

# 上海海通证券资产管理有限公司

海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划

更新招募说明书

(2023 年第 3 号)

管理人：上海海通证券资产管理有限公司

托管人：交通银行股份有限公司

二〇二三年十二月

## 重要提示

海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由海通新兴成长集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来，原集合计划由管理人依照《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《海通新兴成长集合资产管理计划合同》及其他有关规定募集，并于2020年3月13日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2020]535号）批准。

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价值和收益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。

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资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

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，管理人管理的其他产品的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。

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

本集合计划属于混合型产品，预期风险和预期收益水平高于债券型基金、债券型集合资产管理计划和货币市场基金，低于股票型基金和股票型集合资产管理计划。本集合计划风险收益特征会定期评估并在公司网站发布，请投资者关注。

本集合计划的投资范围包括股指期货，投资于股指期货需承受市场风险、

信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。股指期货通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候需要承担比投资标的资产更高的风险。

本集合计划的投资范围包括资产支持证券，可能给本集合计划带来额外风险，包括信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等，由此可能给集合计划净值带来不利影响或损失。

本集合计划投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”），会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（如港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对集合计划的投资收益造成损失）、港股通制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市而香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股市场股票不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。具体风险请参见本招募说明书的“风险揭示”章节。

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

投资者依据原《海通新兴成长集合资产管理计划合同》参与集合计划获得的海通新兴成长集合资产管理计划份额，自资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划 B 类份额。在本集合计划存续期间，B 类份额只开放赎回，不开放申购业务，红利再投资份额除外。

本集合计划对每份 A 类份额和 C 类份额均设定 1 年的锁定持有期。在锁定持有期内，每份 A 类份额或 C 类份额不能赎回。

本集合计划采用逐笔计提法收取业绩报酬，披露的集合计划各类份额净值为未扣除管理人业绩报酬前的集合计划份额净值，不同时间参与的份额因申购时集合计划份额净值不同，持有期不同，对应的业绩报酬金额不同，赎回时应承担的业绩报酬金额也不同，实际赎回金额以登记机构确认数据为准。

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》及《资产管理合同》等信息披露文件，全面认识本集合计划的风险收益特征和产

品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险，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。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2023 年 12 月 6 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2023 年 9 月 30 日，所披露的投资组合为 2023 年第 3 季度的数据（财务数据未经审计）。

## 目录

一、 绪言.....	6
二、 释义.....	7
三、 集合计划管理人.....	13
四、 集合计划托管人.....	24
五、 相关服务机构.....	29
六、 集合计划的历史沿革.....	35
七、 集合计划的存续.....	36
八、 集合计划份额的申购与赎回.....	37
九、 集合计划的投资.....	48
十、 集合计划的业绩.....	61
十一、 集合计划的财产.....	65
十二、 集合计划资产的估值.....	66
十三、 集合计划的收益与分配.....	73
十四、 集合计划的费用与税收.....	75
十五、 集合计划的会计与审计.....	80
十六、 集合计划的信息披露.....	81
十七、 风险揭示.....	88
十八、 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算.....	95
十九、 资产管理合同的内容摘要.....	97
二十、 托管协议的内容摘要.....	114
二十一、 对集合计划份额持有人的服务.....	134
二十二、 其他披露事项.....	135
二十三、 招募说明书的存放及查阅方式.....	136
二十四、 备查文件.....	137

## 一、 绪言

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运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规的规定，以及《海通核心优势一年持有期混合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海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）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。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。

本招募说明书依据资产管理合同编写，并经中国证监会批准。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。招募说明书主要向投资者披露与本集合计划相关事项的信息，是投资者据以选择及决定是否投资于本集合计划的要约邀请文件。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。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、集合资产管理计划、集合计划或本集合计划：指海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划
- 2、管理人：指上海海通证券资产管理有限公司（简称“海通资产管理”）
- 3、托管人：指交通银行股份有限公司
- 4、集合资产管理合同、资产管理合同或《资产管理合同》：指《海通核心优势一年持有期混合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《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》及其定期的更新
- 7、产品资料概要：指《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新（资产管理合同关于产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行）
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对集合资产管理计划合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会 2020 年 8 月 28 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时

## 做出的修订

11、《信息披露办法》：中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

16、集合资产管理计划合同当事人：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暂行办法》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：指上海海通证券资产管理有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与管理人签订了集合计划销售服务协议，办理集合计划销售业务的机构

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基金账户的建立和管理、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或接受上海海通证券资产管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

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：指《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日，《海通新兴成长集合资产管理计划合同》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《海通新兴成长集合资产管理计划合同》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、开放日：指为投资人办理集合计划份额申购、赎回或其他业务的工作日

36、开放时间：指开放日集合计划接受申购、赎回或其他交易的时间段

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

38、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

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

40、集合资产管理计划转换：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、某一集合资产管理计划的集合计划份额转换为管理人管理的其他集合计划的份额的行为

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

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

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

44、元：指人民币元

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

46、集合资产管理计划资产总值：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

47、集合资产管理计划资产净值：指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值

48、集合资产管理计划份额净值：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

49、集合资产管理计划资产估值：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

50、指定媒介：中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括管理人网站、托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

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

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

53、集合计划份额类别：指根据申购费用、赎回费用、销售服务费、业绩报酬收取方式的不同，将集合计划份额分为不同的类别，各集合计划份额类别代码不同，并分别公布集合计划份额净值和集合计划份额累计净值

54、A 类集合计划份额或 A 类份额：指投资人申购时收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别集合计划资产中计提销售服务费的集合计划份额类别

55、B 类集合计划份额或 B 类份额：指对于投资者依据原《海通新兴成长集合资产管理计划合同》参与集合计划获得的海通新兴成长集合资产管理计划份额，自资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划 B 类份额。在本集合计划存续期间，B 类份额只开放赎回，不开放申购业务，红利再投资份额除外

56、C 类集合计划份额或 C 类份额：指从本类别集合计划资产中计提销售服务费而不收取申购费用，投资人赎回时根据持有期限收取赎回费用的集合计划份额类别

57、锁定持有期：本集合计划对每份 A 类份额和 C 类份额均设定 1 年的锁定持有期。锁定持有期指 A 类份额或 C 类份额申购申请日（即锁定持有期起始

日)起(含)至 A 类份额或 C 类份额申购申请日次年的年度对日的前一日(即锁定持有期到期日)止(含)的期间。在锁定持有期内,每份 A 类份额或 C 类份额不能赎回

58、开放持有期:对于每份 A 类份额和 C 类份额,自锁定持有期结束后即进入开放持有期,自其开放持有期首日起的开放日可以办理赎回业务。每份 A 类份额或 C 类份额的开放持有期首日为锁定持有期起始日次年的年度对日,若该年度对日为非工作日或不存在对应日期的,则顺延至下一个工作日

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

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

61、不可抗力:指资产管理合同当事人不能预见、不能避免、不能克服,使资产管理合同当事人无法全部履行或无法部分履行资产管理合同的任何事件和因素,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、系统故障、突发停电或其他突发事件、证券、期货交易所或证券登记结算机构非正常暂停或停止交易或发送数据存在延误、错漏

### 三、集合计划管理人

#### 一、管理人概况

本集合计划的管理人为上海海通证券资产管理有限公司，基本信息如下：

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

法定代表人：裴长江

成立日期：2012 年 6 月 26 日

实缴注册资本：22 亿元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：海通证券股份有限公司持股 100%

联系人：苗童

电话：021-23219000

上海海通证券资产管理有限公司是在海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）原客户资产管理部基础上组建起来的、由海通证券全额出资的子公司。

2012 年 3 月 26 日，中国证券监督管理委员会作出了《关于核准海通证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》（证监许可[2012]418号），批准设立海通资产管理。2012 年 6 月 26 日，经上海市工商局核准，海通资产管理取得营业执照。公司注册资本为 10 亿元人民币，实收资本 10 亿元人民币，经营范围为证券资产管理业务。

2012 年 7 月 24 日，中国证券监督管理委员会向海通资产管理颁发了《中华人民共和国经营证券业务许可证》，审核批准公司从事证券资产管理业务。

2014 年 2 月 21 日，经公司董事会决议，海通证券对海通资产管理增资 2 亿元人民币。2014 年 8 月 8 日，海通资产管理取得增资后的营业执照，公司注册资本为 12 亿元人民币。

2016 年 8 月 31 日，经公司董事会决议，海通证券对海通资产管理增资 10 亿元人民币。2016 年 12 月 8 日，海通资产管理取得增资完成后的营业执照，公司注册资本变更为 22 亿元人民币。

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员

裴长江先生，经济学硕士，从事证券工作 30 年。先后担任上海万国证券公司闸北营业部总经理助理、总经理；申银万国证券公司浙江管理总部副总经理、经纪总部副总经理；华宝信托投资有限责任公司投资总监、华宝兴业基金管理有限公司投资总监、总经理、华宝兴业资产管理（香港）有限公司董事长。2013 年 7 月加入海通证券，担任海通证券股份有限公司副总经理，现任海通证券股份有限公司董事会秘书、工会主席、海通期货股份有限公司董事长、上海海通证券资产管理有限公司董事长、富国基金管理有限公司董事长。

李井伟先生，经济学博士，从事证券工作 25 年。1998 年 6 月加入海通证券，先后担任海通证券投资管理部（深圳）投资部经理、投资总监兼任红岭中路营业部总经理、投资管理部（深圳）副总经理兼任红岭中路营运部总经理、嘉宾路营业部总经理、深圳分公司副总经理兼深圳销售中心总经理、广东分公司总经理。现任上海海通证券资产管理有限公司董事。

吴淑琨先生，管理学博士，从事证券工作 22 年。2001 年 11 月加入海通证券，先后担任研究所所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户部副总经理（主持工作），企业金融部总经理。现任海通证券战略发展部总经理，海通恒信国际租赁股份有限公司董事，海富通基金管理有限公司董事，上海海通证券资产管理有限公司董事。

张少华先生，本科学历，从事证券工作 27 年。1996 年 6 月加入海通证券，先后担任计划财务部总经理助理、计划财务部副总经理、资金管理总部副总经理、资金管理总部副总经理（主持工作）。现任海通证券资金管理总部总经理、海通期货股份有限公司董事、海通恒信国际租赁股份有限公司董事、上海海通证券资产管理有限公司董事。

吴国华先生，经济学硕士，从事证券工作 16 年。2011 年 7 月加入海通证券，先后担任无锡解放东路证券营业部总经理、深圳分公司总经理、零售与网络金融部总经理。现任海通证券财富管理总部总经理，上海海通证券资产管理有限公司董事。

### 2、监事

简化字女士，管理学硕士，从事证券相关工作 15 年。先后担任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所审计部助理经理，上海证监局副主任科员、主任科员，海通恒运融资租赁（上海）有限公司合规总监等。2022 年 4 月加入海通证券，现任海通证券合规管理部副总经理（主持工作），上海海通证券资产管理有限公司监事。

### 3、公司高管人员

裴长江先生，上海海通证券资产管理有限公司董事长。同前述。

左秀海先生，经济学硕士，从事证券工作 14 年。2010 年 6 月加入海通证券。先后担任海通证券销售交易总部、零售与网络金融部副经理、经理、财富管理中心总经理助理、副总经理、上海海通证券资产管理有限公司投资总监（副总经理级）。现任上海海通证券资产管理有限公司副总经理兼组合投资部总监。

胡倩女士，经济学博士，从事证券工作 22 年。2015 年 3 月加入上海海通证券资产管理有限公司，先后担任海通证券研究所首席分析师、长信基金管理有限公司金融工程部总监、基金经理。现任上海海通证券资产管理有限公司总经理助理兼专户权益部总监兼公募权益部总监，代任上海海通证券资产管理有限公司总经理。

陈颖女士，工学学士，从事证券工作 17 年。2011 年 11 月加入海通证券。先后担任华安基金管理有限公司信息技术部总助、海通证券客户资产管理部高级经理、上海海通证券资产管理有限公司产品运营部总监。现任上海海通证券资产管理有限公司首席信息官、首席风险官兼信息部总监。

曾丽琼女士，金融学硕士，从事证券工作 21 年。2017 年 12 月加入上海海通证券资产管理有限公司。先后担任华宝兴业基金管理有限公司基金经理、信诚基金管理有限公司基金经理、部门总监、中山证券有限责任公司资管事业八部总经理、上海海通证券资产管理有限公司投资经理、固定收益二部副总监（主持工作）、固定收益二部总监。现任上海海通证券资产管理有限公司总经理助理兼专户固定收益部总监兼投资顾问部总监。

