

中国国际金融股份有限公司  
中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产  
管理计划招募说明书

管理人：中国国际金融股份有限公司

托管人：中国银行股份有限公司

## 重要提示

中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）由中金转型升级集合资产管理计划变更而来，中金转型升级集合资产管理计划由“金中投转型升级集合资产管理计划”变更而来。“金中投转型升级集合资产管理计划”由管理人依照《证券公司客户资产管理业务试行办法》（证监会令第 17 号）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（证监会公告[2008]26 号）、《金中投转型升级集合资产管理计划集合资产管理合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准设立。“金中投转型升级集合资产管理计划”于 2021 年 8 月 11 日经投资者、管理人、托管人协商一致变更为中金转型升级集合资产管理计划。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告（2018）39 号）的规定，中金转型升级集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，自 2022 年 7 月 29 日起，《中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《中金转型升级集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

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

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

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

本集合计划投资于证券市场，集合计划净值会因为证券市场波动等因素产生

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

集合计划参与内地与香港股票市场交易互联互通机制（以下简称“港股通机制”）下港股通相关业务，集合计划资产投资于港股，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（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）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（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）等。具体风险烦请查阅招募说明书的风险揭示章节的具体内容。

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

本集合计划对每份集合计划份额设置一年的最短持有期限。在最短持有期限内，集合计划份额不能赎回；在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），持有人方可就集合计划份额提出赎回申请。

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

本集合计划可投资于股指期货。股指期货的投资可能面临市场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生

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

本集合计划的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本集合计划的过往业绩并不预示其未来表现，管理人管理的其他产品的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。管理人提醒投资者投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，集合计划运营状况与集合计划净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

## 目 录

重要提示.....	2
第一部分 绪言.....	1
第二部分 释义.....	2
第三部分 管理人.....	8
第四部分 托管人.....	24
第五部分 相关服务机构.....	26
第六部分 集合计划的历史沿革.....	29
第七部分 集合计划的存续.....	30
第八部分 集合计划份额的申购与赎回.....	31
第九部分 集合计划的投资.....	42
第十部分 集合计划的财产.....	52
第十一部分 集合计划资产估值.....	53
第十二部分 集合计划的收益与分配.....	59
第十三部分 集合计划费用与税收.....	61
第十四部分 集合计划的会计与审计.....	64
第十五部分 集合计划的信息披露.....	65
第十六部分 侧袋机制.....	72
第十七部分 风险揭示.....	75
第十八部分 集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算.....	82
第十九部分 集合计划合同的内容摘要.....	84
第二十部分 集合计划托管协议的内容摘要.....	102
第二十一部分 对集合计划份额持有人的服务.....	114
第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式.....	115
第二十三部分 备查文件.....	116

## 第一部分 绪言

《中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）及其他有关规定以及《中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合计划合同”或“《集合计划合同》”）编写。

本招募说明书阐述了中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读招募说明书。

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

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

投资者欲了解集合计划份额持有人的权利和义务，应详细查阅集合计划合同。

## 第二部分 释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合资产管理计划：指中国国际金融股份有限公司设立管理的投资者人数不受 200 人限制的集合资产管理计划

2、集合计划或本集合计划：指中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划

3、管理人：指中国国际金融股份有限公司

4、托管人：指中国银行股份有限公司

5、集合计划合同、《集合计划合同》：指《中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划资产管理合同》及对集合计划合同的任何有效修订和补充

6、托管协议：指管理人与托管人就本集合计划签订之《中金丰裕稳健一年持有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

7、招募说明书、本招募说明书：指《中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划招募说明书》及其更新

8、产品资料概要：指《中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新

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

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

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

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

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

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

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

18、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于集合资产管理计划的自然人

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

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

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

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

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



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

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

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

27、登记机构：指办理登记业务的机构。本集合计划的登记机构为中国国际金融股份有限公司或接受管理人委托代为办理本集合计划份额登记结算业务的机构

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

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

30、集合计划合同生效日或资产管理合同变更生效日：指《中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划资产管理合同》的生效日，原《中金转型升级集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效

