露费用、会计师费、律师费等按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用；

2、本集合计划交易证券、基金等产生的费用和税费，按实际发生额从集合计划资产扣除。

## （四） 风险揭示与重要提示

### 1、 风险揭示

本集合计划不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买集合计划时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

本集合计划面临的风险包括但不限于市场风险、管理风险、流动性风险、特定风险、操作或技术风险、合规性风险以及其他风险等。其中，特定风险包括：

（1）本集合计划为债券型集合计划，债券资产不低于集合计划资产的 80%。因此，本集合计划需要承担债券市场整体下跌的风险。

（2）本集合计划就 A 类份额而言，不开放申购，每个开放日办理赎回。

（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) 本集合计划可投资于国债期货。国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，相应期限国债收益率微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

(5) 为对冲信用风险，本计划可能投资信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

## 2、重要提示

中国证监会对本集合计划的备案，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景作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。

本集合计划管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运营集合计划财产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合计划投资者自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人。

集合计划产品资料概要信息发生重大变更的，集合计划管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，集合计划管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比集合计划的实际情况可能存在一定的之后，如需及时、准确获取集合计划的相关信息，敬请同时关注集合计划管理人发布的相关临时公告等。

### (五) 其他资料查询方式

以下资料详见集合计划管理人网站(<https://stock.pingan.com/>), 客服电话为95511-8。

- 1、资产管理合同、托管协议、招募说明书；
- 2、定期报告，包括季度报告、中期报告和年度报告；
- 3、集合计划份额净值；

4、集合计划销售机构及联系方式；

5、其他重要资料。

(六) 其他情况说明

无。

二、 B类份额产品资料概要（更新）

本概要提供本集合计划的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

(一) 产品概况

基金简称	平安安赢添利半年债券	基金代码	970011
基金简称B	平安安赢添利半年债券B	基金代码B	970012
基金管理人	平安证券股份有限公司		中信银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年05月12日	上市交易所及上市日期	
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	平安安赢添利半年债券B：6个月滚动持有，每个运作期到期日提出赎回申请。
基金经理	朱燕琼	开始担任本基金基金经理的日期	2021年05月12日
		证券从业日期	2017年06月05日
基金经理	姜杰特	开始担任本基金基金经理的日期	2021年05月12日
		证券从业日期	2015年03月01日
基金经理	秦石	开始担任本基金基	2021年05月12日

---



---

 金经理的日期
 

---

 证券从业日期 2012年10月25日
 

---

## (二) 基金投资与净值表现

### 1、 投资目标与投资策略

请仔细阅读《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》的“第九部分 集合计划的投资”了解详细情况。

#### 投资目标

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

本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、信用衍生品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)。

#### 投资范围

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

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

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

#### 主要投资策略

精选信用债做底仓配置，在获取稳健收益的基础上，通过债券波段操作、利率中性策略交易、权益资产投资等方式博取超额收益。本集合计划投资策略具有攻守兼备的特点，在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。

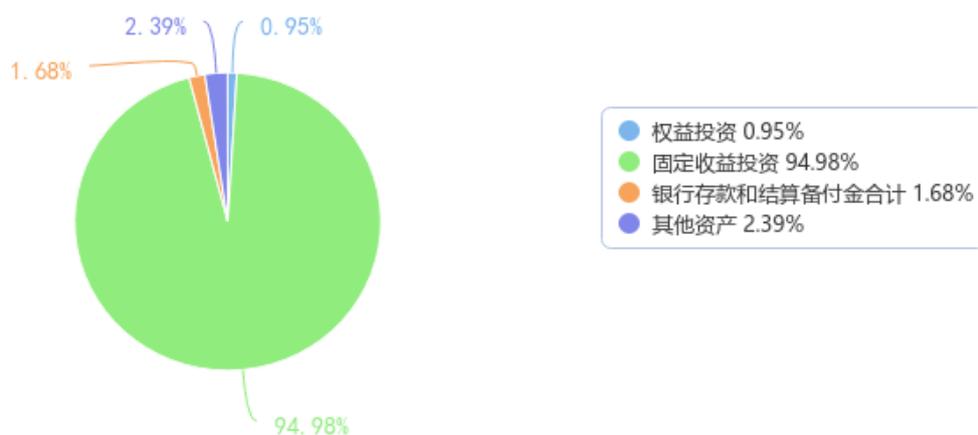
具体策略：大类资产轮动投资策略、债券久期及骑乘策略、利率中性策略、杠杆套利策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、信用债投资策略、可转债博弈及套利策略、权益投资策略。