张承启先生，经济学硕士，从事证券工作 13 年。2019 年 12 月加入上海海通证券资产管理有限公司。先后担任上海申银万国证券研究所有限公司研究员、

上海海通证券资产管理有限公司固定收益研究员、长江养老保险股份有限公司投资经理、上海光大证券资产管理有限公司投资经理、上海海通证券资产管理有限公司固收研究部总监、固收研究部总监兼权益研究部总监。现任上海海通证券资产管理有限公司总经理助理兼固收研究部总监兼权益研究部总监。

吴文然女士，法律硕士，从事证券工作 10 年。2013 年 3 月加入上海海通证券资产管理有限公司。先后担任上海工银安盛人寿保险有限公司合规经理、上海海通证券资产管理有限公司合规经理、合规与法务部总监、总经理助理兼合规与法务部总监。现任上海海通证券资产管理有限公司合规总监兼合规与法务部总监。

#### 4、合规负责人

吴文然女士，上海海通证券资产管理有限公司合规总监兼合规与法务部总监。同前述。

#### 5、本集合计划投资经理

于志浩，大连理工大学船舶与海洋结构物设计制造硕士，7 年证券从业经验，曾就职于中国第一重型机械集团、WOOD GROUP（戈朗（上海）海事技术咨询有限公司），2016 年加入上海海通证券资产管理有限公司，曾任权益研究部研究员，现任公募权益部基金经理。

#### 6、投资决策委员会成员

胡倩女士，总经理助理兼专户权益部总监兼公募权益部总监。

张承启先生，总经理助理兼固收研究部总监兼权益研究部总监。

钱玲玲女士，公募权益部总监助理。

李夏女士，公募固收部总监助理。

邱博文先生，公募固收部基金经理。

董晖先生，公募固收部基金经理。

钱韬先生，公募固收部基金经理。

董传盛先生，量化部投资经理。

### 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手续；
- 3、对所管理的不同集合计划资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照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收益；
- 5、进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；
- 6、编制中期和年度报告；
- 7、计算并公告集合计划财产净值，确定集合计划份额申购、赎回价格；
- 8、办理与集合计划资产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集集合计划份额持有人大会；
- 10、保存集合计划财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、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者实施其他法律行为；
- 12、法律法规和中国证监会规定的或《资产管理合同》约定的其他职责。

#### 四、管理人承诺

1、管理人将根据资产管理合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本集合计划的投资。

2、管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》及其他有关法律法规的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》及其他有关法律法规行为的发生。

3、管理人不得从事下列违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止法律法规规定的禁止行为的发生：

- (1) 违反集合计划份额持有人的利益，将集合计划资产用于向第三人抵押、担保、资金拆借或者贷款，按照国家有关规定进行融资担保的除外；
- (2) 从事有可能使集合计划承担无限责任的投资；
- (3) 从事证券承销行为；
- (4) 违反证券交易业务规则，操纵和扰乱市场价格；
- (5) 违反法律法规而损害集合计划份额持有人利益的；
- (6) 法律、法规及监管机关规定禁止从事的其它行为。

4、管理人将加强人员管理，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，不从事以下行为：

- (1) 越权或违规经营；
- (2) 违反资产管理合同或托管协议；
- (3) 故意损害集合计划份额持有人或其它集合计划相关机构的合法利益；
- (4) 在向中国证监会报送的材料中弄虚作假；
- (5) 拒绝、干扰、阻挠或严重影响中国证监会依法监管；
- (6) 玩忽职守、滥用职权；
- (7) 泄漏在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密、尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息；
- (8) 违反证券交易场所业务规则，扰乱市场秩序；
- (9) 在公开信息披露中故意含有虚假、误导、欺诈成分；
- (10) 其它法律法规以及中国证监会禁止的行为。

#### 5、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、代理人、代表人、受雇人或任何其它第三人谋取不当利益；

(3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密、尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息；

(4) 不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

#### 五、管理人的风险管理体系

健全、完善的内部风险控制制度是公司持续、稳健发展的重要保证，也是衡量公司经营管理水平的重要标志。公司应建立高效运行、控制严密、科学合理、切实有效的风险控制制度体系。

##### 1、风险管理原则

管理人风险管理体系的构建将严格遵循以下原则：

(1) 健全性原则：内部风险控制应覆盖到相关的所有部门和岗位，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各项业务过程和业务环节。

(2) 全员性原则：员工是风险控制的基础及第一人，风险控制必须涵盖全体员工，不断提高员工对风险的识别和防范能力，树立全员风险意识。

(3) 审慎性原则：内部风险控制的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点。

(4) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公募产品资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。公司的风控与稽核部、合规与法务部具有并保持高度的独立性和权威性。

(5) 相互制约原则：公司涉及公募业务的各部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。

(6) 适时有效原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。在保证所有风险控制措施切实有效的基础上，公司公募业务内部控制制度的制定应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境和国家法律法规、市场变化等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。

(7) 持续性原则：公司涉及公募业务的相关部门应对风险实施持续控制，对业务中的风险进行持续的识别、评估，及时采取相应的控制措施。

(8) 防火墙原则：公司公募业务、公司私募资产管理业务和公司自有资金投资业务，公募产品投资和公募产品研究，公募产品投资决策和交易清算应在空间上和制度上严格隔离。对因业务需要知悉内幕信息和穿越防火墙的人员，应制定严格的批准程序和监督处罚措施。

(9) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的成本控制达到最佳的风险控制效果。

(10) 风险控制与业务发展同等重要原则：风险是公司公募业务中客观存在的，如果没有正确的风险管理措施，可能会给公司或公募产品份额持有人带来无法估量的损失。因此，公司公募业务的发展必须建立在内部控制制度完善和稳固的基础上，内部风险控制应与公司公募业务发展放在同等地位上。

(11) 定性与定量相结合原则：建立完备的制度体系和量化指标体系，采用定性分析和定量分析相结合的方法，同时重视数量分析模型和定性分析的应用，使风险控制更具科学性和可操作性。

## 2、风险管理组织架构

公司建立健全严密有效的多级风险防范体系，并根据公募业务流程和风险特征，将该业务的风险管理工作纳入公司的风险管理体系之中。公司公募业务的风险控制体系共分四个层次：

- (1) 第一层次为公司董事会。
- (2) 第二层次为公司经营层下设的合规与风险控制委员会。
- (3) 第三层次为公司内设的合规与法务部和风控与稽核部。
- (4) 第四层次为各相关业务部门和职能部门，负责一线风险管理。

①公司董事会为公募业务风险管理的最高决策机构。

②合规与风险控制委员会。公司公募业务风险管理的决策机构，负责制订公司公募业务风险管理总体目标和政策，审定公司公募业务风险管理的制度、流程与指标，并对公司公募业务重大经营决策进行风险审核，授权相关人员执行。

③合规与法务部和风控与稽核部。公司合规与法务部和风控与稽核部独立于业务执行部门，对公募业务进行风险监控。负责通过投资交易管理系统等对公募业务的投资范围、结构、规模、品种、期限、损益、投资权限、投资操作等事项进行重点实时监控；对公募业务相关合同的签订、变更、终止、以及相关资金账户、证券账户等与客户相关的事项进行事前控制，在出现重大问题时及时向公司领导报送相关专项报告；负责审核公募产品信息披露文件，监测员工证券投资行为，建立和完善风险识别，风险评估及风险预警指标体系；在公司风险管理体系中独立地履行内部监督和管理建议职能，负责对公司内部各项经营活动及其内控的合法性、适当性和有效性进行独立客观的监督和评价；对公司所属的各部门及各分支机构的经济活动的法律法规遵循性、内部控制和风险管理的有效性和财务信息的真实性进行审查监督；负责相关人员的离任审查工作；调查公司内部的违规事件；按规定独立出具稽核报告，报送公司董事会和中国证监会等。

④其他相关职能部门。公司运营部、综合部等部门形成的风险管理支持体系，为公募业务风险监管提供集中清算、财务核算、信息技术、预警信息和人力资源管理支持。

⑤公募投资业务部门承担一线的风险控制职能，执行具体的风险管理制度，公募投资业务部门负责人为风险管理的第一责任人。公募投资业务部门下设相关岗位之间相互配合、相互监督制衡。关键部门和相关岗位之间建立重要业务凭据顺畅传递的渠道，各岗位分别在授权范围内承担各自的职责，将风险控制的最小范围内。

### 3、风险管理内容

风险控制程序由风险评估、风险报告、风险控制措施、风险控制实施、风险控制监控和风险控制完善六个环节组成。

风险评估是制定公募业务风险管理战略及防范措施的重要基础，合规与法务部和风控与稽核部应定期或者不定期地对公募业务风险进行评估。主要包括公募业务风险识别，即对经营活动中存在的内部及外部风险进行辨别；公募业务风险分析，即分析风险来源及其表现形式；公募业务风险测定，即对风险的严重性和发生的可能性以及其影响进行测定。

合规与风险控制委员会、合规与法务部、风控与稽核部以及公募投资业务部门根据风险评估的结果制定风险控制的策略，根据风险的不同类型采取不同的控制措施。

公募业务相关的部门、岗位根据制定的风险控制策略、流程、职责权限实施风险控制措施。

合规与法务部和风控与稽核部对公募业务风险控制各环节的执行情况进行监督和检查。

对于风险控制监控中发现的问题，应及时提出改进措施，完善内部控制机制，不断提高风险控制能力。

## 六、管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的目标

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

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

(3) 建立行之有效的风险控制体系，保障公司资产及客户资产的安全完整，

维护公司股东的合法权益，并最大限度地保护投资者的合法权益。

(4) 确保公司业务记录、财务信息和其它信息真实、准确、完整、及时。

(5) 保证公司内部规章制度的贯彻执行，提高公司经营效益。

(6) 提高业务开展运作效率，降低操作风险和因内控失当造成对公司的经济和声誉损失。

## 2、内部控制的原则

管理人内部控制遵循以下原则：

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

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

(3) 独立性原则。公司各部门和岗位职责应当保持相对独立，公司设立合规与法务部以及风控与稽核部承担内部控制监督检查职能，对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。

(4) 相互制约原则。公司各部门和岗位的设置必须权责分明、相互制衡；前台业务运作与后台管理支持严格分离。

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

## 3、内部控制体系

管理人内部控制体系的主体包括董事会及合规与风险控制委员会、经营管理层、风控与稽核部、各业务部门。

公司应建立贯穿于整个公司相互制衡、权责统一、监管明确的内部控制防线：

(1) 建立以一线岗位自律与互控为基础的第一道监控防线。明确各一线岗位的职责，各岗位人员在其职责范围内承担责任；

(2) 建立以风控与稽核部对各部门、各岗位、各项业务实施全面监督为内容的第二道监控防线。风控与稽核部独立于其他部门，负责对各业务部门实施执行内部监察稽核，对各部门内部控制情况进行检查，并将公司整个风险控制情况以定期或不定期的形式向首席风险官、合规与风险控制委员会报告；

(3) 建立以合规与风险控制委员会为主体的第三道防线。合规与风险控制委员会负责协助公司管理层实施对公司风险的总体控制，解决公司内部控制中出现的问题，对各部门的内控工作流程予以监督、指导。

#### 4、管理人关于内部合规控制声明书

- (1) 管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- (2) 管理人承诺根据市场的变化和管理人的发展不断完善内部合规控制。

## 四、集合计划托管人

### 一、托管人情况

#### （一）基本情况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD

法定代表人：任德奇

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

成立日期：1987 年 3 月 30 日

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.63 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：陆志俊

电 话：95559

交通银行始建于 1908 年，是中国历史最悠久的银行之一，也是近代中国的发钞行之一。1987 年重新组建后的交通银行正式对外营业，成为中国第一家全国性的国有股份制商业银行，总部设在上海。2005 年 6 月交通银行在香港联合交易所挂牌上市，2007 年 5 月在上海证券交易所挂牌上市。交通银行连续 14 年跻身《财富》(FORTUNE)世界 500 强，营业收入排名第 161 位；列《银行家》(The Banker)杂志全球千家大银行一级资本排名第 9 位。

截至 2023 年 9 月 30 日，交通银行资产总额为人民币 13.83 万亿元。2023 年三季度，交通银行实现净利润(归属于母公司股东)人民币 691.7 亿元。