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

32、存续期：指《中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效至集合计划合同终止之间的不定期期限

33、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

34、T日：指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的开放日

35、T+n日：指自T日起第n个工作日(不包含T日)

36、开放日：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（若本集合计划参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则管理人有权

根据实际情况决定本集合计划暂停申购、赎回及转换业务并公告)

37、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

38、《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，是规范管理人所管理的并由中国证券登记结算有限责任公司办理登记业务的集合资产管理计划登记方面的业务规则

39、申购：指集合计划合同生效后，投资人根据集合计划合同和招募说明书的规定申请购买集合计划份额的行为

40、赎回：指集合计划合同生效后，集合计划份额持有人按集合计划合同和招募说明书规定的条件要求将集合计划份额兑换为现金的行为

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

42、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

43、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

44、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%

45、元：指人民币元

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

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

48、集合计划资产净值：指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值

49、集合计划份额净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划份额总数

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

51、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括管理人网站、托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介

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

54、不可抗力：指集合计划合同当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

55、A 类份额：指依据集合计划合同，在投资者申购时收取申购费用，但不从本类别计划资产中计提销售服务费的份额

56、C 类份额：指依据集合计划合同，在投资者申购时不收取申购费用，并从本类别计划资产中计提销售服务费的份额

57、最短持有期限：指本集合计划对每份集合计划份额设置一年的最短持有期限。即对于每份份额（包括持有中金转型升级集合资产管理计划份额至集合计划合同生效日的份额以及集合合同生效后的申购份额）申购确认日起（含）至申购确认日的一年对日（如不存在该对日或该对日为非工作日的，则顺延至下一工作日）的前一日的期间。在最短持有期限内，集合计划份额不能赎回；在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），份额持有人方可提出赎回申请

58、侧袋机制：指将集合计划投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专

门账户称为侧袋账户

59、特定资产：包括：（1）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（2）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（3）其他资产价值存在重大不确定性的资产

## 第三部分 管理人

### 一、管理人概况

名称：中国国际金融股份有限公司（以下简称“中金公司”）

住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

成立日期：1995年7月31日

法定代表人：沈如军

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

注册资本：482,725.6868万人民币

联系电话：010-65051166

联系人：吴与伦

### 二、主要人员情况

#### 1、董事会成员

董事会由八名董事组成，包括一名执行董事、三名非执行董事及四名独立非执行董事。董事由选举产生，任期为三年，可于重选后续期。董事会下设多个委员会，并向其转授若干职责。根据有关法律法规、公司章程及境内外上市规则，中金公司已成立六个董事委员会，即战略与ESG委员会、薪酬委员会、提名与公司治理委员会、审计委员会、风险控制委员会及关联交易控制委员会。

沈如军先生，1964年2月出生，自2019年8月起获委任为中金公司董事长，现任中国投资有限责任公司党委委员、执行董事、副总经理，及汇金公司副董事长、执行董事、总经理。沈先生自1984年12月至1998年12月先后担任中国工商银行股份有限公司（一间于上海证券交易所（股份代号：601398）和香港联交所（股份代号：01398）两地上市的公司，以下简称“工商银行”）江苏分行会计处副科长、科长、副处长，计划处副处长（主持工作）、处长。其自1998年12月至2003年11月担任工商银行计划财务部副总经理，自2003年11月至2008年7月担任工商银行北京市分行副行长，自2008年7月至2013年11月担任工商银行财务会计部总经理，自2013年11月至2015年3月担任工商银行山东省分行行长，自2015年3月至2018年6月担任交通银行股份有限公司（一间于上海

证券交易所（股份代号：601328）和香港联交所（股份代号：03328）两地上市的公司，以下简称“交通银行”）副行长，自2018年6月至2018年10月担任交通银行副行长、执行董事。沈先生于2001年从河海大学技术经济学院获博士学位。