业绩比较基准 中债综合财富（总值）指数收益率\*90%+沪深300指数收益率\*10%

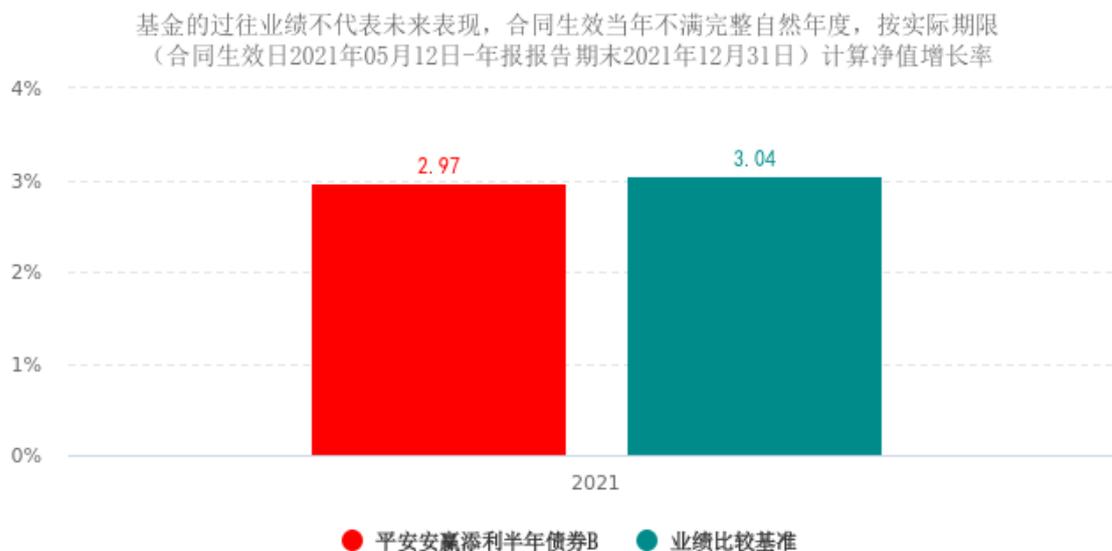
风险收益特征 本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。

## 2、 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表（数据截至日期：2022年03月31日）



## 3、 自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



### （三） 投资本基金涉及的费用

#### 1、 基金销售相关费用

注：本集合计划 B 类份额不收取申购费用； 本集合计划 B 类份额因设置最短持有期限，不收取赎回费。

#### 2、 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.4%
托管费	0.05%
销售服务费 B	0.30%

注：1、其他费用包括与集合计划相关的信息披露费用、会计师费、律师费等按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用；

2、本集合计划交易证券、基金等产生的费用和税费，按实际发生额从集合计划资产扣除。

### （四） 风险揭示与重要提示

#### 1、 风险揭示

本集合计划不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险,投资者购买集合计划时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

本集合计划面临的风险包括但不限于市场风险、管理风险、流动性风险、特定风险、操作或技术风险、合规性风险以及其他风险等。其中,特定风险包括:

(1)本集合计划为债券型集合计划,债券资产不低于集合计划资产的80%。因此,本集合计划需要承担债券市场整体下跌的风险。

(2)本集合计划就B类计划份额而言:每个运作期到期日前,集合计划份额持有人不能提出赎回申请。

对于B类计划份额的每份申购份额,第一个运作期指该计划份额申购确认日起(即第一个运作期起始日),至计划份额申购确认日满6个月对应的月度对日(即第一个运作期到期日)止。第二个运作期指计划份额申购确认日满12个月对应的月度对日止,第三个运作期指计划份额申购确认日满18个月对应的月度对日止。以此类推。