交通银行总行设资产托管部（下文简称“托管部”）。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

#### （二）主要人员情况



任德奇先生，董事长、执行董事，高级经济师。

任先生 2020 年 1 月起任交通银行董事长（其中：2019 年 12 月至 2020 年 7 月代为履行行长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2020 年 1 月任交通银行副董事长（其中：2019 年 4 月至 2020 年 1 月代为履行董事长职责）、执行董事，2018 年 8 月至 2019 年 12 月任交通银行行长；2016 年 12 月至 2018 年 6 月任中国银行执行董事、副行长，其中：2015 年 10 月至 2018 年 6 月兼任中银香港（控股）有限公司非执行董事，2016 年 9 月至 2018 年 6 月兼任中国银行上海人民币交易业务总部总裁；2014 年 7 月至 2016 年 11 月任中国银行副行长，2003 年 8 月至 2014 年 5 月历任中国建设银行信贷审批部副总经理、风险监控部总经理、授信管理部总经理、湖北省分行行长、风险管理部总经理；1988 年 7 月至 2003 年 8 月先后在中国建设银行岳阳长岭支行、岳阳市中心支行、岳阳分行，中国建设银行信贷管理委员会办公室、信贷风险管理部工作。任先生 1988 年于清华大学获工学硕士学位。

刘珺先生，副董事长、执行董事、行长，高级经济师。

刘先生 2020 年 7 月起担任交通银行行长；2016 年 11 月至 2020 年 5 月任中国投资有限责任公司副总经理；2014 年 12 月至 2016 年 11 月任中国光大集团股份公司副总经理；2014 年 6 月至 2014 年 12 月任中国光大（集团）总公司执行董事、副总经理（2014 年 6 月至 2016 年 11 月期间先后兼任光大永明人寿保险有限公司董事长、中国光大集团有限公司副董事长、中国光大控股有限公司执行董事兼副主席、中国光大国际有限公司执行董事兼副主席、中国光大实业（集团）有限责任公司董事长）；2009 年 9 月至 2014 年 6 月历任中国光大银行行长助理、副行长（期间先后兼任中国光大银行上海分行行长、中国光大银行金融市场中心总经理）；1993 年 7 月至 2009 年 9 月先后在中国光大银行国际业务部、香港代表处、资金部、投行业务部工作。刘先生 2003 年于香港理工大学获工商管理博士学位。

徐铁先生，资产托管部总经理。

徐铁先生 2022 年 4 月起任交通银行资产托管部总经理；2014 年 12 月至 2022 年 4 月任交通银行资产托管部副总经理；2000 年 7 月至 2014 年 12 月，历任交通银行资产托管部客户经理、保险与养老金部副高级经理、高级经理、保险保障业

务部高级经理、总经理助理。徐先生 2000 年于复旦大学获经济学硕士学位。

### （三）托管业务经营情况

截至 2023 年 9 月 30 日，交通银行共托管证券投资基金 757 只。此外，交通银行还托管了基金公司特定客户资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、银行理财产品、信托计划、私募投资基金、保险资金、全国社保基金、养老保障管理基金、企业年金基金、职业年金基金、期货公司资产管理计划、QFI 证券投资资产、QDII 证券投资资产、RQDII 证券投资资产、QDIE、QDLP 和 QFLP 等产品。

## 二、托管人的内部控制制度

### （一）内部控制目标

交通银行严格遵守国家法律法规、行业规章及行内相关管理规定，加强内部管理，托管部业务制度健全并确保贯彻执行各项规章制度，通过对各种风险的识别、评估、控制及缓释，有效地实现对各项业务的风险管控，确保业务稳健运行，保护持有人的合法权益。

### （二）内部控制原则

1、合法性原则：托管部制定的各项制度符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动始终。

2、全面性原则：托管部建立各二级部自我监控和风险合规部风险管控的内部控制机制，覆盖各项业务、各个部门和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个经营环节，建立全面的风险管理监督机制。

3、独立性原则：托管部独立负责受托集合计划资产的保管，保证集合计划资产与交通银行的自有资产相互独立，对不同的受托资产分别设置账户，独立核算，分账管理。

4、制衡性原则：托管部贯彻适当授权、相互制约的原则，从组织架构的设置上确保各二级部和各岗位权责分明、相互制约，并通过有效的相互制衡措施消除内部控制中的盲点。

5、有效性原则：托管部在岗位、业务二级部和风险合规部三级内控管理模式的基础上，形成科学合理的内部控制决策机制、执行机制和监督机制，通过行之有效的控制流程、控制措施，建立合理的内控程序，保障各项内控管理目

标被有效执行。

6、效益性原则：托管部内部控制与托管规模、业务范围和业务运作环节的风险控制要求相适应，尽量降低经营运作成本，以合理的控制成本实现最佳的内部控制目标。

### （三）内部控制制度及措施

根据《证券投资基金法》、《中华人民共和国商业银行法》、《商业银行资产托管业务指引》等法律法规，托管部制定了一整套严密、完整的证券投资基金托管管理规章制度，确保托管业务运行的规范、安全、高效，包括《交通银行资产托管业务管理办法》、《交通银行资产托管业务风险管理办法》、《交通银行资产托管业务商业秘密管理规定》、《交通银行资产托管业务从业人员行为规范》、《交通银行资产托管业务档案管理暂行办法》等，并根据市场变化和基金业务的发展不断加以完善。做到业务分工科学合理，技术系统管理规范，业务管理制度健全，核心作业区实行封闭管理，落实各项安全隔离措施，相关信息披露由专人负责。

托管部通过对托管业务各环节的事前揭示、事中控制和事后检查措施实现全流程、全链条的风险管理，聘请国际著名会计师事务所对托管业务运行进行国际标准的内部控制评审。

### 三、托管人对管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

交通银行作为托管人，根据《基金法》、《运作办法》和有关证券法规的规定，对集合计划的投资对象、集合计划资产的投资组合比例、集合计划资产的核算、集合计划资产净值的计算、管理人报酬的计提和支付、托管人报酬的计提和支付、集合计划的申购资金的到账与赎回资金的划付、集合计划收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

交通银行作为托管人，发现管理人有违反《基金法》、《运作办法》等有关证券法规和《资产管理合同》的行为，及时通知管理人予以纠正，管理人收到通知后及时核对确认并进行调整。交通银行有权对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对交通银行通知的违规事项未能及时纠正的，交通银行按规定报告中国证监会。

交通银行作为托管人，发现管理人有重大违规行为，有权立即报告中国证

监会，同时通知管理人限期纠正。

## 五、相关服务机构

### 一、集合计划销售机构：

#### 1、直销机构：上海海通证券资产管理有限公司直销柜台以及网上交易平台

##### （1）直销柜台

名称：上海海通证券资产管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

法定代表人：裴长江

成立日期：2012 年 6 月 26 日

实缴注册资本：22 亿元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：海通证券股份有限公司持股 100%

电话：021-23219000

##### （2）网上交易平台

投资者可以通过管理人网上交易平台办理集合计划的申购、赎回、定期投资等业务，具体业务办理情况及业务规则请登录管理人网站查询。管理人网址：<http://www.htsamc.com>。

#### 2、其他销售机构：

##### （1）海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

客户服务电话：95553

公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

##### （2）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

客户服务电话：95559

公司网站：[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

##### （3）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

公司网站：www.ccb.com

(4) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：潘卫东

客户服务电话：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

(5) 大同证券有限责任公司

住所：山西省太原市小店区长治路世贸中心 12 层

法定代表人：王晓

客户服务电话：4007-121212

公司网站：www.dtsbc.com.cn

(6) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客服电话：95021

网址：fund.eastmoney.com

(7) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：杭州市文二西路 1 号 903 室

法定代表人：吴强

客服电话：952555

网址：fund.10jqka.com.cn

(8) 京东肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

法定代表人：李骏

客服电话：95118

网址：jr.jd.com

(9) 上海陆金所基金销售有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区源深路 1088 号 7 层(实际楼层 6 层)

法定代表人：陈祎彬

客服电话：400-866-6618

网站：www.lu.com

(10) 上海云湾基金销售有限公司

住所：中国(上海)自由贸易试验区新金桥路 27 号、明月路 1257 号 1 幢 1 层  
103-1、103-2 办公区

法定代表人：冯轶明

客户服务电话：4008201515

公司网址：www.zhengtongfunds.com

(11) 北京新浪仓石基金销售有限公司

住所：北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人：穆飞虎

客户服务电话：400-052-0066

公司网址：finance.sina.com.cn

(12) 珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

(13) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

(14) 北京雪球基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区创远路 34 号院 6 号楼 15 层 1501 室

法定代表人：李楠

客户服务电话：400-159-9288

公司网站：danjuanapp.com

(15) 北京植信基金销售有限公司

住所：北京市密云区兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

法定代表人：王军辉

客服电话：4006-802-123

网站：www.zhixin-inv.com

(16) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 室

法定代表人：祖国明

客服电话：4000-766-123

网站：www.fund123.cn

(17) 南京苏宁基金销售有限公司

住所：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

客服电话：95177

网站：www.snjijin.com

(18) 北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

网站：www.hcfunds.com

(19) 腾安基金销售（深圳）有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

法定代表人：林海峰

客服电话：95017 转 1 再转 8

网站：[www.tenganxinxi.com](http://www.tenganxinxi.com)

(20) 上海万得基金销售有限公司



住所：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦

法定代表人：宋晓言

客户服务电话：021-51327185

公司网址：[www.520fund.com.cn](http://www.520fund.com.cn)

(21) 北京中植基金销售有限公司

住所：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

法定代表人：武建华

客户服务电话：400-8980-618

公司网址：[www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(22) 上海利得基金销售有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区海基六路 70 弄 1 号 208-36 室

法定代表人：李兴春

客户服务电话：4000325885/400-032-5885

公司网站：[leadfund.com.cn](http://leadfund.com.cn)

(23) 中证金牛（北京）基金销售有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

法定代表人：吴志坚

客户服务电话：4008-909-998

公司网站：[www.jnlc.com](http://www.jnlc.com)

(22) 上海联泰基金销售有限公司

住所：上海市普陀区曹杨路 2009 弄 88 号 806 室-2

法定代表人：尹彬彬

客户服务电话：400-118-1188

公司网站：[www.66liantai.com](http://www.66liantai.com)

(23) 北京度小满基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西北旺东路 10 号院西区 4 号楼 1 层 103 室

法定代表人：盛超

客户服务电话：95055-4

公司网站：[www.duxiaomanfund.com](http://www.duxiaomanfund.com)

（以上排名不分先后）

管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本集合计划，管理人增减或变更本集合计划的销售机构时，将提前在管理人指定网站上公告。

二、集合计划登记机构：

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

三、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：立信会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：上海市南京东路 61 号四楼

办公地址：上海市南京东路 61 号四楼

执行事务合伙人：朱建弟 杨志国

联系电话：021-23280000

联系人：迟媛

经办注册会计师：黄晔 尹雄

## 六、集合计划的历史沿革

海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划由海通新兴成长集合资产管理计划（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，于2010年2月11日经中国证监会证监许可〔2010〕180号核准设立，自2010年4月6日起开始募集并于2010年5月21日结束募集，于2010年5月26日成立。

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，《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》自管理人公告的生效之日起生效，原合同同日起失效。

## 七、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。

本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期至 2023 年 12 月 31 日。本集合计划后，按照中国证监会相关规定执行。如本集合计划到期后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 八、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本招募说明书第五章或其网站中列明。管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在管理人网站公示。集合计划投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的申购与赎回。

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

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理集合计划份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，若本集合计划参与港股通且该工作日为非港股通交易日时，则本集合计划不开放该工作日的申购和赎回，具体以届时提前发布的公告为准。但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或资产管理合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在届时相关公告中载明。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

管理人自资产管理合同生效之日起不超过 3 个月开始办理 A 类份额、C 类份额的申购业务，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

A 类份额、C 类份额的锁定持有期到期日后，管理人开始办理 A 类份额、C 类份额的赎回业务。对于每份 A 类份额、C 类份额，自其开放持有期首日起才能办理赎回业务。**如果投资人多次申购 A 类份额或 C 类份额，则其持有的 A 类份额或 C 类计划份额的赎回开放时间可能不同。**

