

中金广运 1 号集合资产管理计划说明书

2026 年 3 月

特别提示:

本说明书依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作规定》)、《中金广运 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“管理合同”、“本合同”、“资产管理合同”或“合同”)及其他有关规定制作,管理人保证本说明书的内容真实、准确、完整,不存在任何虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

投资者承诺以真实身份参与中金广运 1 号集合资产管理计划(以下简称“资产管理计划”或“本计划”或“计划”或“本集合计划”),保证委托财产的来源及用途合法,并已阅知本说明书和《管理合同》全文,了解相关权利、义务和风险,自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划委托财产,但不保证集合计划一定盈利,也不保证最低收益。本说明书约定的业绩比较基准(如有)仅供投资者参考,不构成管理人、托管人和推广机构保证委托财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

投资者签订《管理合同》且合同生效后,投资者即为《管理合同》的份额持有人,其认购或申购集合计划份额的行为本身即表明其对《管理合同》及本说明书的承认和接受。投资者将按照《管理办法》、《管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

名称	中金广运 1 号集合资产管理计划
类型	【混合】类集合资产管理计划
管理人概况	<p>中国国际金融股份有限公司(以下简称“中金公司”)是于 1995 年 6 月 25 日经中国人民银行批准,在北京市成立的中外合资经营企业。中金公司于 1995 年 7 月 31 日领取了国家工商行政管理局颁发的企业法人营业执照,注册资本 1 亿美元,于 1995 年 8 月 11 日正式开始营业。</p> <p>自成立以来,中金公司的业务不断发展,现有投资银行业务、股票业务、固定收益及自营业务、财富管理业务、投资管理业务、研究部业务等主要业务线。作为投资管理业务的核心部门,资产管理部成立于 2002 年,参照国际行业标准与国内监管要求,构建了面向境内外市场统一的资产管理业务平台,致力于为境内外客户提供全方位优质服务,实现客户资产的长期稳步增值。中金公司资产管理业务范围广泛,拥有全国社保基金管理人、保险资金受托管理、企业年金投资管理人、境内集合/定向资产管理、QDII 集合/定向资产管理、外汇资产管理等多项业务资格,并在香港设立了独立的资产管理子公司,获得香港资产管理牌照。</p>
托管人概况	<p>上海银行是上海证券交易所主板上市公司,股票代码 601229。上海银行以“精品银行”为战略愿景,秉持“精诚至上,信义立行”的核心价值观,围绕高质量可持续发展目标,将数字化作为创新驱动、提升能级的核心力量,加快转型发展,努力实现新的质变。</p> <p>自成立以来,上海银行坚守金融企业初心使命,积极融入地方经济建设,助力长三角一体化、京津冀协同、粤港澳大湾区、成渝双城经济圈等战略实施,服务上海“五个中心”“五个新城”、自贸区和临港新片区等创新发展,区域服务能级不断提升;深耕金融“五篇大文章”,着力支持实体经济转型升级,在普惠、科创、绿色、民生等领域加大投入,打造“上行惠相伴”“绿树城银”等特色服务品牌,构建开放合作的创新服务平台,推出“上行 e 链”“上行 e 企赢”“小微快贷”等专业服务体系,业务规模持续增长;不断服务人民美好生活追求,深入建设“适老、为老、惠老”的养老金融服务模式、培育大财富管理专业能力、助力满足场景化消费需求等,为客户提供不止于金融的综合服务。</p> <p>目前,上海银行已在上海、宁波、南京、杭州、天津、成都、深圳、北京、苏州设立一级分行,在无锡、绍兴、南通、常州、盐城、温州、前海、深汕特别合作区、泰州等设立二级分行,分支机构布局覆盖长三角、京津冀、粤港澳和中西部重点城市。陆续设立了上银香港及其子公司上银国际、上银基金及其子公司上银瑞金、上银理财,发起设立村镇银行,与携程共同设立尚诚消费金融,跨境和综合经营布局完善。</p>
投资顾问	本计划不聘请投资顾问。