每个运作期到期日,B类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工作日起该计划份额进入下一个运作期。

(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)本集合计划可投资于国债期货。国债期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,相应期限国债收益率微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

(5)为对冲信用风险,本计划可能投资信用衍生品,信用衍生品的投资可

---

能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

## 2、重要提示

中国证监会对本集合计划的备案，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景作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。

本集合计划管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运营集合计划财产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合计划投资者自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人。

集合计划产品资料概要信息发生重大变更的，集合计划管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，集合计划管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比集合计划的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取集合计划的相关信息，敬请同时关注集合计划管理人发布的相关临时公告等。

## (五) 其他资料查询方式

以下资料详见集合计划管理人网站(<https://stock.pingan.com/>), 客服电话为95511-8。

- 1、资产管理合同、托管协议、招募说明书；
- 2、定期报告，包括季度报告、中期报告和年度报告；
- 3、集合计划份额净值；
- 4、集合计划销售机构及联系方式；
- 5、其他重要资料。

## (六) 其他情况说明

无。

## 三、 C类份额产品资料概要（更新）

本概要提供本集合计划的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

(一) 产品概况			
基金简称	平安安赢添利半年债券	基金代码	970011
基金简称C	平安安赢添利半年债券C	基金代码C	970013
基金管理人	平安证券股份有限公司	基金托管人	中信银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年05月12日	上市交易所及上市日期	
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	平安安赢添利半年债券C：6个月滚动持有，每个运作期到期日提出赎回申请。
基金经理	朱燕琼	开始担任本基金基金经理的日期	2021年05月12日
		证券从业日期	2017年06月05日
基金经理	姜杰特	开始担任本基金基金经理的日期	2021年05月12日
		证券从业日期	2015年03月01日
基金经理	秦石	开始担任本基金基金经理的日期	2021年05月12日
		证券从业日期	2012年10月25日

## (二) 基金投资与净值表现

### 1、投资目标与投资策略

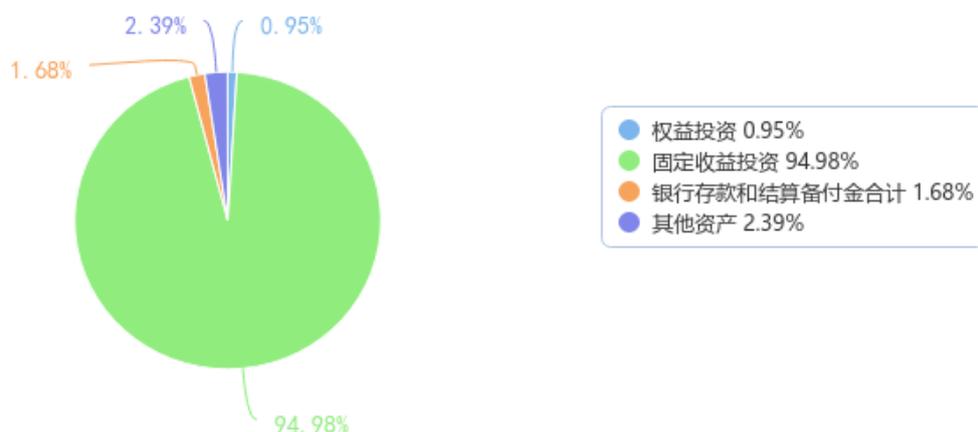
请仔细阅读《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》的“第九部分 集合计划的投资”了解详细情况。

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

	<p>本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、信用衍生品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)。</p>
<p>投资范围</p>	<p>如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本集合计划的投资组合比例为：本计划债券资产的投资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，本计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
<p>主要投资策略</p>	<p>精选信用债做底仓配置，在获取稳健收益的基础上，通过债券波段操作、利率中性策略交易、权益资产投资等方式博取超额收益。本集合计划投资策略具有攻守兼备的特点，在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。</p> <p>具体策略：大类资产轮动投资策略、债券久期及骑乘策略、利率中性策略、杠杆套利策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、信用债投资策略、可转债博弈及套利策略、权益投资策略。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中债综合财富（总值）指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。</p>