原海通新兴成长集合资产管理计划份额在资产管理合同生效后变更为 B 类

份额。资产管理合同生效后，管理人不办理 B 类份额的申购业务，红利再投资份额除外。对 B 类份额不设置锁定持有期，可在每个开放日办理赎回业务。

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

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

### 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

投资人申购集合计划份额时，必须全额交付申购款项，投资人交付申购款项，申购成立；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，将在法律法规规定的期限内支付赎回款项。正常情况下，投资者赎回（T 日）申请生效后，管理人将在 T+7

日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回时，款项的支付办法参照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、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至前述因素消失日的下一个工作日划出。

### 3、申购和赎回申请的确认

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

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购申请及申购份额的确认情况，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、首次申购的单笔最低金额为人民币 1 元（含申购费）、追加申购的单笔最低金额为人民币 1 元（含申购费）。投资者将当期分配的集合计划收益转购集合计划份额时，不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购，法律法规、中国证监会另有规定的除外。

2、投资者可将其全部或部分集合计划份额赎回。本集合计划按照份额进行赎回，申请赎回份额精确到小数点后两位，每次赎回份额不得低于 1 份，集合计划基金账户余额不得低于 1 份，如进行一次赎回后集合计划基金账户中集合计划份额余额低于 1 份，应一次性赎回。如因分红再投资、非交易过户、转托管、巨额赎回、集合计划转换等原因导致的账户余额少于 1 份的情况，不受此限，但再次赎回时必须一次性全部赎回。

3、管理人可以规定单个投资人累计持有的集合计划份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告，但本集合计划单一投资者持有集合计划

份额数不得达到或超过集合计划份额总数的 50%（运作过程中，因集合计划份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外）。

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

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

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、集合计划申购份额的计算

申购的有效份额为净申购金额除以当日的集合计划份额净值，有效份额单位为份。

申购费用=（申购金额×申购费率）/（1+申购费率），或申购费用=固定申购费金额

净申购金额=申购金额-申购费用

申购份额=净申购金额/T 日对应类别集合计划份额净值

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。

本集合计划 B 类份额不开放申购。

本集合计划 A 类份额在申购时收取申购费用，C 类份额不收取申购费用。本集合计划 A 类份额的申购费率按申购金额进行分档，申购费率如下表所示：

A 类份额单笔申购金额（含申购费）	申购费率
人民币 100 万以下	1.5%
人民币 100 万以上（含），300 万以下	0.6%
人民币 300 万以上（含）	0

投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

本集合计划的申购费用由 A 类份额的投资者承担，不列入集合计划财产，



用于本集合计划的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

## 2、集合计划赎回金额的计算

赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日集合计划份额净值并扣除应计提的业绩报酬（如有）以及相应的费用，赎回金额单位为元。

赎回总额=赎回份数×T 日对应类别集合计划份额净值

赎回费用=赎回总额×赎回费率

赎回金额=赎回总额-赎回费用-应计提的业绩报酬

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。

本集合计划的赎回费率按持有时间递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回，适用费率按单笔分别计算。A/C 类份额赎回费率如下表所示：

持有期限（年以 365 天为单位，下同）	集合计划份额赎回费率
一年以上（含），两年以内	0.2%
两年以上（含）	0%

本集合计划的赎回费用由赎回集合计划份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。

本集合计划对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入集合计划财产；对持续持有期长于或等于 30 日但少于 3 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入集合计划财产；对持续持有期长于或等于 3 个月但少于 6 个月的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入集合计划财产；对持续持有期长于或等于 6 个月的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 归入集合计划财产。未归入集合计划财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

## 3、集合计划份额净值的计算

本集合计划 A 类份额、B 类份额、C 类份额分别设置代码，分别计算和公告集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

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

本集合计划份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。T 日的集合计划份额净值在

当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。

4、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》的有关规定在指定媒介上公告。

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率。

6、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。

#### 七、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致集合计划无法正常运转。
- 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/期货交易所非正常停市或者港股通临时停市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值。
- 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有集合计划份额持有人利益时。
- 5、集合计划资产规模过大，使管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对集合计划业绩产生负面影响，或发生其他损害现有集合计划份额持有人利益的情形。
- 6、当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停接受集合计划申购申请。
- 7、管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有集合计划份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。

8、港股通交易每日额度不足。

9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

#### 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

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

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

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

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应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。

## 九、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

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

### 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

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

合计划总份额20%以上的赎回申请延期赎回。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

### 3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，并在 2 日内在指定媒介上刊登公告。

## 十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

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

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

## 十一、集合计划转换

管理人可以根据相关法律法规以及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。

## 十二、集合计划的非交易过户

集合计划的非交易过户是指登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户(可补充其他情况)。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；捐赠是指集合计划份额持有人将其合法持有的集合计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将集合计划份额持有人持有的集合计划份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按登记机构的规定办理，并按登记机构规定的标准收费。

## 十三、集合计划的转托管

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

## 十四、定期定额投资计划

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

## 十五、集合计划的冻结和解冻与质押

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

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

## 十六、集合计划份额的转让

在法律法规允许且条件具备的情况下，管理人可受理集合计划份额持有人

通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请并由登记机构办理集合计划份额的过户登记。管理人拟受理集合计划份额转让业务的，将提前公告，集合计划份额持有人应根据管理人公告的业务规则办理集合计划份额转让业务。

## 九、集合计划的投资

### 一、投资目标

本集合计划在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的增值。

### 二、投资范围

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、债券回购、股指期货、股票期权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：股票资产占集合计划总资产的50%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的0%-50%），投资于本集合计划界定的核心优势相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的80%；每个交易日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。

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

### 三、投资策略

#### 1、资产配置策略



本集合计划的资产配置主要指“股票类资产”、“债券资产”、“衍生品类资产”等之间的配置比例。管理人将综合运用定量分析和定性分析手段，对证券市场当期的系统性风险以及可预见的未来时期内各大类资产的预期风险和预期收益率进行分析评估，并据此制定大类资产相对最优的配置比例，定期或不定期地进行调整，以达到规避风险及提高收益的目的。在资产配置中，本集合计划主要考虑：（1）宏观经济走势；（2）中观行业盈利；（3）市场估值与流动性；（4）政策因素。

## 2、股票投资策略

本集合计划坚持“成长与价值并重”的选股理念，采用“自上而下与自下而上相结合”的研究方法，根据宏观经济发展趋势及国家政策导向，在可理解可跟踪的行业内，采用定性和定量相结合的方法，严选具有核心竞争优势的股票构建组合。

兼顾成长与价值。以合理价格买入长期优质潜力成长股，选择的投资标的更看重公司质地的优秀、业绩能够保持长期稳定增长预期以及股票估值合理，选择股票强调成长性与合理估值的动态平衡，在追求成长性的同时避免投资标的估值过高的风险。

关注风险收益比。高风险收益比的公司首先具备较高的安全边际，安全边际来自于交易价格与内在价值之差，内在价值来自于自由现金流创造能力。高风险收益比的公司其次具备较大的上行空间，上行空间来自于盈利的超预期空间、市场对公司的未来展望空间，只有成长才能够实现盈利超预期、打开想象空间。

### （1）具有核心优势的公司股票的界定

本集合计划所称“核心优势”公司是指在全球经济增速放缓以及中国经济进入新常态的背景之下，依靠品牌优势、成本优势、特定垄断资源、难以赶超的技术优势、难以颠覆的良性治理体制等核心竞争力，具备国际优势、国内领先地位，预期可实现持续成长的优秀公司。

**核心优势上市公司遴选的标准从盈利和市场地位两方面进行：**

**1) 盈利性指标：营业利润率、净资产收益率、主营业务收入增长率或研发投入总额这四个指标其中之一在行业中从大到小排名前 25%的上市公司；**

2) 市场地位指标：营业收入、营业利润或公司市值这三个指标其中之一处于可比行业前 5 名，或者行业协会、权威咨询机构等第三方统计的市占率排名前 5 名。

同时，本集合计划将对有关公司的发展进行密切跟踪，随着公司的不断发展，相关上市公司的范围也会相应改变。在履行适当必要的程序后，本集合计划将根据实际情况调整具有核心优势的公司股票的界定标准。

### (2) 行业配置策略

从全球视野的角度出发，遵循从国际到国内、从宏观到行业的分析思路，顺应经济周期趋势，结合对行业所处产业环境、产业政策、产业竞争格局的分析和预测，把握各行业的景气走势及成长空间，以此选择各行各业的配置权重，挖掘景气度进入上升周期的行业。

本集合计划重点关注行业增长前景、行业利润前景和行业成功要素这三个指标。针对行业增长前景，主要分析行业的外部发展环境、行业的生命周期以及行业波动与经济周期的关系等；针对行业利润前景，主要分析行业结构，特别是业内竞争的方式、业内竞争的激烈程度、以及业内厂商的谈判能力等。基于对行业结构的分析形成对业内竞争的关键成功要素的判断，为预测企业经营环境的变化建立起扎实的基础。

### (3) 个股的精选

本集合计划通过定性与定量相结合的方法，筛选优质公司，挖掘成长空间，优选预期成长性较好的具备核心竞争优势的估值较为合理的公司的股票构建核心优势特色股票池。

1) 定性分析：本集合计划通过以下两方面标准对股票的基本面进行研究分析并筛选出优质的公司。

一方面是竞争力分析。通过对公司竞争策略和核心竞争力的分析，选择具有可持续竞争优势的公司或未来具有广阔成长空间的公司。具体为：①在中国几十年的经济发展和市场竞争中，通过规模优势、资源优势、技术优势、体制优势等已经建立起明显的核心竞争优势、占据明显的市场份额的优秀企业；②在全球化分工与价值分割的体系中，依靠技术积累、资本投入、成本优势、规模优势等，切入全球化生产体系并在全球价值链体系中不断向上攀爬的优质公

司。

另一方面是公司治理水平分析。本集合计划将对以下因素的综合分析，对公司治理水平进行评判，从中选择具有较高投资价值的上市公司。

①公司制度：公司已建立起完善的法人治理结构，激励与利益分配机制设置合理，内部奖惩分明，升迁有序。②公司长期愿景与企业文化：公司长期愿景清晰，企业文化积极向上，能够激励公司不断向前发展。③公司管理团队：公司管理团队稳定、团结、敬业、专业、诚实并充满激情，能够带领公司员工较好贯彻执行公司战略，并能够有效利用公司资源、控制成本、开拓新业务及发挥自身优势，以带领公司不断成长。④公司研发能力：公司研发能力位居行业前列，能够根据市场需求变化不断对原有产品、原有服务等进行改进，或者不断开发新产品、新服务等，以保持或提高市场占有率和盈利能力。⑤公司营销能力：公司已建立起适合产品或服务特点的营销网络，销售能力较强，可以不断开拓新市场、保持或提高市场占有率。⑥公司大股东与中小股东利益不存在严重不一致。

2) 定量分析：本集合计划通过对公司定量的估值分析，挖掘优质的投资标的。

本集合计划将根据上市公司的行业特性及公司本身的特点，选择合适的估值方法，并对拟投资股票进行多角度估值。可供选择的估值方法包括市盈率法（P/E）、市净率法（P/B）、市盈率—长期成长法（PEG）、企业价值/销售收入（EV/SALES）、企业价值/息税折旧摊销前利润法（EV/EBITDA）、自由现金流贴现模型（FCFF，FCFE）或股利贴现模型（DDM）等。通过估值水平分析，管理人力争发掘出价值被低估或估值合理的股票。

#### （4）股票组合的构建与调整

在行业、个股选择及估值分析的基础上，本集合计划将建立投资组合。当行业或公司的基本面、股票的估值水平出现较大变化时，本集合计划将对股票组合适时进行调整。

#### （5）港股投资策略

本集合计划将仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。本集合

计划重点投资于基本面良好、主要收入来自于中国内地、相对 A 股市场估值合理,具有持续领先优势或核心竞争力及注重现金分红的上市公司进行长期投资。

### 3、债券投资策略

在债券投资方面,本集合计划将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。在类属配置层次,本集合计划结合对宏观经济、市场利率、信用利差等因素的把握,根据对大类资产性价比的判断以及交易所市场类属资产的风险收益特征,定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整,确定类属资产的最优权重。

在券种选择上,本集合计划以长期利率趋势分析为基础,结合经济变化趋势、货币政策及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,坚持稳健投资的原则,严格控制风险,追求合理的回报,实施积极主动的债券投资管理。