投资范围	<p>(1) 依法在上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所发行或上市的股票（包括主板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准上市或同意注册的股票）；</p> <p>(2) 现金、银行存款、同业存单、货币市场基金、交易所及银行间逆回购、中国证监会认可的其他现金管理工具；</p> <p>(3) 公开募集基础设施证券投资基金（简称基础设施公募 REITs）或名称中包含“REITs”字样的公募基金。</p>
投资策略	<p>1、决策依据</p> <p>本集合计划以国家有关法律、法规和本合同有关规定为决策依据，并以维护份额持有人利益作为最高准则。具体决策依据包括：</p> <p>(1) 《管理办法》、《运作规定》、本合同、《计划说明书》等有关法律性文件；</p> <p>(2) 国内外经济形势、利率变化趋势以及行业与上市公司基本面研究；</p> <p>(3) 投资对象收益和风险的匹配关系，本集合计划将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。</p> <p>2、决策程序</p> <p>本集合计划投资业务采取投资决策委员会领导下的投资经理负责制。</p> <p>(1) 投资决策委员会</p> <p>投资决策委员会是管理人资产管理部投资管理的最高决策机构，由投资总监及投资经理组成，并定期向资产管理部管理层报告。</p> <p>(2) 投资总监</p> <p>投资总监在投资决策委员会授权的范围内，负责召集和主持投资决策委员会，形成投资决策委员会决议，定期审阅投资组合及决定投资的其它重大事项，组织、管理、协调日常投资、研究工作。</p> <p>(3) 投资经理</p> <p>管理人资产管理部的投资决策机制强调以下两个原则：</p> <p>第一，集体讨论，分级授权。投资决策委员会处于投资决策过程中的核心地位，是管理人资产管理部的最高投资决策机构。投资决策委员会负责确定重大投资方案；投资总监在授权范围内审批投资经理的投资建议；投资经理则在授权范围内构建和调整投资组合；</p> <p>第二，严格风控，科学决策。严格的风险控制是进行科学、合理投资决策的有力保证。</p> <p>3、投资管理的方法和标准</p> <p>在既定的资产配置比例和投资策略安排下，管理人借助内外部研究资源，根据本计划的收益风险特征，结合自身对证券市场的分析判断，按照既定的投资标的筛选标准，具体构造投资组合。</p>
投资限制	<p>本集合计划财产的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 本计划债权类资产的投资比例为 0-80%（不含）；</p> <p>(2) 本计划权益类的投资比例为 0-80%（不含）；</p> <p>(3) 参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，本计划所申报的金额不得超过本计划的总资产，本计划所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>(4) 本计划总资产不得超过净资产的 200%；</p> <p>(5) 除本合同另有约定外，本计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资管计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算；</p> <p>(6) 本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产 50%的，本计划的总资产不得超过净资产的 120%；投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；</p> <p>(7) 投资于单一公司发行的股票的市值不得超过计划资产净值的 10%，且不得超过该股票总股本的 5%（不含），不得超过该股票流通股本的 10%（不含）；</p> <p>(8) 本投资组合不得投资于 PT、ST 股、*ST 股；被动持有的，需在 10 个工作日内全部卖出，若因证券停牌导致无法按时履行的，则待证券复牌后 10 个工作日内全部卖出，因流动性等原因导致无法在上述时限卖出的时限相应顺延；</p>