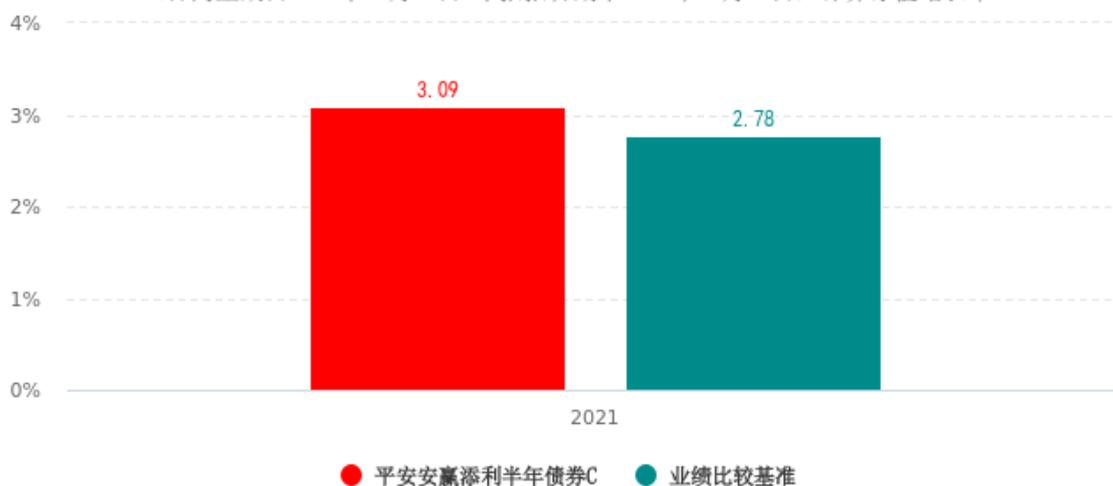
## 2、投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表（数据截至日期：2022年03月31日）



## 3、自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

基金的过往业绩不代表未来表现，合同生效当年不满完整自然年度，按实际期限（合同生效日2021年05月12日-年报报告期末2021年12月31日）计算净值增长率



### （三） 投资本基金涉及的费用

#### 1、基金销售相关费用

注：本集合计划 C 类份额不收取申购费用； 本集合计划 C 类份额因设置最短持有期限，不收取赎回费。

## 2、基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.4%
托管费	0.05%
销售服务费 C	0.10%

注：1、其他费用包括与集合计划相关的信息披露费用、会计师费、律师费等按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用；

2、本集合计划交易证券、基金等产生的费用和税费，按实际发生额从集合计划资产扣除。

### （四） 风险揭示与重要提示

#### 1、 风险揭示

本集合计划不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买集合计划时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

本集合计划面临的风险包括但不限于市场风险、管理风险、流动性风险、特定风险、操作或技术风险、合规性风险以及其他风险等。其中，特定风险包括：

（1）本集合计划为债券型集合计划，债券资产不低于集合计划资产的 80%。因此，本集合计划需要承担债券市场整体下跌的风险。

（2）本集合计划就 C 类计划份额而言：每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能提出赎回申请。

对于 C 类计划份额的每份申购份额，第一个运作期指该计划份额申购确认日起（即第一个运作期起始日），至计划份额申购确认日满 6 个月对应的月度对日（即第一个运作期到期日）止。第二个运作期指计划份额申购确认日满 12 个月对应的月度对日止，第三个运作期指计划份额申购确认日满 18 个月对应的月度对日止。以此类推。

每个运作期到期日，C 类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工作

日起该计划份额进入下一个运作期。

(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) 本集合计划可投资于国债期货。国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，相应期限国债收益率微小的变动就可能使投资者权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