随着国内债券市场的深入发展和结构性变迁,更多债券新品种和交易形式将增加债券投资盈利模式,本集合计划将密切跟踪市场动态变化,选择合适的介入机会,谋求高于市场平均水平的投资回报。

### 4、资产支持证券投资策略

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

### 5、股指期货投资策略

管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征,通过资产配置、合约选择,谨慎地进行投资,旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。

### 6、股票期权投资策略

本集合计划投资于股票期权按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,选择流动性好的期权合约进行投资。

## 四、投资限制

### 1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本集合计划股票资产占集合计划总资产的 50%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的 0%-50%），投资于本集合计划界定的核心优势相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的 80%；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(15) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的140%；

(16) 本集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的20%；所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于股票投资比例的有关约定（即本集合计划股票资产占集合计划总资产的50%-95%）；

(17) 本集合计划投资于股票期权的投资限制如下：

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

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

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

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述(2)、(9)、(13)、(14)情形之外, 因证券/期货市场波动、上市公司合并、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资产管理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, 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。

#### 五、业绩比较基准

中证 800 指数收益率×50%+中证港股通综合指数收益率×20%+中证全债指数收益率×30%

中证 800 指数是由中证指数有限公司编制，其成份股是由中证 500 和沪深 300 成份股一起构成，可以综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况，具有良好的市场代表性和市场影响力。中证港股通综合指数是由中证指数有限公司编制，选取符合港股通资格的普通股作为样本股，采用自由流通市值加权计算，是反映港股通范围内上市公司的整体状况和走势的具有代表性的一种股价指数。中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，指数样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，具有广泛的市场代表性。基于本集合计划的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够忠实反映本集合计划的风险收益特征。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者市场推出更具权威、且更能够表征本集合计划风险收益特征的指数，则管理人可与托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后，调整或变更本集合计划的业绩比较基准并及时公告，无需召开集合计划份额持有人大会。

#### 六、风险收益特征

本集合计划是一只混合型集合计划，其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划和货币市场基金，低于股票型基金、股票型集合计划。

本集合计划可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

#### 七、管理人代表集合计划行使股东或债权人权利的处理原则及方法

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



- 2、不谋求对上市公司的控股；
- 3、有利于集合计划财产的安全与增值；
- 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代表或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### 八、集合计划投资组合报告（未经审计）

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

托管人交通银行股份有限公司根据资产管理计划合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告，所载数据截至 2023 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1、报告期末集合计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	263,554,487.78	81.07
	其中：股票	263,554,487.78	81.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	11,972,778.08	3.68
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	34,168,838.30	10.51
8	其他资产	15,409,775.48	4.74
9	合计	325,105,879.64	100.00

注：本集合计划通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 25,541,132.64 元，占资产净值比例为 8.03%。

#### 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

##### （1）报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	196,330,352.40	61.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	392,832.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,244,560.00	0.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,943,504.72	5.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,597.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	24,091,509.02	7.57
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	238,013,355.14	74.82

## (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	8,768,154.69	2.76
消费者常用品	-	-
能源	3,760,814.79	1.18
金融	-	-
医疗保健	4,394,750.30	1.38
工业	5,107,345.06	1.61
信息技术	2,605,339.68	0.82
电信服务	904,728.12	0.28
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	25,541,132.64	8.03

注：1、以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

2、以上行业分类的统计中已包含港股通投资的股票。

3、期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	68,400	13,887,252.00	4.37

2	300124	汇川技术	165,800	11,024,042.00	3.47
3	300416	苏试试验	618,600	10,330,620.00	3.25
4	000157	中联重科	1,279,500	8,764,575.00	2.76
4	01157	中联重科	270,000	1,055,458.03	0.33
5	000858	五粮液	57,700	9,006,970.00	2.83
6	300408	三环集团	289,100	8,962,100.00	2.82
7	688777	中控技术	155,805	7,447,479.00	2.34
8	000733	振华科技	91,500	7,408,755.00	2.33
9	002138	顺络电子	248,000	7,132,480.00	2.24
10	300012	华测检测	371,500	6,939,620.00	2.18

#### 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

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

注：本集合计划本报告期末未持有债券。

#### 6、报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7、报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属。

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

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

#### 9、报告期末本集合计划投资的股指期货交易情况说明

##### (1) 报告期末本集合计划投资的股指期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未持有股指期货。

##### (2) 本集合计划投资股指期货的投资政策

管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标。

#### 10、报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明

##### (1) 本期国债期货投资政策

根据本集合计划合同，本集合计划暂不投资国债期货。

## (2) 报告期末本集合计划投资的国债期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未持有国债期货。

## (3) 本期国债期货投资评价

根据本集合计划合同，本集合计划暂不投资国债期货。

## 11、投资组合报告附注

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

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

## (2) 集合计划投资的前十名股票是否超出集合计划合同规定的备选股票库

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

## (3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	274,509.78
2	应收证券清算款	15,126,157.22
3	应收股利	8,715.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	393.48
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	15,409,775.48

## (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本集合计划本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## (6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 十、集合计划的业绩

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

本集合计划合同变更生效日为 2020 年 4 月 8 日，集合计划业绩截止日为 2023 年 9 月 30 日。

### 一、集合计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 海通核心优势 A

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
合同变更生效日至 2020 年 12 月 31 日	19.40%	0.80%	19.89%	0.78%	-0.49%	0.02%
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	-14.84%	1.24%	-1.47%	0.74%	-13.37%	0.50%
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	-29.16%	1.37%	-11.69%	0.92%	-17.47%	0.45%
2023 年 1 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	-15.95%	0.82%	-2.20%	0.59%	-13.75%	0.23%
合同变更生效日至 2023 年 9 月 30 日	-39.46%	1.12%	2.02%	0.78%	-41.48%	0.34%

#### 海通核心优势 B

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
合同变更生效日至 2020 年 12 月 31 日	19.39%	0.80%	19.89%	0.78%	-0.50%	0.02%
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	-14.84%	1.24%	-1.47%	0.74%	-13.37%	0.50%
2022 年 1 月 1 日至	-29.15%	1.37%	-11.69%	0.92%	-17.46%	0.45%

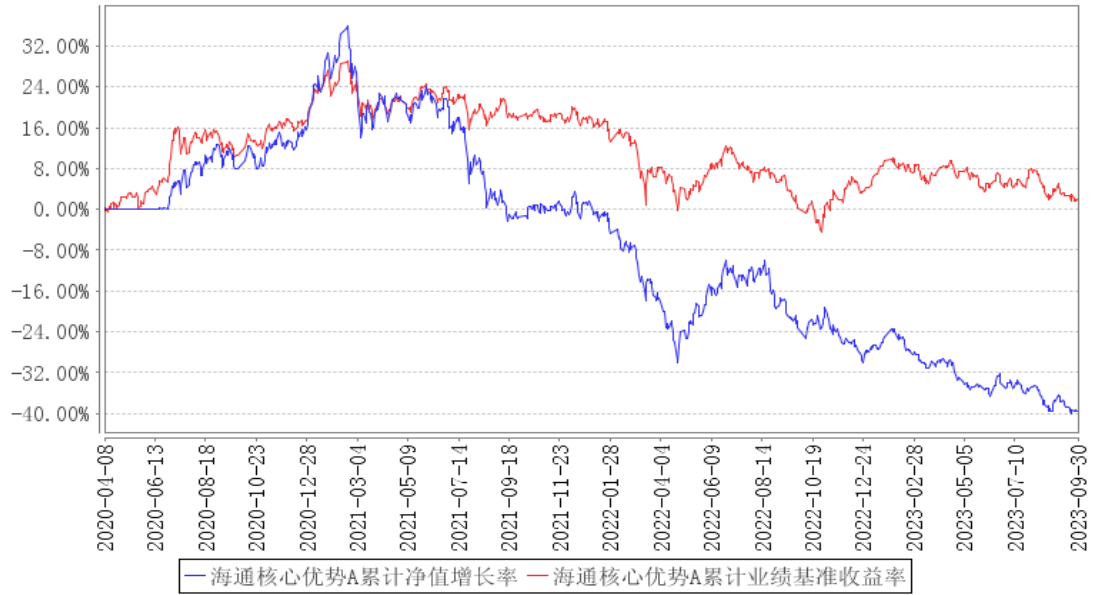
2022年12月31日						
2023年1月1日至 2023年9月30日	-15.95%	0.82%	-2.20%	0.59%	-13.75%	0.23%
合同变更生效日至 2023年9月30日	-39.46%	1.12%	2.02%	0.78%	-41.48%	0.34%

## 海通核心优势 C

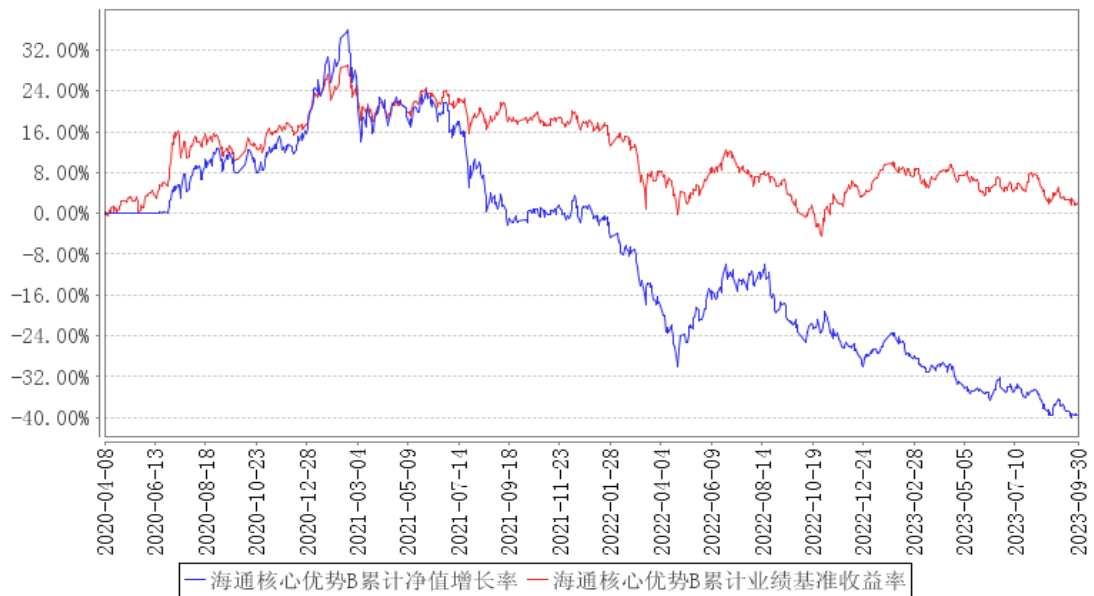
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
合同变更生效日至 2020年12月31日	19.02%	0.80%	19.89%	0.78%	-0.87%	0.02%
2021年1月1日至 2021年12月31日	-15.27%	1.24%	-1.47%	0.74%	-13.80%	0.50%
2022年1月1日至 2022年12月31日	-29.51%	1.37%	-11.69%	0.92%	-17.82%	0.45%
2023年1月1日至 2023年9月30日	-16.26%	0.82%	-2.20%	0.59%	-14.06%	0.23%
合同变更生效日至 2023年9月30日	-40.47%	1.12%	2.02%	0.78%	-42.49%	0.34%

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

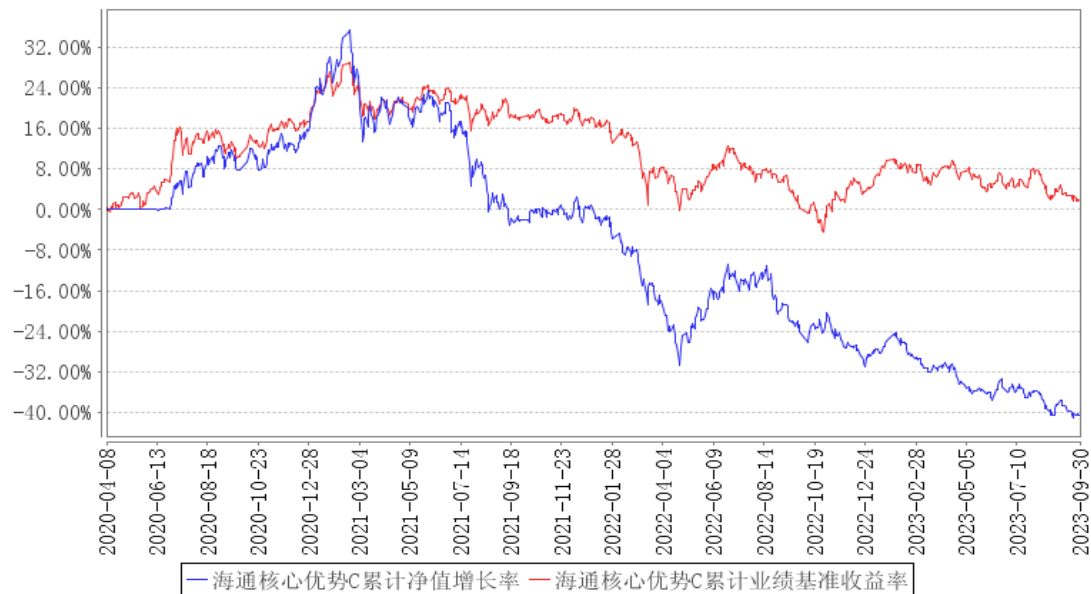
海通核心优势A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通核心优势B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通核心优势C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