	<p>(9) 不得主动持有最近一期财报净资产为负值的股票；不得主动持有最近一个会计年度经审计的净利润为负值且营业收入小于 3 亿的沪深主板股票；不得主动持有最近一个会计年度经审计的净利润为负值且营业收入小于 1 亿的科创板、深市创业板和北交所股票；</p> <p>(10) 本计划每日参与债券正回购或逆回购资金余额不超过上一日净资产的 100%；</p> <p>(11) 债券债项及主体评级为 AA 及以上，短期融资券的债项评级为 A-1，可转债债项评级 AA，没有债项评级的品种以主体评级为准；债券评级以中诚信证券、中诚信国际、东方金诚、联合信用、联合资信（不含中债资信）评级公司一年半内公布的最新评级为准，若同一债券不同公司评级不同，以孰低评级为准；</p> <p>(12) 可投资的信用债的发行主体应该在白名单范围内；白名单由委托人和管理人共同制定或修改，并通过邮件方式确认（投资者邮箱为：【lingjiz@boswcm.cn、zhangbr@boswcm.cn】，管理人邮箱为【Xia.Zhou@cicc.com.cn、Yao7.Yao@cicc.com.cn】，投资者和管理人任一邮箱确认即可）；</p> <p>(13) 投资单只债券的投资比例不得超过计划资产净值的 10%（利率债除外）；</p> <p>(14) 投资单只债券的投资比例不得超过债券发行量的 25%（利率债除外）；</p> <p>(15) 本计划持有的单只公募基金，以市值计算，占计划净资产的比例不超过 20%；投资于单只公募基金不超过该基金存续规模的 10%；基金存续规模以基金公司最新公布或提供的数据为准。</p> <p>(16) 本计划所投资的公募基金须在白名单范围内；白名单由委托人和管理人共同制定或修改，并通过邮件方式确认（投资者邮箱为：【lingjiz@boswcm.cn、zhangbr@boswcm.cn】，管理人邮箱为【Xia.Zhou@cicc.com.cn、Yao7.Yao@cicc.com.cn】，投资者和管理人任一邮箱确认即可）；</p> <p>(17) 本计划不得投资封闭型公募基金（不含 REITs 基金）；</p> <p>(18) 法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定和资产管理合同约定的其他禁止或限制的投资事项。</p>
投资风险	<p>投资本计划存在一般风险，包括参与资金本金损失风险、市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、募集失败风险、投资标的风险、中小企业经营风险、股价大幅波动风险、企业退市风险、流动性风险、监管规则变化的风险、税收风险、关联交易风险、操作或技术风险、监管政策风险、适当性管理相关风险、估值风险、参与、退出风险、平仓线风控措施的风险、集合合同提前终止风险、集合合同变更及展期风险、资金前端控制风险、临时开放期风险、发生不可抗力事件的风险等其他风险。此外，投资本计划存在特定风险，包括集合合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险、资产管理计划委托募集所涉风险、资产管理计划份额转让所涉风险、集合计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险、特定投资方法及集合计划所投资的特定投资对象可能引起的特定风险等。具体请见本计划《风险揭示书》。</p>
收益分配	<p>集合计划收益分配是指按规定将集合计划可供分配收益按集合计划份额进行比例分配。</p> <p>(一) 资产管理计划利润的构成</p> <p>本资产管理计划利润指利息收入、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；资产管理计划已实现收益指资产管理计划利润减去公允价值变动损益后的余额。</p> <p>(二) 资产管理计划可供分配利润</p> <p>本资产管理计划可供分配利润指截至收益分配基准日资产管理计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。</p> <p>(三) 收益分配原则</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、本集合计划每一份额享有同等的分配权；</li> <li>2、若自本集合计划成立之日起至年末不满 3 个月则该年度不进行收益分配；</li> <li>3、集合计划收益分配后，收益分配基准日的单位净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值；</li> <li>4、自本集合计划成立之日起每年分配不超过【4】次；</li> <li>5、法律、法规或中国证监会等监管机构另有规定的从其规定。</li> </ol> <p>(四) 收益分配方案的确定、通知和实施</p> <p>本集合计划的收益分配方案由管理人拟定，由托管人复核收益分配方案中的财务数据计算无误后确定，在方案确</p>

	<p>定后5个工作日内在管理人网站进行公告，并在方案公告后的5个工作日内实施。</p> <p>(五) 收益分配的执行方式</p> <p>投资者可以选择收益分配方式为现金或再投资于本集合计划(红利再投)，未做选择的默认是红利再投。投资者可以修改分红方式。选择采取红利再投资方式的，分红资金按分红除权后的份额净值转成相应的集合计划份额(红利再投资不受本计划份额上限的限制)；选择现金方式的，管理人将分红款划入销售机构指定账户，再由销售机构划入份额持有人指定资金账户。</p> <p>特别提示投资者知悉及确认：管理人根据本计划管理运作情况自主确定是否进行收益分配以及每次收益分配的金额，即使本计划有可供分配利润，但并不必然进行收益分配或将全部可供分配利润进行分配。</p>
<p>风险承担</p>	<p>管理人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。</p>
<p>资产管理人、托管人报酬以及与资产管理计划财产管理、运用有关的其他费用的计提标准和计提方式</p>	<p>(一) 费用的种类</p> <p>从集合计划财产中支付的费用种类如下：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、管理费(含业绩报酬(如有))；</li> <li>2、托管费；</li> <li>3、外包服务费(如有)；</li> <li>4、集合计划财产开立账户需要支付的费用、资金结算汇划费(含赎回划款手续费)、账户管理与维护费、网银开户相关费用等；</li> <li>5、集合计划财产的证券、期货交易费用、开户费用(包括但不限于本集合计划所有金融工具的交易费、工商登记及变更费用(如有)、经手费、印花税、过户费、手续费、经纪商佣金等类似性质的费用)；</li> <li>6、注册登记费、电子合同费(如有)；</li> <li>7、本集合计划存续期间发生的信息披露费用、与受托财产投资运作相关的或者为维护投资者利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费和财产保全费等合理费用；</li> <li>8、按照国家有关规定和本合同约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。</li> </ol> <p>(二) 费率、费率的调整、计提方法、计提标准、计提方式和支付方式</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、管理费</li> </ol> <p>(1) 管理费按前一日集合计划资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法如下：</p> $H = E \times 0.2\% \div \text{当年实际天数}$ <p>H为每日应计提的管理费，E为前一日资产净值。(成立日首日不计提管理费)</p> <p>管理人的管理费每日计算，逐日累计至每季度底，按季度支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在季度初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若受托财产现金形式资产不足以支付或遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>管理人可以在法律法规、本合同约定的范围内调低管理费率，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前在管理人网站公告。</p> <p>管理费收款账户信息由管理人向托管人书面提供；管理人如需要变更此账户，应提前1个工作日向托管人出具书面的收款账户变更通知。</p> <p>(2) 管理人的业绩报酬</p> <p>本计划业绩报酬的计提时点分别为分红权益基准日、委托人退出日、计划终止日。就同一笔受托财产，多个业绩报酬收取时点重合时，不重复收取业绩报酬。管理人将根据委托人相应份额的期间年化收益率(R)，对期间年化收益率超过【3.5】%(仅供核算可计提的业绩报酬之用，不构成管理人保证受托资产本金不受损失或取得最低收益的任何承诺)的部分按照【30】%的比例收取业绩报酬；本集合计划的业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，在委托人</p>