(5) 为对冲信用风险，本计划可能投资信用衍生品，信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

## 2、重要提示

中国证监会对本集合计划的备案，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景作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。

本集合计划管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运营集合计划财产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

集合计划投资者自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人。

集合计划产品资料概要信息发生重大变更的，集合计划管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，集合计划管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比集合计划的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取集合计划的相关信息，敬请同时关注集合计划管理人发布的相关临时公告等。

## (五) 其他资料查询方式

以下资料详见集合计划管理人网站 (<https://stock.pingan.com/>), 客服电话为95511-8。

- 1、资产管理合同、托管协议、招募说明书；
- 2、定期报告，包括季度报告、中期报告和年度报告；
- 3、集合计划份额净值；
- 4、集合计划销售机构及联系方式；
- 5、其他重要资料。

#### (六) 其他情况说明

无。

#### 四、 D类份额产品资料概要（更新）

本概要提供本集合计划的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

##### (一) 产品概况

基金简称	平安安赢添利半年债券	基金代码	970011
基金简称D	平安安赢添利半年债券D	基金代码D	970014
基金管理人	平安证券股份有限公司	基金托管人	中信银行股份有限公司
基金合同生效日	2021年05月12日	上市交易所及上市日期	
基金类型	债券型	交易币种	人民币
运作方式	契约型开放式	开放频率	平安安赢添利半年债券D：6个月滚动持有，每个运作期到期日提出赎回申请。
基金经理	朱燕琼	开始担任本基金基金经理的日期	2021年05月12日

		证券从业日期	2017年06月05日
基金经理	姜杰特	开始担任本基金基金经理的日期	2021年05月12日
		证券从业日期	2015年03月01日
基金经理	秦石	开始担任本基金基金经理的日期	2021年05月12日
		证券从业日期	2012年10月25日

## (二) 基金投资与净值表现

### 1、投资目标与投资策略

请仔细阅读《平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》的“第九部分 集合计划的投资”了解详细情况。

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

**投资范围** 本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、信用衍生品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)。

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

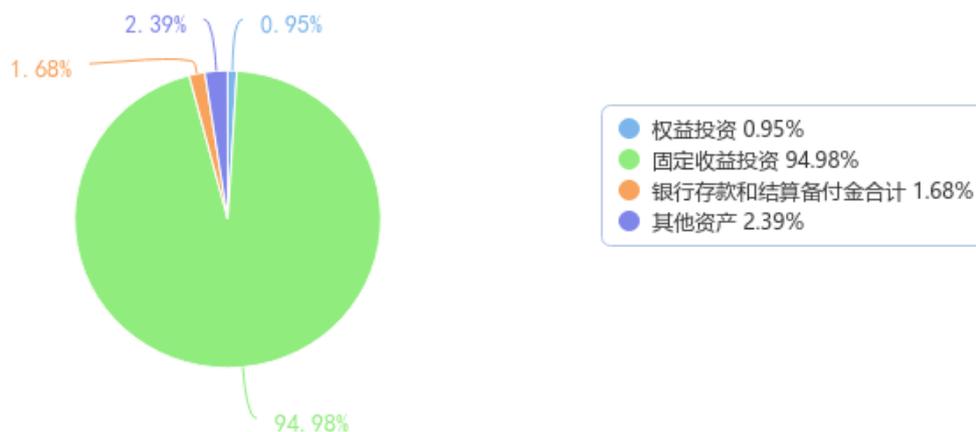
本集合计划的投资组合比例为：本计划债券资产的投资比例不低于集合计划资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本计划所持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理