黄朝晖先生，1964年1月出生，自2020年2月起获委任为中金公司董事，自2019年12月起获委任为中金公司的首席执行官及管理委员会主席。其于1998年2月加入本集团，并担任投资银行部多个职位，包括负责人、执行负责人及联席负责人等。其亦于2015年4月至2019年12月担任中金公司管理委员会成员。加入本集团前，其于1988年7月至1998年1月加入中国建设银行股份有限公司（一间于香港联交所（股份代号：00939）及于上海证券交易所（股份代号：601939）上市的公司），于宁波市分行担任营业员，并于总行担任投资研究所助理研究员、房地产信贷部高级经济学家、国际业务部副处长及办公室秘书处处长。其现任中金财富、中金香港证券及金腾科技的董事。黄先生于1985年7月取得武汉大学物理学学士学位以及于1988年7月取得中国人民大学经济学硕士学位。

谭丽霞女士，1970年9月出生，全球特许管理会计师，自2020年2月起获委任为中金公司董事。谭女士自1992年8月加入海尔，历任海尔集团海外推进本部长、海尔集团首席财务官、海尔集团高级副总裁等职务。谭女士目前担任的职务包括海尔集团董事局副主席及执行副总裁、海尔集团（青岛）金盈控股有限公司董事长、青岛银行股份有限公司（一间于深圳证券交易所（股份代号：002948）和香港联交所（股份代号：03866）两地上市的公司）非执行董事、青岛海尔生物医疗股份有限公司（一间于上海证券交易所（股份代号：688139）上市的公司）董事长、盈康生命科技股份有限公司（一间于深圳证券交易所（股份代号：300143）上市的公司）董事长，谭女士曾任海尔电器集团有限公司非执行董事及海尔智家股份有限公司（一间于上海证券交易所（股份代号：600690）和香港联交所（股份代号：06690）两地上市的公司）副董事长。谭女士目前担任的社会职务包括：全国妇联第十二届常委、中国女企业家协会副会长、山东省女企业家协会会长和青岛市妇联第十三届副主席。谭女士于1992年6月毕业于中央财经大学财政系，于2009年7月自中欧国际工商学院取得高级管理人员工商管理硕士学位，于2022年1月自瑞士日内瓦大学取得应用金融学高级专业研究博士学位。

段文务先生，1969年6月出生，正高级会计师，自2020年2月起获委任为中金公司董事。段先生自2020年5月至今担任中投保公司（NEEQ：834777）董事长。段先生自2008年5月至2008年11月担任国家开发投资公司（后更名为国家开发投资集团有限公司）财务会计部主任助理，自2008年11月至2010年8月担任国投财务有限公司副总经理，自2010年8月至2014年8月担任国家开发投资公司财务会计部副主任，自2013年3月至2014年8月担任中国成套设备进出口（集团）总公司董事、副总经理，自2014年8月至2017年5月担任国家开发投资公司财务会计部（2016年8月更名为财务部）主任，自2017年5月至2018年3月担任国投安信股份有限公司（2017年12月更名为国投资本股份有限公司，一间于上海证券交易所（股份代号：600061）上市的公司）总经理，自2017年12月至2019年1月担任安信证券股份有限公司董事，自2018年3月至2019年4月担任国投财务有限公司董事长，及自2019年4月至2021年11月担任中投保公司总经理。段先生于1990年7月自厦门大学取得经济学学士学位，于2003年1月自江西财经大学取得工商管理硕士学位。

刘力先生，1955年9月出生，自2016年6月起获委任为中金公司董事。现任北京大学光华管理学院金融系教授，北京大学金融与证券研究中心副主任，博士生导师等多个职位。刘先生自1986年1月起任教于北京大学光华管理学院及其前身经济学院经济管理系，自1984年9月至1985年12月任教于北京钢铁学院。刘先生自2017年6月起担任中国石油集团资本股份有限公司（一间于深圳证券交易所（股份代号：000617）上市的公司）的独立董事。刘先生曾自2011年1月至2021年11月担任中国机械设备工程股份有限公司的独立非执行董事，自2014年9月至2020年11月担任交通银行（一间于上海证券交易所（股份代号：601328）和香港联交所（股份代号：03328）两地上市的公司）的独立非执行董事，并自2016年1月至2020年10月担任深圳市宇顺电子股份有限公司（一间于深圳证券交易所（股份代号：002289）上市的公司）的独立董事。刘先生于1984年7月获得北京大学物理学硕士学位，于1989年7月获得比利时天主教鲁汶大学工商管理硕士学位。