退出日及计划终止日根据合同约定提取业绩报酬的，不受上述提取频率的限制。

### 1) 业绩报酬计提原则

①按委托人每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

②在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红权益基准日、委托人退出日、计划终止日计提业绩报酬。为免歧义，分红权益基准日、集合计划终止日，对全部份额计提；份额退出日，对退出的份额计提。

③集合计划分红权益基准日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除，且当次收益分配涉及各笔参与份额对应的业绩报酬计提金额不超过该笔参与份额对应的收益分配金额。在委托人退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。

④在委托人退出或计划终止时，业绩报酬按委托人退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余部分不受影响。

### 2) 业绩报酬计提方法

业绩报酬计提日为本集合计划【分红权益基准日、委托人退出日、计划终止日】，业绩报酬应当分别从分红资金、退出资金或者清算资金中提取。每次业绩报酬的计提期间，以该笔参与份额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”，如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则募集期参与的为本计划成立日，存续期参与的为份额参与确认日，下同）至本次业绩报酬计提日的期间为准。委托人退出时，按照“先进先出”法确定退出的参与份额，分别计算每一笔参与份额应收的管理人业绩报酬。

#### ①期间年化收益率计算

期间年化收益率 $R = [(P1 - P0) / P0x] \times (365 \div T)$

P1=委托人本次业绩报酬计提日的份额累计净值

P0=委托人上一个业绩报酬计提日的份额累计净值

P0x=委托人上一个业绩报酬计提日的份额净值

T=委托人上一个业绩报酬计提日(不含)到本次业绩报酬计提日(含)的天数

#### ②管理人以超额比例的方式提取业绩报酬

管理人根据委托人相应份额的期间年化收益率，对期间年化收益率超过【3.5】%的部分按照【30】%的比例收取业绩报酬：

期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式
$R \leq \text{【3.5】} \%$	0	$E = 0$
$\text{【3.5】} \% < R$	【30】%	$E = N \times P0x \times (R - \text{【3.5】} \%) \times \text{【30】} \% \times (T \div 365)$

P1x=委托人本次业绩报酬计提日的份额净值

E=该笔参与对应的管理人业绩报酬

N= 委托人该笔参与在本次业绩报酬计提日的份额数③将所有参与笔数的管理人业绩报酬加总，得到总的管理人业绩报酬（ $\sum E$ ）。

$\sum E = E1 + E2 + E3 + \dots + En$

其中的 n 为所对应的参与笔数。

④因涉及注册登记数据，业绩报酬由注册登记机构（即管理人）根据本合同约定的方式计算和复核。在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人据此计提应付管理人业绩报酬，托管人不承担复核义务。