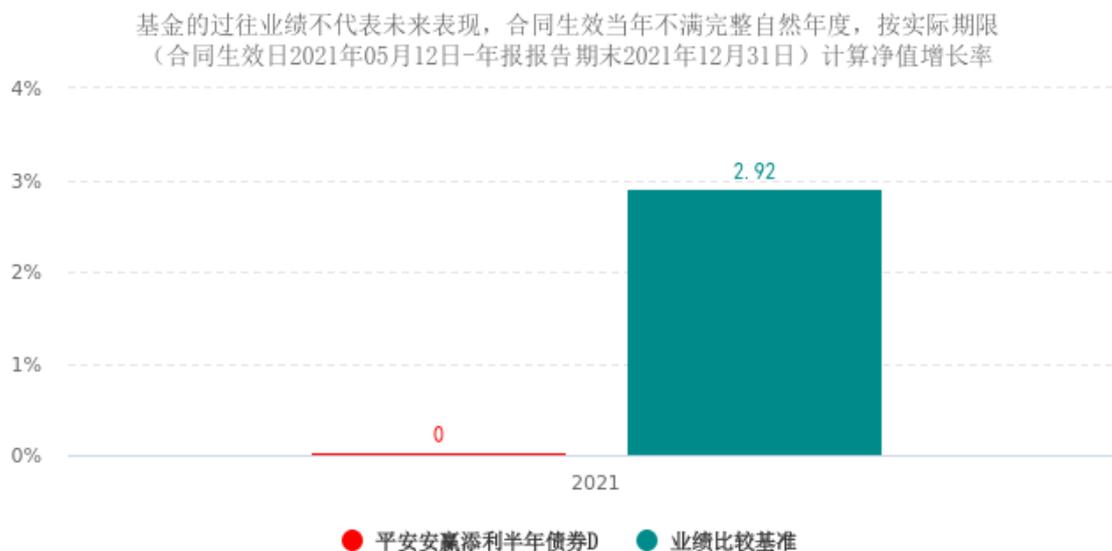
	人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。
主要投资策略	<p>精选信用债做底仓配置，在获取稳健收益的基础上，通过债券波段操作、利率中性策略交易、权益资产投资等方式博取超额收益。本集合计划投资策略具有攻守兼备的特点，在谨慎投资的基础上，力争实现组合的稳健增值。</p> <p>具体策略：大类资产轮动投资策略、债券久期及骑乘策略、利率中性策略、杠杆套利策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、信用债投资策略、可转债博弈及套利策略、权益投资策略。</p>
业绩比较基准	中债综合财富（总值）指数收益率*90%+沪深300指数收益率*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划、混合型基金和混合型集合资产管理计划。

## 2、投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表（数据截至日期：2022年03月31日）



## 3、自基金合同生效以来/最近十年（孰短）基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图



### （三） 投资本基金涉及的费用

#### 1、 基金销售相关费用

注：本集合计划 D 类份额不收取申购费用； 本集合计划 D 类份额因设置最短持有期限，不收取赎回费。

#### 2、 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

费用类别	收费方式/年费率
管理费	0.4%
托管费	0.05%

注：1、其他费用包括与集合计划相关的信息披露费用、会计师费、律师费等按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用；

2、本集合计划交易证券、基金等产生的费用和税费，按实际发生额从集合计划资产扣除。

### （四） 风险揭示与重要提示

#### 1、 风险揭示

本集合计划不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险,投资者购买集合计划时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

本集合计划面临的风险包括但不限于市场风险、管理风险、流动性风险、特定风险、操作或技术风险、合规性风险以及其他风险等。其中,特定风险包括:

(1)本集合计划为债券型集合计划,债券资产不低于集合计划资产的80%。因此,本集合计划需要承担债券市场整体下跌的风险。

(2)本集合计划就D类计划份额而言:每个运作期到期日前,集合计划份额持有人不能提出赎回申请。

对于D类计划份额的每份申购份额,第一个运作期指该计划份额申购确认日起(即第一个运作期起始日),至计划份额申购确认日满6个月对应的月度对日(即第一个运作期到期日)止。第二个运作期指计划份额申购确认日满12个月对应的月度对日止,第三个运作期指计划份额申购确认日满18个月对应的月度对日止。以此类推。

每个运作期到期日,D类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工作日起该计划份额进入下一个运作期。

(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)本集合计划可投资于国债期货。国债期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,相应期限国债收益率微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