## 十一、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。

## 十二、集合计划资产的估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

集合计划所拥有的股票、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

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

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

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

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

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

### 四、估值方法

## 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

(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、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

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

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

6、本集合计划投资股指期货合约，一般以股指期货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。

7、本集合计划投资股指及个股期权合约，一般以股指及个股期权当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

8、估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率的中间价，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

9、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。

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

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

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

根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布，由此给集合计划份额持有人和集合计划造成的损失以及因该交易日集合计划资产净值计算顺延错误而引起的损失，托管人不承担责任。

## 五、估值程序

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

每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。本集合计划各类份额净值未扣除管理人业绩报酬，不同时间参与的份额因申购时集合计划份额净值不同，持有期不同，对应的业绩报酬金额不同，赎回时应承担的业绩报酬金额也不同，实际赎回金额以登记机构确认数据为准。

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，将各类集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人对外公布。

## 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。当任一类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) 错误偏差达到集合计划份额净值的 0.25%时，管理人应当通报托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到集合计划份额净值的 0.5%时，管理人应当公告，并报中国证监会备案；

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### 七、暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4、中国证监会和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各类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各类集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对外公布。

#### 九、特殊情形的处理

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

2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所、证券经纪机构、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。



## 十三、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可进行收益分配，具体分红方案见管理人根据集合计划运作情况届时不定期发布的相关分红公告，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；**若投资者选择将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资，再投资集合计划份额的持有期限与原持有集合计划份额相同（红利再投资取得的 A 类份额和 C 类份额，其锁定持有期的起算日与原持有集合计划份额相同）；**

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

4、由于本集合计划 A 类、B 类和 C 类份额的费用收取方式存在不同，集合计划各份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划每一类别下集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

#### 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。红利再投资的计算方法，依照《业务规则》执行。

## 十四、集合计划的费用与税收

### 一、集合计划费用的种类

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

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、管理人的管理费和业绩报酬

##### （1）管理人的管理费

本集合计划的固定管理费按前一日集合计划资产净值的 0.8%年费率计提。

固定管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划固定管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，由托管人于次月前 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）管理人的业绩报酬

在本集合计划投资者赎回日和集合计划终止日，管理人将根据投资者的期间年化收益率（R），对 B 类计划份额期间年化收益率超过 10% 以上部分按照 20%

的比例收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）；对 A 类或 C 类计划份额期间年化收益率超过 8%以上部分按照 20%的比例收取业绩报酬。

1) 业绩报酬计提原则：

A. 同一投资者不同时间多次申购产品份额的，对投资者每笔参与份额（或红利再投份额）分别计算年化收益率、计提业绩报酬；

B. 在投资者赎回日和集合计划终止日对符合业绩报酬提取条件的份额提取业绩报酬；

C. 在投资者赎回或集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金中扣除；

D. 投资者申请赎回时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序赎回的方式确定赎回份额，计算、提取赎回份额对应的业绩报酬。

2) 业绩报酬计提办法：

业绩报酬计提日为本集合计划赎回申请日和集合计划终止日。每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（以下简称“上一个业绩报酬计提日”，如该笔参与份额未发生业绩报酬计提，募集期认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内申购的，以申购当日为上一个业绩报酬计提日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \div D \times 100\%$$

$P_1$  为投资者本次业绩报酬计提日的单位累计净值；

$P_0$  为投资者上一个业绩报酬计提日的单位累计净值；

$P_0^*$  为投资者上一个业绩报酬计提日的单位净值；

$D$  为投资者上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的年限（1 年按 365 天计算）；

$R$  为期间年化收益率。

管理人业绩报酬计提如下：

A类或C类计划份额 期间年收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (Y) 的计提公式
$R < 8\%$	0	$Y = 0$
$R \geq 8\%$	20%	$Y = A \times (R - 8\%) \times 20\% \times D$
B类计划份额期间年 收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (Y) 的计提公式
$R < 10\%$	0	$Y = 0$
$R \geq 10\%$	20%	$Y = A \times (R - 10\%) \times 20\% \times D$

Y=业绩报酬；

A=每笔参与在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额。

例：某投资者持有 B 类份额 20000 份，申请全部赎回，其持有期限为 183 天，结算日单位资产累计净值为 1.20 元，参与日单位资产累计净值为 1.10 元，参与日单位资产净值为 1.03 元，则

$$R = \frac{(1.20 - 1.10) / 1.03}{183 / 365} \times 100\% = 19.36\%$$

$$Y = 20000 \times 1.03 \times (19.36\% - 10\%) \times 20\% \times (183 / 365) = 193.34 \text{ 元}$$

3) 业绩报酬支付：

业绩报酬由注册登记机构负责计算，托管人根据管理人发送的划付指令，从集合计划资产中支付。

2、托管人的托管费

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.12% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.12\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经管理人与托管人核对一致后，托管人于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、销售服务费

本集合计划 A 类份额、B 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费

年费率为 0.5%。

C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.5%年费率计提，计算方法如下：

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

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内从计划资产划出，管理人无需再出具资金划拨指令。销售服务费由管理人代收，管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及管理人的集合计划行销广告费、促销活动费、份额持有人服务等。

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

### 三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

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

### 四、集合计划税收

本集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。签约各方同意并确认本集合计划在投资、管理和运作过程中涉及的增值税及与增值税相关的附加税费（包括但不限于，城建税、教育费附加及地方教育费附加等）等由集合计划财产及投资人承担，管理人可通过划款指令划付至管理人账户并由管理人依据税务部门要求完成相关纳税申报义务（托管人仅根据管理人出具的划款指令进行税费划付，托管人不承担任何责任）。投资

人实际获得的产品收益金额将可能会因此减少。

如本计划财产进行清算后，发生管理人被税务机关要求补缴应由集合计划资产及投资人承担的增值税及与增值税相关的附加税费（包括但不限于，城建税、教育费附加及地方教育费附加等）的情况，投资人同意向管理人支付该等补缴的税费金额，管理人有权向投资人就补缴的税费金额进行追偿。

## 十五、集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

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

7、托管人每月与管理人就集合计划的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### 二、集合计划的年度审计

1、管理人聘请与管理人、托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本集合计划的年度财务报表进行审计。

2、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得管理人同意。

3、管理人认为有充足理由更换会计师事务所，须通报托管人。更换会计师事务所需在2日内在指定媒介公告。



## 十六、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中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证集合计划投资者能够按照《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，招募说明书的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在指定网站上；招募说明书其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作终止的，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，并登载在指定网站及集合计划销售机构网站或营业网点；产品资料概要其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新产品资料概要。

《海通新兴成长集合资产管理计划合同》变更为《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》的申请经中国证监会批准后，管理人应将集合计划招募说明书提示性公告《资产管理合同》提示性公告登载在指定报刊上，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指定网站上；托管人应当同时将《资产管理合同》、集合计划托管协议登载在网站上。

（二）《资产管理合同》生效公告

管理人应当在指定媒介上登载《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指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，通过指定网站、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，在指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。

遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （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，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。

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，将中期报告登载在指定网站上，并将中期报告提示性公告登载在指定报刊上。

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

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，并登载在指定报刊和指定网站上。

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

- 1、集合计划份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《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、集合计划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、业绩报酬、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

- 15、任一类集合计划份额净值估值错误达该类集合计划份额净值百分之零点五；
- 16、本集合计划开始办理申购、赎回；
- 17、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；
- 18、本集合计划连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；
- 19、本集合计划暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；
- 20、发生涉及集合计划申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；
- 21、管理人采用摆动定价机制进行估值；
- 22、调整集合计划份额类别设置；
- 23、集合计划信息披露义务人认为可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和资产管理合同约定的其他事项。

#### （七）澄清公告

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

#### （八）集合计划份额持有人大会决议

集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （九）投资股指期货信息披露

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

#### （十）投资股票期权信息披露

在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、

持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

#### （十一）投资资产支持证券的信息披露

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

#### （十二）参与港股通交易的信息披露

本集合计划若投资港股通标的股票，管理人应当在年度报告、中期报告和季度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中按届时有效的法律法规或监管机构的要求披露港股通标的股票的投资情况。若中国证监会对集合计划通过港股通机制投资其他股票市场的信息披露另有规定的，从其规定。

#### （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、托管人应当在指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、托管人除依法在指定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于指定媒介披露信息，并且在

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。

## 十七、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、期货市场，而证券、期货市场价格因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而产生波动，从而导致集合计划收益水平发生变化，产生风险。主要的风险因素包括：

(1) 政策风险。因财政政策、货币政策、产业政策、地区发展政策等国家宏观政策发生变化，导致市场价格波动，影响集合计划收益而产生风险。

(2) 经济周期风险。证券市场是国民经济的晴雨表，随着经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化，集合计划投资的收益水平也会随之变化，从而产生风险。

(3) 利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。集合计划投资于债券和股票，其收益水平可能会受到利率变化的影响。

(4) 上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素的影响，如管理能力、行业竞争、市场前景、技术更新、新产品研究开发等都会导致公司盈利发生变化。如果集合计划所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使集合计划投资收益下降。虽然集合计划可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全避免。

(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。

#### 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，可能会由于个股的市场流动性相对不足而无法按预期的价格将股票或债券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，当个股的流动性较差时，管理人被迫在不适当的价格大量抛售股票或债券。两者均可能使集合计划净值受到不利影响。

#### （1）集合计划申购、赎回安排

本集合计划开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日，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。根据法规，当极端情况下需要暂定集合计划资产估值等情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。所以投资者可能面临集合计划暂停申购及赎回的风险。此外，在本集合计划发生巨额赎回情形时，集合计划份额持有人还可能面临延期赎回或暂停赎回的风险。

投资者仅可申购本集合计划 A 类份额、C 类份额，且每份 A 类份额和 C 类份额均设定 1 年的锁定持有期，每份 A 类份额和 C 类份额在锁定持有期内不办理赎回业务。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份 A 类份额和 C 类份额自其开放持有期首日起才能办理赎回业务。因此 A 类份额和 C 类份额的持有人面临在锁定持有期内不能赎回份额的风险。

原海通新兴成长集合资产管理计划份额在资产管理合同生效后变更为 B 类份额。资产管理合同生效后，管理人不办理 B 类份额的申购业务，红利再投资份额除外。对 B 类份额不设置锁定持有期，可在每个开放日办理赎回业务。

#### （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股票市场，投资比例限制采用分散投资原则，股票市场容量较大，能够满足本集合计划日常运作要求，不会对市场造成冲击。股票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。

本集合计划 A 类份额和 C 类份额均设定 1 年的锁定持有期，锁定持有期结束后即进入开放持有期，自其开放持有期首日起才可以办理赎回业务。因此，A 类份额和 C 类份额的持有人可能面临在锁定持有期内无法赎回份额、在大量申

购份额集中进入开放持有期时出现较大赎回的风险。

### (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。

### (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。

## 4、特定风险

本集合计划的股票资产占集合计划总资产的50%-95%，存在投资经理的预判与市场实际表现存在较大差异，导致资产配置不合理，进而影响集合计划收益的风险。

本集合计划若参与港股通标的股票的投资，还需承担汇率风险以及境外市场的风险。

### (1) 汇率风险

本集合计划以人民币募集和计价，但本集合计划通过港股通投资香港证券市场，可投资的港股通标的股票以港币计价。由于人民币汇率在未来存在不确定性，存在因汇率变动而蒙受损失的可能性，因此，投资本集合计划存在一定的汇率风险。