### 3) 业绩报酬支付

业绩报酬由管理人在计提日后 3 个工作日内向托管人发送业绩报酬计提金额的指令，托管人根据管理人的指令从受托财产中进行支付并在支付当日通知管理人。若遇法定节假日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期自动顺延。管理人业绩报酬收取账户与管理费收取账户相同。

本合同约定的业绩报酬计提基准（如有）仅供投资者参考，不构成管理人保证受托财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

管理人可以在法律法规、本合同约定的范围内调低业绩报酬收取比例或调高业绩报酬计提基准，并最迟应于新的收取比例或计提基准实施日前在管理人网站公告。

## 2、托管费

托管费按前一日集合计划资产净值的【0.01】%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 【0.01】\% \div \text{当年实际天数}$$

H为每日应计提的托管费，E为前一日资产净值。（成立日首日不计提托管费）

托管人的托管费每日计算，逐日累计至每季度底，按季度支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在季度初的第5个工作日、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若受托财产现金形式资产不足以支付或遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

托管费收款账户以托管人函件通知为准

托管人如需要变更此账户，应提前5个工作日向管理人出具书面的收款账户变更通知。

## 3、证券交易费用：

集合计划运作期间投资所发生的经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、证券投资基金认/申购费和赎回费、佣金等有关税费，作为交易成本按实际发生金额直接扣除。

## 4、与本集合计划存续期相关的费用：

本集合计划存续期间发生的信息披露费用、与受托财产投资运作相关的或者为维护投资者利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费和财产保全费等合理费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据有关法规及相应协议的规定，依管理人的指令，按费用实际支出金额从集合计划资产中支付，列入集合计划费用。

## 5、其他费用：

### （1）银行汇划费用：

银行汇划费用是指由于资金运用等发生资金划转而由托管行收取的费用。收费标准按照国家有关规定执行。

（2）银行结算费用、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、电子合同费，中登服务费等集合计划运营过程中发生的相关费用。

a. 银行结算费用，在每日结算完成后一次或按照集合计划管理人和托管人约定的期限计入集合计划费用；

b. 开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；

c. 与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次计入集合计划费用；

d. 如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。

### （三）不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用、存续期间发生的与募集有关的费用、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资产的损失，以及处理与集合计划运作无关的事项或不合理事项所发生的费用等不列入计划费用。其他具体不列入计划费用的项目依据中国证监会有关规定执行。

### （四）集合计划的税收

本集合计划运作过程中，各类纳税主体依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

根据相关法律法规的要求，自2018年1月1日或税务主管机关确定的其他日期起，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税义务人。本集合计划运营过程中由于上述原因产生的增值税及附加税费由本集合计划财产承担，托管人应在管理人指定时间内，将应缴税款划转至管理人指定账户，由管理人依据税务部门要求完成税款的申报缴纳。如果管理人以固有财产先行垫付上述增值税等税费的，管理人有权优先从集合计划财产中划扣抵偿。本集合计划清算后若管理人被税务机关要求补缴应由集合计划财产承担的上述税费的，则管理人有权向份额持有人就补缴金额进行追偿。