吴港平先生，1957年9月出生，自2022年6月起获委任为中金公司董事，香港会计师公会（HKICPA）、澳大利亚和新西兰特许会计师公会（CAANZ）、澳洲

会计师公会（CPAA）及英国公认会计师公会（ACCA）会员。吴先生为退休的安永会计师事务所中国主席、大中华首席合伙人和安永全球管理委员会成员，在香港和中国内地的会计业有超过 30 年的专业经验。加入安永前，吴先生历任安达信会计师事务所大中华主管合伙人、普华永道中国业务主管合伙人和花旗集团中国投资银行董事总经理。吴先生自 2021 年 8 月起担任中国平安保险（集团）股份有限公司（一间于上海证券交易所（股份代号：601318）和香港联交所（股份代号：02318）两地上市的公司）独立非执行董事，并自 2021 年 4 月起担任北京鹰瞳科技发展股份有限公司（一间于香港联交所（股份代号：02251）上市的公司）独立非执行董事。吴先生现任香港中国商会会长，曾出任中国财政部第一、二届企业会计准则咨询委员会委员，香港商界会计师协会荣誉顾问和香港中文大学会计学院咨询会成员。吴先生亦为香港中文大学（深圳）审计委员会成员和香港中文大学（深圳）教育基金会理事。吴先生于 1981 年 12 月获得香港中文大学工商管理学士学位，于 1988 年 10 月获得香港中文大学工商管理硕士学位。

陆正飞先生，1963 年 11 月出生，自 2022 年 6 月起获委任为中金公司董事。陆先生自 1999 年 11 月至今任北京大学光华管理学院会计系教授及博士生导师，期间历任北京大学光华管理学院会计系副主任、主任、副院长，自 1988 年 7 月至 1999 年 10 月历任南京大学国际商学院助教、讲师、副教授、教授，会计系副主任、主任等职务。陆先生现任中国信达资产管理股份有限公司（一间于香港联交所（股份代号：01359）上市的公司）独立非执行董事、中国生物制药有限公司（一间于香港联交所（股份代号：01177）上市的公司）独立非执行董事、新疆天山水泥股份有限公司（一间于深圳证券交易所（股份代号：000877）上市的公司）独立董事，以及中国人民财产保险股份有限公司（一间于香港联交所（股份代号：02328）上市的公司）独立监事。陆先生自 2013 年 7 月至 2019 年 8 月担任中国银行股份有限公司（一间于上海证券交易所（股份代号：601988）和香港联交所（股份代号：03988）两地上市的公司）独立非执行董事，自 2018 年 11 月至 2019 年 11 月担任中国核工业建设股份有限公司（一间于上海证券交易所（股份代号：601611）上市的公司）独立董事。陆先生于 1985 年 7 月获得浙江工商大学经济学学士学位，于 1988 年 6 月获得中国人民大学经济学硕士学位，于 1997 年 6 月获得南京大学商学院经济学博士学位，于 1997 年 9 月至 1999 年



9月在中国人民大学进行博士后研究工作。

彼得·诺兰先生，1949年4月出生，获颁司令勋章，自2020年2月起获委任为中金公司董事。其自2019年1月至今担任中国光大集团独立非执行董事，自2017年至今担任剑桥大学耶稣学院中国中心主任，自2005年至今担任中国高级管理培训项目主任。诺兰教授自1979年至1997年担任剑桥大学经济与政治学院讲师；自1997年至2012年担任剑桥大学 Judge 商学院 Sinyi 中国管理讲席教授。其自2012年至2016年担任剑桥大学发展研究中心主任和崇华中国发展学教授，自2016年起担任崇华中国发展学荣休教授。诺兰教授自2010年11月至2017年11月任交通银行（一间于上海证券交易所（股份代号：601328）和香港联交所（股份代号：03328）两地上市的公司）的独立非执行董事。诺兰教授于1981年自英国伦敦大学取得经济学博士学位。