## （2）香港市场的风险

1) 与内地 A 股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，因此，受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险影响更大。

2) 香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

a. 香港市场实行 T+0 回转交易，香港市场证券交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此每日涨跌幅空间相对较大。

b. 只有内地与香港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日。在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险。

c. 香港出现台风、黑色暴雨或者香港联合交易所（以下简称“联交所”）规定的其他情形时，联交所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行交易的风险；出现境内证券交易服务公司认定的交易异常情况时，境内证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

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

3) 本集合计划的港股投资通过港股通进行，面临着港股通制度及其调整的风险：

a. 根据现行的港股通规则，本集合计划因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者其他异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，可以通过港股通卖出，但不得买入；因发行人供股、港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利凭证在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得买入，其行权等事宜按照中国证监会、中国登记

结算有限责任公司的相关规定处理；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，不得通过港股通买入或卖出。

b. 本集合计划将仅通过沪港、深港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度进行境外投资。在联交所开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本集合计划将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

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

#### 5、股指期货投资风险

本集合计划投资于股指期货，因此存在因投资股指期货而带来的风险：

- （1） 市场风险：由于标的价格变动而产生的衍生品的价格波动。
- （2） 市场流动性风险：当集合计划交易量大于市场可报价的交易量而产生的风险。
- （3） 结算流动性风险：集合计划保证金不足而无法交易衍生品，或因指数波动导致保证金低于维持保证金而必须追缴保证金的风险。
- （4） 基差风险：期货市场价格与标的价格不一致所产生的风险。
- （5） 信用风险：交易对手不愿或无法履行契约的风险。
- （6） 作业风险：因交易过程、交易系统、人员疏失、或其他不可预期时间所导致的损失。

#### 6、股票期权投资风险

本集合计划投资于股票期权，因此存在因投资股票期权而带来的风险：

- （1） 市场风险：由于标的价格变动而产生的衍生品的价格波动。
- （2） 流动性风险：当集合计划交易量大于市场可报价的交易量而产生的风险。
- （3） 保证金风险：由于无法及时筹措资金满足建立或者维持衍生品合约头寸所要求的保证金而带来的风险。

(4) 基差风险：指衍生品合约价格和标的指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同衍生品合约价格之间价格差的波动所造成的期现价差风险。

(5) 信用风险：交易对手不愿或无法履行契约的风险。

(6) 操作风险：因交易过程、交易系统、人员疏失、或其他不可预期时间所导致的损失。

#### 7、资产支持证券的投资风险

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。

#### 8、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等。

#### 9、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。

#### 10、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。

#### 11、资产管理合同到期的风险

本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期至 2023 年 12 月 31 日。本集合计划到期后，按照中国证监会相关规定执行。如本集合计划到期后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合份额持有人大会。本集合计划份额持有人将面临在 2023 年 12 月 31 日资产管理合同到期的风险。

#### 二、声明

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

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

## 十八、资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算

### 一、《资产管理合同》的变更

1、变更资产管理合同涉及法律法规规定或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指定媒介公告。

### 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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

#### 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 15 年以上。



## 十九、 资产管理合同的内容摘要

### 一、 集合计划份额持有人、管理人及托管人的权利与义务

#### （一） 集合计划份额持有人的权利与义务

投资者持有本集合计划份额的行为即视为对《资产管理合同》的承认和接受，投资者自依据《资产管理合同》取得的集合计划份额，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议；
- (8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## (二) 管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

- (1) 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、业绩报酬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托管人，如认为托管人违反了《资产管理合同》及国家有关法律规定，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) 在托管人更换时，提名新的托管人；
- (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对被投资公司行使股东权利，为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利；

(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手续；

(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资产净值信息，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》、托管协议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条件下得到有关资料的复印件；

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

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

(20) 因违反《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) 监督托管人按法律法规和《资产管理合同》规定履行自己的义务，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) 托管人的权利与义务

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

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

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

(3) 监督管理人对本集合计划的投资运作, 如发现管理人有违反《资产管理合同》、托管协议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) 设立专门的托管部门, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉托管业务的专职人员, 负责集合计划财产托管事宜;

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,

确保集合计划财产的安全，保证其托管的集合计划财产与托管人自有财产以及不同的集合计划财产相互独立；对所托管的不同的集合计划分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同集合计划之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(4) 除依据《基金法》、《资产管理合同》、《托管协议》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》、《托管协议》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》、《托管协议》及其他有关规定另有规定或有权机关另有要求外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，因向审计、法律等外部专业顾问提供的情况除外；

(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》、《托管协议》的规定进行；如果管理人有未执行《资产管理合同》、《托管协议》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) 从管理人或其委托的登记机构处接收并保存集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；

(14) 依据管理人的指令或有关规定向集合计划份额持有人支付集合计划

收益和赎回款项；

(15) 依据《基金法》、《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管理人、配合集合计划份额持有人依法召集集合计划份额持有人大会；

(16) 按照法律法规和《资产管理合同》、《托管协议》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议；

(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、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》（因不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的除外）；

(2) 更换管理人；

- (3) 更换托管人；
  - (4) 转换集合计划运作方式；
  - (5) 调整管理人、托管人的报酬标准或提高销售服务费；
  - (6) 变更集合计划类别；
  - (7) 本集合计划与其他集合计划的合并；
  - (8) 变更集合计划投资目标、范围或策略；
  - (9) 变更集合计划份额持有人大会程序；
  - (10) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；
  - (11) 单独或合计持有本集合计划总份额 10%以上（含 10%）集合计划份额的持有人（以管理人收到提议当日的集合计划份额计算，下同）就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会；
  - (12) 对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) 法律法规要求增加或调整的集合计划费用的收取；
  - (2) 在法律法规和《资产管理合同》规定的范围内调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率、销售服务费或变更收费方式；
  - (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《资产管理合同》进行修改；
  - (4) 对《资产管理合同》的修改对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《资产管理合同》当事人权利义务关系发生变化；
  - (5) 在法律法规允许的情况下，且在对现有集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，集合计划推出新业务或服务；
  - (6) 在符合法律法规及资产管理合同规定、并且对集合计划份额持有人利益无实质不利影响的前提下，调整本集合计划份额类别的设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整；
  - (7) 在不违反法律法规及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的



前提下，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) 公募基金业绩报酬相关法律法规发布后，本集合计划约定的业绩报酬相关条款根据法律法规进行调整的；

(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，在指定媒介公告。集合计划份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

(1) 会议召开的时间、地点和会议形式；

(2) 会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

(3) 有权出席集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人的权益登记日；

(4) 授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

(四) 集合计划份额持有人出席会议的方式

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

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

(1) 亲自出席会议者持有集合计划份额的凭证、受托出席会议者出具的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书符合法律法规、《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，并与集合计划登记注册机构记录相符。

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）通过方可作出。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 日内在指定媒介上公告。如

果采用通讯方式进行表决，在公告集合计划份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

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

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

### 三、资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算

#### （一）《资产管理合同》的变更

1、变更资产管理合同涉及法律法规规定或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指定媒介公告。

#### （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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

4、集合计划财产清算程序：

(1) 《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具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告，集合计划



财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。

#### （七）集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 15 年以上。

#### 四、争议解决方式

各方当事人同意，因《资产管理合同》而产生的或与《资产管理合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交管理人所在地有管辖权的人民法院起诉。

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。

## 二十、 托管协议的内容摘要

### 一、 托管协议当事人

1、 管理人：上海海通证券资产管理有限公司（具体信息见本招募说明书第四章）

2、 托管人：交通银行股份有限公司

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号

法定代表人：任德奇

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发〔1987〕40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字〔1998〕25 号

经营范围：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；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.63 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

### 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及《资产管理合同》和本协议的约定，对集合计划的投资范围、投资对象进行监督。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会或注册核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央

行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、债券回购、股指期货、股票期权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：股票资产占集合计划总资产的50%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的0%-50%），投资于本集合计划界定的核心优势相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权合约需缴纳的保证金后，现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本集合计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。

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。

托管人对管理人业务进行监督和核查的义务自资产管理合同生效日起开始履行。

2、托管人根据有关法律法规的规定及《资产管理合同》和本协议的约定，对集合计划投资比例进行监督。

根据《资产管理合同》的约定，本集合计划投资组合比例应符合以下规定：

（1）本集合计划股票资产占集合计划总资产的50%-95%（投资于港股通标的股票的比例合计占股票资产的0%-50%），投资于本集合计划界定的核心优势相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的80%；

（2）每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；

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

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

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

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

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

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

(9) 本集合计划应投资于信用评级为 AA 以上（含 AA）的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，在具备市场流动性的情况下，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

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

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

(12) 本管理人管理的全部开放式集合计划持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%；

完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；

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

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

(15) 本集合计划资产总值不超过集合计划资产净值的140%；

(16) 本集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的20%；所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于股票投资比例的有关约定（即本集合计划股票资产占集合计划总资产的50%-95%）；

(17) 本集合计划投资于股票期权的投资限制如下：

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

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

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

(18) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资

限制。

除上述（2）、（9）、（13）、（14）情形之外，因证券市场波动、上市公司合并、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。

托管人依照上述规定对本集合计划的投资组合限制及调整期限进行监督。

3、托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同和本协议的约定，对集合计划投资禁止行为进行监督。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，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。

在资产管理合同生效后 2 个工作日内，管理人和托管人应相互提供与本机构有控股关系的股东、实际控制人或者与本机构有其他重大利害关系的公司名单，以上名单发生变化的，应及时予以更新并通知对方。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

4、托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同和本协议的约定，对管理人参与银行间债券市场进行监督。

(1) 托管人依据有关法律法规的规定和《资产管理合同》的约定对于管理人参与银行间市场交易时面临的交易对手资信风险进行监督。

管理人向托管人提供符合法律法规及行业标准的银行间市场交易对手的名单。托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或回函确认收到该名单。管理人应定期和不定期对银行间市场现券及回购交易对手的名单进行更新。托管人在收到名单后 2 个工作日内电话或书面回函确认，新名单自托管人确认当日生效。新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

(2) 管理人参与银行间市场交易时，有责任控制交易对手的资信风险，由于交易对手资信风险引起的损失，管理人应当负责向相关责任人追偿。

5、托管人根据有关法律法规、资产管理合同和本协议，对管理人投资银行存款业务约定如下：

(1) 管理人、托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保集合计划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，保护集合计划份额持有人的合法权益。

(3) 托管人应加强对集合计划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银行存款业务时，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。

6、托管人对集合计划投资流通受限证券的监督。

(1) 集合计划投资流通受限证券，应遵守《关于基金投资非公开发行股票

等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

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

(3) 管理人应在集合计划首次投资流通受限证券前，向托管人提供经管理人董事会批准的有关集合计划投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。集合计划投资非公开发行股票，管理人还应提供管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于集合计划投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至托管人，保证托管人有足够的时间进行审核。托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

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

(5) 托管人应对管理人提供的有关书面信息进行审核，托管人认为上述资料可能导致集合计划投资出现风险的，有权要求管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看管理人风险管理部门就集合计划投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成集合计划财产损失的，托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。

如管理人和托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。

7. 托管人根据法律法规的规定及《资产管理合同》和本协议的约定，对集



合计划投资其他方面进行监督。

(二) 托管人应根据有关法律法规的规定及资产管理合同的约定, 对集合计划资产净值计算、各类集合计划份额净值计算、应收资金到账、集合计划费用开支及收入确认、集合计划收益分配、相关信息披露、宣传推介材料中登载集合计划业绩表现数据等进行监督和核查。如果管理人未经托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上, 则托管人对此不承担任何责任, 并有权在发现后报告中国证监会。

(三) 管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查, 在规定时间内答复并改正, 就托管人的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集合计划监督报告的, 管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

托管人发现管理人的投资指令或实际投资运作违反《基金法》及其他有关法规、《资产管理合同》和本协议规定的行为, 应及时以书面形式通知管理人限期纠正, 管理人收到通知后应及时核对, 并以电话或书面形式向托管人反馈, 说明违规原因及纠正期限, 并保证在规定期限内及时改正。在限期内, 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, 托管人有权报告中国证监会。