参与 费、退	1、参与费用 本集合计划不收取参与费。
-----------	------------------------

出费	<p>2、退出费用</p> <p>本集合计划不收取退出费。</p>
份额持有人的重要权利和义务	<p>1、份额持有人的权利</p> <p>(1) 分享集合计划财产收益；</p> <p>(2) 取得分配清算后的剩余集合计划财产；</p> <p>(3) 按照本合同及《说明书》的约定，参与、退出和转让集合计划份额；</p> <p>(4) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得集合计划的信息披露资料；</p> <p>(5) 监督管理人、托管人履行投资管理和托管义务的情况；</p> <p>(6) 法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他权利。</p> <p>2、份额持有人的义务</p> <p>(1) 认真阅读并遵守本合同，保证投资资金的来源及用途合法；</p> <p>(2) 保证符合法律、行政法规和监管机构规定的合格投资者的相关标准，不存在法律、行政法规和监管机构规定禁止或限制参与本集合计划的情形；接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，及时、全面、准确地向管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署《投资者承诺书》及其他合格投资者相关文件；前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知管理人或其销售机构；</p> <p>(3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于本集合计划的，应当向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；</p> <p>(4) 按照规定向管理人或者本集合计划销售机构提供信息资料以及身份证明文件，配合管理人或者其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；按照要求签署、提交声明、告知书等相关文件；保证其向管理人或本集合计划销售机构提供的信息和资料真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导，前述信息资料如发生任何实质性变更，应当及时书面告知管理人或其销售机构；投资者应知悉《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，并承诺将严格遵守上述规定，不得实施任何违反前述规定的非法行为；</p> <p>(5) 认真阅读并签署《风险揭示书》，主动了解所投资品种的风险收益特征；确认有能力识别、评估并承担投资于本集合计划及其项下投资品种的各项风险，对本集合计划投资品种的交易结构、运作市场、运作规则、相关风险以及该等风险可能引起的后果和损失有充分清晰的认知和理解；</p> <p>(6) 在持有的集合计划份额范围内，承担本集合计划亏损或者终止的有限责任，退还因管理人、托管人、销售机构差错而获得的不当得利；</p> <p>(7) 按照本合同约定支付集合计划份额的参与款项，承担本合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、为维护资产管理计划财产利益所发生的费用及税费等合理费用；</p> <p>(8) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为；</p> <p>(9) 不得从事任何有损本集合计划及其投资者、管理人管理的其他资产以及托管人托管的其他资产合法权益的活动；</p> <p>(10) 不得利用本集合计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；</p> <p>(11) 保守商业秘密，不得泄露集合计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；</p> <p>(12) 保证其享有签署包括本合同在内的集合计划相关文件的权利，并就签署行为已履行必要的批准或授权手续，且签署和履行上述文件不会违反任何对其有约束力的法律法规、公司章程、合同协议的约定；</p> <p>(13) 保证其所做出的全部声明、保证与承诺在投资本集合计划期间持续有效，如相关情况出现变化需及时告知管理人，管理人有权根据法律法规、监管规定、自律规则做出相关处理，份额持有人将予以配合并承担相关后果和损失；</p> <p>(14) 不得违规转让其所拥有的集合计划份额；</p> <p>(15) 如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，采取有效措施妥善保管与电子签名合同相关的信息和资料，</p>

	<p>防止他人以份额持有人名义实施电子签名行为；</p> <p>(16) 本计划投资于债券的，投资者承诺不得利用本计划直接或间接参与结构化发债或从事利益输送、违规代持等行为。投资者应配合管理人根据监管机构、交易所及自律组织的要求对结构化发债进行核查，包括但不限于提供本人关联方信息、提供穿透后的机构投资者及其关联方信息（如投资者为私募资产管理产品）、及提供其他相关书面资料、承诺等。相关信息发生变化的，应及时告知管理人；</p> <p>(17) 法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他义务。</p>
<p>初始募集期间</p>	<p>本集合计划的初始募集期由管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，具体时间以管理人网站公告为准，但初始募集期自本集合计划份额发售之日起不超过【60 个自然日】。管理人有权根据本集合计划销售的实际情况延长或缩短初始募集期，并通过管理人网站公告方式通知销售机构、托管人和投资者。管理人决定延长或缩短初始募集期的，自管理人网站公告中列明的募集期结束之日起不再接受认购申请。当本集合计划符合法律法规规定及本合同约定的成立条件时，管理人可以提前终止本集合计划的募集。</p>
<p>信息披露的内容、方式和频率</p>	<p>(一) 资产管理合同、计划说明书及风险揭示书</p> <p>管理人或销售机构在投资者参与本计划前向投资者提供本计划之资产管理合同、计划说明书及风险揭示书（风险揭示书为资产管理合同附件），由投资者充分阅读后，独立自主判断是否参与本计划。</p> <p>(二) 净值报告</p> <p>本集合计划封闭期内至少每周披露一次经托管人复核的份额净值。开放期内，管理人应当在【T+1】日内披露集合计划 T 日（T 日为每个开放日）的经托管人复核的份额净值。管理人将通过网站公告、信函、传真、电子邮件、手机短信等本合同约定的方式之一将净值情况告知份额持有人。由于不可抗力原因、或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更，或其他非管理人及托管人的主观意愿原因，未能按上述时点披露复核后份额净值的，管理人和托管人不承担赔偿责任，但应在情况消除后尽快向份额持有人披露复核后的份额净值。</p> <p>投资者确认并知悉，资产管理人披露的净值不代表投资者所能即时获得的现金等财产金额，也不代表将来在财产分配时所能获得的分配金额，净值的估值及披露受限于资产管理合同约定的假设、方法及时效，不构成管理人或托管人对投资者财产本金、收益的任何保证或承诺。</p> <p>(三) 定期报告</p> <p>1、季度报告</p> <p>管理人应在每季度结束之日起 1 个月内通过管理人网站公告披露季度报告，披露报告期内集合计划运作情况，包括但不限于下列信息：</p> <p>(1) 管理人履职报告；</p> <p>(2) 托管人履职报告；</p> <p>(3) 集合计划投资表现；</p> <p>(4) 集合计划投资组合报告；</p> <p>(5) 集合计划运用杠杆情况（如有）；</p> <p>(6) 集合计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；</p> <p>(7) 集合计划投资收益分配情况；</p> <p>(8) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；</p> <p>(9) 中国证监会规定的其他事项。</p> <p>集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，管理人可以不编制集合计划当期的季度报告。季度报告应根据法律法规、监管规定、自律组织规则等要求向监管机构或基金业协会等有权机构备案或报告（如需）。</p> <p>2、年度报告</p> <p>管理人应在每年度结束之日起 4 个月内通过管理人网站公告披露年度报告，披露报告期内集合计划运作情况，包括但不限于下列信息：</p> <p>(1) 管理人履职报告；</p>