## 2、监事

监事会包括三名监事。各监事的服务年期为三年，现届任期自2020年2月28日起计，可于重选后续期。监事会的职责包括审阅董事会编制的财务报告及利润分配方案及监察中金公司的财务并监督董事及高级管理层成员的表现。必要时，彼等亦有权聘请注册会计师及执业审计师对中金公司的财务数据进行再次审计。

高涛先生，1965年1月出生，自2017年6月起当选为中金公司职工代表监事及监事会主席。其自2015年10月起担任中金财富（时称“中投证券”）董事长。其自1991年6月至2005年5月于中国建设银行担任多个职位，包括担任安徽省分行人力资源部副处长、总经理及淮南分行行长。其自2005年5月至2005年9月，担任中国建银投资有限责任公司证券重组工作组成员。其自2005年9月至2006年9月于中投证券担任多个职位，包括担任人力资源部总经理及副总裁。其自2006年9月至2012年9月于宏源证券股份有限公司担任多个职位，包括担任副总经理、董事会秘书及副董事长。其自2012年9月至2015年8月于中国建银投资有限责任公司担任副总裁。高先生于1986年7月毕业于安徽农业大学（前称“安徽农学院”），获学士学位，于2009年1月获中国人民大学高级管理人员工商管理硕士学位。

金立佐先生，1957年6月出生，（曾用名：金立左），自2015年5月起获委

任为中金公司监事。其于 1994 年至 1995 年期间参与创建中金公司。金先生自 2004 年 9 月起担任北京控股环境集团有限公司（一间于香港联交所（股份代号：00154）上市的公司）的独立非执行董事以及自 2020 年 2 月起担任大地国际集团有限公司（一间于香港联交所（股份代号：08130）上市的公司）独立非执行董事。金先生于 1982 年 1 月于北京大学取得经济学学士学位以及于 1993 年 11 月于英国牛津大学（The University of Oxford）取得经济学博士学位，是全英中国经济学会 CEA（英国）创始会长。

崔铮先生，1980 年 12 月出生，自 2020 年 2 月起获委任为中金公司监事，自 2020 年 2 月至今担任汇金综合管理部法律合规处处长。崔先生于 2011 年 7 月加入汇金，历任汇金综合部经理、综合管理部/银行二部经理、高级副经理及法律合规处处长等职务。崔先生自 2003 年 7 月至 2011 年 7 月历任中国电信集团公司企业战略部（法律部）业务主办、业务主管及高级业务主管等职务。崔先生于 2003 年 7 月获得北京大学法学学士学位与经济学学士学位，于 2009 年 7 月获得北京大学法律硕士学位，于 2010 年 7 月获得北京大学工商管理硕士学位。

### 3、高级管理人员

黄朝晖先生，1964 年 1 月出生，自 2020 年 2 月起获委任为中金公司董事，自 2019 年 12 月起获委任为中金公司的首席执行官及管理委员会主席。其于 1998 年 2 月加入本集团，并担任投资银行部多个职位，包括负责人、执行负责人及联席负责人等。其亦于 2015 年 4 月至 2019 年 12 月担任中金公司管理委员会成员。加入本集团前，其于 1988 年 7 月至 1998 年 1 月加入中国建设银行股份有限公司（一间于香港联交所（股份代号：00939）及于上海证券交易所（股份代号：601939）上市的公司），于宁波市分行担任营业员，并于总行担任投资研究所助理研究员、房地产信贷部高级经济学家、国际业务部副处长及办公室秘书处处长。其现任中金财富、中金香港证券及金腾科技的董事。黄先生于 1985 年 7 月取得武汉大学物理学学士学位以及于 1988 年 7 月取得中国人民大学经济学硕士学位。