托管人发现管理人有重大违规行为, 应立即报告中国证监会, 同时通知管理人在限期内纠正。

托管人发现管理人的指令违反法律、行政法规和其他有关规定, 或者违反《资产管理合同》约定的, 应当拒绝执行, 立即通知管理人, 并有权向中国证监会报告。

托管人发现管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定, 或者违反《资产管理合同》约定的, 应当立即通知管理人, 并有权向中国证监会报告。

### 三、管理人对托管人的业务核查

根据《基金法》及其他有关法规、《资产管理合同》和本协议规定, 管理人对托管人履行托管职责的情况进行核查, 核查事项包括但不限于托管人是否安全保管集合计划财产、开立集合计划财产的资金账户和证券账户及债券托管账户等投资所需账户, 是否及时、准确复核管理人计算的集合计划资产净值和

各类集合计划份额净值，是否根据管理人指令办理清算交收，是否按照法规规定和《资产管理合同》规定进行相关信息披露和监督集合计划投资运作等行为。

管理人定期和不定期地对托管人保管的集合计划资产进行核查。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，在规定时间内答复并改正。

管理人发现托管人未对集合计划资产实行分账管理、擅自挪用集合计划资产、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》、《资产管理合同》、本协议及其他有关规定的，应及时以书面形式通知托管人在限期内纠正，托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对管理人发出回函。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。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，管理人应报告中国证监会。对管理人按照法规要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的，托管人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

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，同时通知托管人在限期内纠正。

#### 四、集合计划财产的保管

##### （一）集合计划财产保管的原则

1. 托管人应安全保管集合计划财产，未经管理人的指令，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何资产。
2. 集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。
3. 托管人按照规定开立集合计划财产的资金账户、证券账户和债券托管账户等投资所需账户，管理人和托管人按照规定开立期货资金账户。
4. 托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，确保集合计划财产的完整和独立。
5. 对于因为集合计划投资产生的应收资产和集合计划申购过程中产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日集合计划资产没有到达集合计划银行存款账户的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收。由此给集合计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿集合计划的损失。托管人对此不承担任何责任。

## （二）集合计划的银行存款账户的开立和管理

1. 托管人应负责本集合计划银行存款账户的开立和管理。

2. 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存款账户，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保管和使用。

3. 本集合计划银行存款账户的开立和使用，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其他任何银行存款账户；亦不得使用集合计划的任何银行存款账户进行本集合计划业务以外的活动。

4. 托管人可以通过申请开通本集合计划银行账户的企业网上银行业务进行资金支付，并使用交通银行企业网上银行（简称“交通银行网银”）办理托管资产的资金结算汇划业务。

5. 集合计划银行存款账户的管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

## （三）集合计划证券交收账户、资金交收账户的开立和管理

托管人以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开立证券账户。

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。

管理人不得对集合计划证券交收账户、资金交收账户进行证券的超卖或超买。

托管人以托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户即资金交收账户，用于证券交易资金的结算。托管人以本集合计划的名义在托管人处开立集合计划的证券交易资金结算的二级结算备付金账户。

## （四）债券托管账户的开立和管理

1. 资产管理合同生效后，管理人负责向人民银行进行报备，并在备案通过后由托管人在中央国债登记结算有限责任公司及银行间市场清算所股份有限公司以本集合计划的名义开立债券托管账户，并由托管人负责集合计划的债券及资金的清算。管理人负责申请集合计划进入全国银行间同业拆借市场进行交易，由管理人在中国外汇交易中心开设同业拆借市场交易账户。

2. 管理人代表集合计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议，协议正本由管理人保存。

（五）股指期货的相关账户的开立和管理

管理人、托管人应当按照相关规定开立期货资金账户，在中国金融期货交易所获取交易编码。期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照规定设立。

托管人已取得期货保证金存管银行资格，管理人授权托管人办理相关银期转账业务。

（六）集合计划投资银行存款账户的开立和管理

存款账户必须以集合计划名义开立，账户名称为集合计划名称，存款账户开户文件上加盖预留印鉴（须包括托管人印章）及管理人公章。

本集合计划投资银行存款时，管理人应当与存款银行签订具体存款协议或存款确认单据，明确存款的类型、期限、利率、金额、账号、对账方式、支取方式等细则。

为防范特殊情况下的流动性风险，定期存款协议中应当约定提前支取条款。

（七）其他账户的开立和管理

若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许集合计划从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，由管理人协助托管人根据有关法律法规的规定和《资产管理合同》的约定，开立有关账户。该账户按有关规则使用并管理。

（八）集合计划财产投资的有关实物证券、银行存款定期存单等有价凭证的保管

实物证券由托管人存放于托管人的保管库。实物证券的购买和转让，由托管人根据管理人的指令办理。托管人对由托管人以外机构实际有效控制的本集合计划资产不承担保管责任。

银行存款定期存单等有价凭证由托管人负责保管。托管人只负责对存款证实书进行保管，不负责存款证实书真伪的辨别，不承担存款证实书对应存款的本金及收益的安全保管责任。

（九）与集合计划财产有关的重大合同的保管

由管理人代表集合计划签署的与集合计划有关的重大合同的原件分别由托管人、管理人保管，相关业务程序另有限制除外。除本协议另有规定外，管理人在代集合计划签署与集合计划有关的重大合同时应尽可能保证持有二份以上的正本，以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件，管理人应及时将正本送达托管人处。合同的保管期限按照国家有关规定执行。

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授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

## 五、集合计划资产净值计算和会计核算

### （一）集合计划资产净值及集合计划份额净值的计算与复核

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。

管理人应每个工作日对集合计划资产估值。估值原则应符合《资产管理合同》、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及其他法律、法规的规定。用于集合计划信息披露的集合计划资产净值和各类集合计划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资产净值和各类集合计划份额净值，以约定方式发送给托管人。托管人对净值计算结果复核后，将复核结果反馈给管理人，由管理人予以公布。

### （二）集合计划资产估值方法和特殊情形的处理

本集合计划按以下方法估值：

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

(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、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

(3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

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

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

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

6、本集合计划投资股指期货合约，一般以股指期货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。

7、本集合计划投资股指及个股期权合约，一般以股指及个股期权当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

8、估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率的中间价，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

9、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。

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

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

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

根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划资产净值的计算结果对外予以公布，由此给集合计划持有人和集合计划造成的损失以及因该交易日集合计划资产净值计算顺延错误而引起的损失，托管人不承担责任。

### （三）净值错误的处理方式

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。当任一类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) 错误偏差达到集合计划份额净值的 0.25%时，管理人应当通报托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到集合计划份额净值的 0.5%时，管理人应当公告，并报中国证监会备案；

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

#### (四) 集合计划会计制度

按国家有关部门制定的会计制度执行。

#### (五) 集合计划账册的建立

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

#### (六) 会计数据和财务指标的核对

双方应每个交易日核对账目，如发现双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，确保核对一致。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。

#### （七）集合计划招募说明书、定期报告的编制和复核

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。定期报告文件应按中国证监会的要求公告。季度报表的编制，应于季度终了后 15 个工作日内完成；招募说明书的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在指定网站上；招募说明书其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作终止的，管理人不再更新招募说明书。中期报告在集合计划会计年度前 6 个月结束后的两个月内公告；年度报告在会计年度结束后三个月内公告。

管理人在月初 3 个工作日内完成上年度报表的编制，经盖章后，以约定方式将有关报表提供托管人；托管人收到后在 2 个工作日内进行复核，并将复核结果及时书面或双方约定的其他方式通知管理人。对于季度报告、中期报告、年度报告、更新招募说明书等定期报告，管理人和托管人应在上述监管部门规定的时间内完成编制、复核及公告。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，调整以双方认可的账务处理方式为准。如果管理人与托管人不能于应当发布公告之日前就相关报表达成一致，管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

托管人在对财务报表、季度报告、中期报告或年度报告复核完毕后，可以出具复核确认书（盖章）或以其他双方约定的方式确认，以备有权机构对相关文件审核检查。

#### 六、集合计划份额持有人名册的登记与保管

管理人可委托登记机构登记和保管集合计划份额持有人名册。集合计划份额持有人名册的内容包括但不限于集合计划份额持有人的名称和持有的集合计划份额。

集合计划份额持有人名册，包括集合计划募集期结束时的集合计划份额持有人名册、集合计划权益登记日的集合计划份额持有人名册、集合计划份额持有人大会权益登记日的集合计划份额持有人名册、每年最后一个交易日的集合

计划份额持有人名册，由登记机构负责编制和保管，并对集合计划份额持有人名册的真实性、完整性和准确性负责。

管理人应根据托管人的要求定期和不定期向托管人提供集合计划份额持有人名册。

（一）管理人于《资产管理合同》生效日及《资产管理合同》终止日后 10 个工作日内向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册；

（二）管理人于集合计划份额持有人大会权益登记日后 5 个工作日内向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册；

（三）管理人于每年最后一个交易日后 10 个工作日内向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册；

（四）除上述约定时间外，如果确因业务需要，托管人与管理人商议一致后，由管理人向托管人提供由登记机构编制的集合计划份额持有人名册。

托管人以电子版形式妥善保管集合计划份额持有人名册，并定期刻成光盘备份，保存期限为 15 年。托管人不得将所保管的集合计划份额持有人名册用于集合计划托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。若管理人或托管人由于自身原因无法妥善保管集合计划份额持有人名册，应按有关法规规定各自承担相应的责任。

## 七、争议解决方式

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，应通过友好协商或者调解解决。托管协议当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方当事人均有权将争议提交管理人所在地有管辖权的人民法院起诉。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守管理人和托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《资产管理合同》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。

本协议受中华人民共和国法律管辖。

## 八、集合计划托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算

### （一）托管协议的变更

本协议双方当事人经协商一致，可以对本协议进行修改。修改后的新协议，

其内容不得与《资产管理合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议，应报中国证监会备案。

## （二）托管协议的终止

1. 《资产管理合同》终止；
2. 托管人解散、依法被撤销、破产，被依法取消集合计划托管资格或因其他事由造成其他托管人接管集合计划财产；
3. 管理人解散、依法被撤销、破产，被依法取消管理人资格或因其他事由造成其他管理人接管集合计划管理权。
4. 发生《基金法》、《销售办法》、《运作办法》或其他法律法规规定的终止事项。

## （三）集合计划财产的清算

### 1. 集合计划财产清算小组

（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、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

### 2. 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。

3. 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。

#### 4. 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。

#### 5. 集合计划剩余财产的分配

集合计划财产按如下顺序进行清偿：

(1) 支付集合计划财产清算费用；

(2) 缴纳集合计划所欠税款；

(3) 清偿集合计划债务；

(4) 清算后如有余额，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。

#### 6. 集合计划财产清算的公告

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

#### 7. 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。

## 二十一、对集合计划份额持有人的服务

管理人承诺为集合计划份额持有人提供一系列的服务。管理人将根据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）资料寄送

#### 1、集合计划投资者对账单：

管理人将向发生交易的集合计划份额持有人以书面或电子文件形式定期或不定期寄送对账单。

#### 2、其他相关的信息资料。

### （二）多种收费方式选择

管理人在合适时机将为投资者提供多种收费方式购买本集合计划，满足投资者多样化的投资需求，具体实施办法见有关公告。

### （三）集合计划电子交易服务

管理人为投资者提供集合计划电子交易服务。投资人可登录管理人的网站([www.htsamc.com](http://www.htsamc.com))查询详情。

### （四）联系方式

上海海通证券资产管理有限公司

咨询电话：021-23219000

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

## 二十二、其他披露事项

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。

以下信息披露事项已通过指定信息披露媒介进行公开披露：

序号	公告事项	披露日期
1	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划更新招募说明书（2023年第2号）	2023/10/20
2	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划（A类份额）产品资料概要（更新）	2023/10/20
3	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划（B类份额）产品资料概要（更新）	2023/10/20
4	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划（C类份额）产品资料概要（更新）	2023/10/20
5	海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划 2023年第3季度报告	2023/10/25
6	上海海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	2023/11/3
7	上海海通证券资产管理有限公司海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划基金经理变更公告	2023/12/6

---

## 二十三、 招募说明书的存放及查阅方式

本招募说明书存放在管理人和销售机构的办公场所，投资者可免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。



## 二十四、 备查文件

- (一) 中国证监会批准海通新兴成长集合资产管理计划合同变更的文件
- (二) 海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议
- (四) 法律意见书
- (五) 管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 业务规则
- (八) 中国证监会要求的其他文件

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

上海海通证券资产管理有限公司

年 月 日