- (2) 托管人履职报告;
- (3) 集合计划投资表现;
- (4) 集合计划投资组合报告;
- (5) 集合计划运用杠杆情况 (如有);
- (6) 集合计划财务会计报告;
- (7) 集合计划支付的管理费、托管费、业绩报酬 (如有) 等费用的计提基准、计提方式和支付方式;
- (8) 集合计划投资收益分配情况;
- (9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项;
- (10) 中国证监会规定的其他事项。

年度报告还应包括财务会计报告, 管理人聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计, 并将审计报告提供给托管人, 托管人应当对财务会计报告出具意见。

集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的, 管理人可以不编制集合计划当期的年度报告。年度报告应根据法律法规、监管规定、自律组织规则等要求向监管机构或基金业协会等有权机构备案或报告 (如需)。

#### (四) 临时报告

集合计划存续期间, 发生以下情形的, 对集合计划持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响时, 除本合同另有明确约定的以外, 管理人应在情形发生之日起 5 日内通过管理人网站公告方式披露:

- 1、涉及集合计划重大诉讼、仲裁、财产纠纷的, 以及出现延期兑付、投资标的重大违约等重大风险事件的;
- 2、集合计划因受托财产流动性受限等原因延长清算时间的;
- 3、发生其他对集合计划持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响事件的。

#### (五) 清算报告

管理人应在集合计划终止后按照本合同约定及时编制集合计划财产清算报告, 并提交托管人进行复核。管理人负责将集合计划财产清算报告通过管理人网站公告或其他约定方式告知份额持有人。

#### (六) 向份额持有人披露及份额持有人信息查询的方式

1、管理人有权【自行或委托销售机构】采用下列任何一种或多种方式向份额持有人提供报告或进行相关通知。

##### (1) 传真、电子邮件、短信或其他电子信息传递方式

如份额持有人留有传真号、电子邮箱或手机号等联系方式, 管理人可通过传真、电子邮件、短信或其他电子信息传递方式等方式将报告信息告知份额持有人。

##### (2) 邮寄服务

管理人可向份额持有人邮寄定期报告等有关本集合计划的信息披露文件。份额持有人在销售机构留存的通信地址为送达地址。通信地址如有变更, 份额持有人应当及时以书面方式或以基金管理人规定的其他方式通知管理人或销售机构。

##### (3) 网站

管理人可通过网站向份额持有人进行信息披露。

本集合计划指定信息披露网站为: **【[sip.cicc.com](http://sip.cicc.com)】**

上述网站同样是管理人登载集合计划定期报告和临时报告的网站, 投资者应不时登录上述网站, 查询本计划相关信息。如投资者在登录管理人网站查询时有任何疑问, 或需获取查询密码, 请致电管理人的客户服务电话: **【010-65050105】**。