楚钢先生，1964 年 2 月出生，自 2015 年 4 月起获委任为中金公司的首席运营官及管理委员会成员。彼于 2009 年 5 月加入本集团，并担任研究部董事总经理、资本市场部执行负责人及副首席运营官等多个职位。加入本集团前，彼自 1993 年 9 月至 2008 年 8 月于花旗集团担任多个职位，包括新兴市场风控经理、

美国地方政府债券自营交易员、拉丁美洲股票衍生品交易负责人及另类投资基金董事总经理。彼现任中金公司多间子公司的董事，其中包括中金香港证券。楚先生于 2002 年 9 月合资格为特许金融分析师协会的特许财务分析师。彼于 1987 年 7 月取得中国科学技术大学物理学学士学位，于 1993 年 9 月取得美国东北大学 (Northeastern University) 理论物理学博士学位。彼亦曾就读于美国纽约大学斯特恩商学院 (Leonard N. Stern School of Business of New York University) 直至 1997 年 6 月。

黄劲峰先生，1968 年 7 月出生，自 2017 年 2 月获委任为中金公司的首席财务官及管理委员会成员。彼于 2016 年 5 月加入本集团，担任公司管理部董事总经理。黄先生曾在中国、中国香港、日本及英国任职，拥有二十多年的国际商业银行、国际投行、国内证券公司和会计的从业经验。加入本集团前，黄先生自 2000 年 3 月至 2016 年 5 月就职于高盛和北京高华证券有限责任公司。其中包括 2008 年 6 月至 2016 年 5 月于高盛（亚洲）有限责任公司先后担任资产管理部亚太区首席营运官、亚太除日本首席营运官、产品研发主管和董事总经理。2006 年 11 月至 2008 年 6 月于北京高华证券有限责任公司负责中后台协调、风险管理的工作。并在 2000 年 3 月至 2006 年 11 月间先后在高盛（亚洲），高盛集团（日本东京）担任固定收益外汇及大宗商品产品财务控制负责人、权益类产品财务控制负责人、日本产品财务控制负责人、香港财务控制负责人、执行董事等职务。彼自 1997 年 7 月至 2000 年 2 月于香港汇丰银行担任资本市场财务经理、货币及外汇市场财务经理的职务。自 1991 年 9 月至 1997 年 5 月分别在毕马威会计师事务所—英国及香港先后担任审计、核算见习生、副经理、经理等职务。黄先生持有香港及英国会计师公会的会员资格 20 年以上，于 1994 年 11 月通过英格兰及威尔士特许会计师公会考试和培训等专业要求，正式成为公会会员，注册为特许会计师；并于 1995 年 10 月通过香港会计师公会专业要求，正式成为公会会员并注册为香港会计师。彼现任中金香港董事。黄先生于 1990 年 6 月取得英国布里斯托大学机械工程专业学士学位。

胡长生先生，1966 年 3 月出生，自 2017 年 6 月起获委任为管理委员会成员，于 2020 年 12 月起担任中金基金管理有限公司董事长。彼于 1998 年 12 月至 2005 年 12 月先后担任中国证监会政策研究室综合处副处长、规划发展委员会委员（正

处级)、机构监管部调研员、深圳专员办处长。彼于 2005 年 12 月至 2008 年 1 月担任汇金资本市场部副主任、主任。彼于 2008 年 1 月至 2011 年 11 月担任汇金非银行部资深业务主管及资本市场处主任。彼于 2005 年 12 月至 2010 年 4 月先后担任中国银河证券股份有限公司（一间于香港联交所（股份代号：06881）及上海证券交易所（股份代号：601881）上市的公司）董事、副董事长及代理总裁。彼于 2007 年 1 月至 2010 年 9 月担任中国银河金融控股有限责任公司董事。彼于 2007 年 11 月至 2010 年 1 月担任中国光大实业（集团）有限责任公司董事。彼于 2011 年 3 月至 2012 年 11 月兼任中信建投证券股份有限公司副董事长。彼于 2012 年 11 月至 2015 年 8 月担任中投长春创业投资基金管理有限公司董事长。彼于 2012 年 3 月至 2019 年 11 月担任中金财富证券执委会副主任。彼于 2011 年 11 月至 2020 年 4 月担任中投瑞石投资管理有限责任公司董事长。彼于 2011 年 11 月至 2020 年 11 月担任中金财富证券董事、副董事长，彼于 2011 年 12 月至 2020 年 11 月担任中金财富证券总裁，彼于 2019 年 11 月至 2020 年 12 月担任中金财富证券执委会主任。胡先生于 1997 年 6 月毕业于北京财政部财政科学研究所研究生部，获经济学博士学位。