(5)为对冲信用风险,本计划可能投资信用衍生品,信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

## 2、重要提示

中国证监会对本集合计划的备案,并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景作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。

本集合计划管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运营集合计划财产,但不保证集合计划一定盈利,也不保证最低收益。

集合计划投资者自依资产管理合同取得集合计划份额,即成为集合计划份额持有人和集合计划合同的当事人。

集合计划产品资料概要信息发生重大变更的,集合计划管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,集合计划管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比集合计划的实际情况可能存在一定的之后,如需及时、准确获取集合计划的相关信息,敬请同时关注集合计划管理人发布的相关临时公告等。

### (五) 其他资料查询方式

以下资料详见集合计划管理人网站(<https://stock.pingan.com/>),客服电话为95511-8。

- 1、资产管理合同、托管协议、招募说明书;
- 2、定期报告,包括季度报告、中期报告和年度报告;
- 3、集合计划份额净值;
- 4、集合计划销售机构及联系方式;
- 5、其他重要资料。

### (六) 其他情况说明

无。

## 第二十二部分 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相关服务。管理人将根据集合计划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、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过电话、信函、传真等方式提出咨询、建议、投诉等需求，管理人将尽快给予回复，并在处理进程中随时给予跟踪反馈。

### 二、联系管理人

1、网址：<https://stock.pingan.com>

2、客户服务热线：95511-8

3、传真：

4、管理人办公地址：深圳市福田区福田街道益田路 5023 号平安金融中心 B 座 22-25 层。

三、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。

## 第二十三部分 其他应披露事项

本集合计划的其他应披露事项将严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》等相关法律法规规定的内容与格式进行披露，并在指定媒介上公告。

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划2022年第一季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2022年04月21日
2	平安证券股份有限公司旗下大集合产品季度报告提示性公告	《证券时报》	2022年04月21日
3	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划2021年年度报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2022年03月30日
4	平安证券股份有限公司旗下大集合产品年度报告提示性公告	《证券时报》	2022年03月30日
5	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划2021年第四季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2022年01月24日
6	平安证券股份有限公司旗下大集合产品季度报告提示性公告	《证券时报》	2022年01月24日
7	平安证券股份有限公司高级管理人员变更公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2022年01月07日
8	平安证券股份有限公司关于旗下部分资产管理计划可投资北京证券交易所股票的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2021年12月02日
9	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划2021年第3季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2021年10月27日

10	平安证券股份有限公司旗下大集合产品季度报告提示性公告	《证券时报》	2021年10月27日
11	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划2021年中期报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2021年08月20日
12	平安证券股份有限公司旗下大集合产品中期报告提示性公告	《证券时报》	2021年08月20日
13	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划2021年第2季度报告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2021年07月20日
14	平安证券股份有限公司旗下大集合产品季度报告提示性公告	《证券时报》	2021年07月20日
15	平安证券股份有限公司高级管理人员变更公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2021年06月08日
16	平安证券股份有限公司关于旗下安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划增加平安银行为代销机构的公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2021年5月14日
17	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划开放日常申购、赎回业务公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2021年5月13日
18	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划(A类)产品资料概要	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2021年05月12日
19	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划(B类)产品资料概要	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2021年05月12日
20	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划(C类)产品资料概要	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监	2021年05月12日

		会基金电子披露网站	
21	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同生效公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2021年05月12日
22	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划（D类）产品资料概要	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2021年05月12日
23	平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书及合同提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站及/或中国证监会基金电子披露网站	2021年05月12日

## 第二十四部分 招募说明书的查阅方式

本招募说明书分别存放在管理人和托管人住所，投资者可在办公时间免费查阅。投资者在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。

---

---

## 第二十五部分 备查文件

- 一、中国证监会准予平安证券稳健资本一号集合资产管理计划变更为平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划的文件
- 二、平安证券安赢添利半年滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同
- 三、平安证券安赢添利半年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、托管人的住所，投资者可在办公时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件。资产管理合同条款及内容应以资产管理合同正本为准。