投资者已充分了解并确认, 上述网站是管理人就本计划涉及信息的发布平台, 管理人在该平台发布了相关信息, 即视为管理人履行了本合同约定的相应信息披露义务。

##### (4) 其他中国证监会以及基金业协会规定的信息披露途径或方式。

2、投资者应确保预先提供的地址、联系人、联系方式、电子邮箱、传真号码、手机号准确有效, 如有变更需及时通知管理人。

	<p><b>(七) 管理人关联方参与的信息披露</b></p> <p>管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与集合计划的，应当向投资者充分披露。</p> <p><b>(八) 向监管机构提供的报告</b></p> <p>管理人、托管人应当根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求履行报告义务。</p> <p>若本合同中约定的管理人、托管人向监管机构报告/备案/抄报等的种类、内容、时间和途径等与法律法规、监管规则和要求不一致的，管理人、托管人应当按照届时有效的法律法规、监管规则和要求执行。各方一致同意不将上述不一致视为任意一方的违约行为。</p>
	<p><b>(一) 本集合计划存在或可能存在的利益冲突情形</b></p> <p><b>1、关联方的范围</b></p> <p>产品涉及的关联方主要包括：(1) 产品管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人、与其有重大利害关系的公司或者其他关联方；(2) 管理人及其控股股东、实际控制人、与其有重大利害关系的公司或者其他关联方设立的金融产品或管理人担任投资顾问的金融产品。管理人的关联方以最近一期上市公司披露年报为基础，结合《公司法》和《企业会计准则》的规定确定，托管人的关联方名单以托管人提供的为准。</p> <p><b>2、关联交易</b></p> <p>关联交易是指本计划与关联方进行的交易，包括但不限于：运用资产管理产品资产投资于上述第 1 项第 (1) 条的主体发行的证券或承销期内承销的证券；投资于上述第 1 项第 (2) 条的金融产品；与上述第 1 项第 (1) 条的主体和第 (2) 条的金融产品进行对手方交易；接受上述第 1 项第 (1) 条的主体发行的债券作为债券逆回购的质押券等。</p> <p>其中：</p> <p>(1) 重大关联交易是指至少符合如下情形之一的关联交易：1) 将本计划受托财产投资于上述第 1 项第 (1) 条的主体发行的或承销期内承销的证券；2) 关联交易单笔交易金额达到或超过本计划净资产的 10%。</p> <p>(2) 一般关联交易是指除上述重大关联交易以外的其他关联交易。</p>
<p>关联交 易及利 益冲突</p>	<p>上述关联交易范围与最新法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求不一致的，以届时适用的法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求为准。</p> <p>3、管理人、托管人及相关从业人员不得利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资。</p> <p>4、全体份额持有人充分知悉并理解，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理受托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能仍会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。</p> <p><b>(二) 利益冲突的处理和披露</b></p> <p>1、管理人运用集合计划财产进行上述第 (一) 款第 2 项所列投资交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定的投资目标、投资策略，并遵循份额持有人利益优先原则，防范利益冲突。</p> <p>2、管理人应当建立健全关联交易的内部审批机制和评估机制，管理人已经制定了关联交易管理制度，对关联交易的决策与审核、定价、信息披露等事项进行了规范。本资产管理计划从事关联交易，管理人应事先履行公司内部审批流程，由投资经理发起申请，经投资总监审批后方可执行。</p> <p><b>3、关联交易的处理和披露</b></p> <p>管理人运用集合计划财产进行上述一般关联交易的，交易前无需另行取得份额持有人的同意或通知份额持有人。</p>

	<p>全体份额持有人知悉并确认，份额持有人签署本合同即视为已授权管理人可进行上述一般关联交易且无需另行征得份额持有人同意。虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的关联交易风险，进而可能影响份额持有人的利益。份额持有人知悉并接受关联交易风险。在交易完成后的合理时间内，管理人应将交易的情况书面通知托管人，并通过管理人的网站公告或合同约定的其他方式告知份额持有人。</p> <p>管理人运用本计划财产进行上述重大关联交易的，交易前可以采取如下方式之一征求份额持有人意见：（1）向份额持有人在本合同签署页预留的电子邮箱发送邮件并披露具体关联交易的情况，份额持有人通过预留电子邮箱回复意见，管理人在取得全体份额持有人回复同意后方可进行相关交易；（2）以公告方式向份额持有人披露具体关联交易的情况并设置临时开放期供不同意的份额持有人退出，不同意的份额持有人应在临时开放期内申请退出，如份额持有人在临时开放期内未申请退出的（包括回复不同意或未明确回复意见但未提出退出申请的）视为同意。在每笔交易完成后的合理时间内，管理人应将关联交易的情况书面通知份额持有人和托管人。</p> <p>如果法律法规、监管规定、自律组织规则及交易所规则等要求管理人就上述投资交易向监管机构、基金业协会或交易所等有权机构报告或备案，管理人按相关规定办理。</p>
可能影响投资者合法权益的其他重要事项	无。



2014年12月

2014年12月

五  
公  
公