吴波先生，1977 年 6 月出生，自 2018 年 4 月获委任为中金公司管理委员会成员，自 2017 年 2 月任中金公司的财富管理部负责人，自 2020 年 11 月起担任中金财富证券总裁，自 2022 年 6 月起兼任中金公司股票业务部负责人、证券投资部负责人。彼于 2004 年 5 月加入本集团，并担任多个职位，包括保荐业务部负责人、成长企业投资银行部执行负责人、投资银行部营运团队成员以及董事会秘书。加入本集团之前，吴先生（其中包括）自 1999 年 7 月至 2002 年 6 月担任安达信华强会计师事务所的审计师以及自 2002 年 7 月至 2004 年 4 月担任普华永道中天会计师事务所的高级审计师。吴先生于 1998 年 7 月自北京大学取得经济学学士学位，于 2018 年 7 月取得北京大学光华管理学院联合美国西北大学 Kellogg 管理学院 (Kellogg School of Management, Northwestern University) EMBA 学位。

张克均先生，1966 年 2 月出生，自 2021 年 10 月起获委任为公司管理委员会成员，自 2021 年 8 月起获委任为中金公司党委委员、纪委书记。加入本集团前，彼于 1994 年 4 月至 2021 年 8 月于申万宏源证券有限公司（含其前身申银万

国证券股份有限公司)担任多个职务,主要职务包括分公司总经理、总部部门总经理、公司总经理助理,期间2020年5月至2021年8月担任申万宏源集团股份公司和申万宏源证券有限公司党委委员、纪委书记。彼于1990年4月至1994年4月于福建兴业银行厦门分行工作,先后担任分行部门经理、支行副行长职务。张先生于1990年4月取得国防科技大学计算机软件专业硕士研究生学位。

张逢伟先生,1967年12月出生,自2017年6月起获委任为中金公司首席风险官及风险管理部负责人。彼于2004年4月加入本集团,先后担任多个职位,包括运作部高级经理、风险管理部副总裁、董事总经理及风险管理部执行负责人。彼自2011年3月至2015年2月担任本集团的一间联营企业浙商金汇信托股份有限公司的首席风险官。于加入本集团之前,彼自1991年7月至1996年3月担任STONE Group的程序员及网络工程师,及自1996年4月至2004年3月担任Bank One N. A.北京分行的助理副总裁。张先生于1991年7月于清华大学获应用数学学士学位及于1997年7月于北京大学获经济学硕士学位。

马葵女士,1971年10月出生,自2015年5月及2011年9月起分别获委任为中金公司的财务总监、机构管理部负责人。彼于1998年4月加入本集团并担任多个职位,包括财务部负责人、市场风险部负责人、计划分析部负责人、运营支持部负责人、助理首席财务官、中金浦成董事长及中金佳成董事。加入本集团之前,彼(其中包括)于1995年5月至1997年8月担任摩托罗拉(中国)电子有限公司的会计等职位。彼现任中金公司多间子公司的董事,其中包括中金香港、中金期货、中金香港证券、中金香港资管及中金香港期货。马女士分别于1993年6月及1996年6月自对外经济贸易大学取得国际经济合作学士学位及国际金融硕士学位。

孙男先生,1979年9月出生,自2020年5月起获委任为中金公司董事会秘书。孙男先生现任战略发展部负责人、综合办公室负责人。彼于2003年7月加入中金公司投资银行部,曾担任投资银行全球并购业务负责人、投资银行保荐业务负责人、投资银行业务委员会成员、投资银行运营团队成员、战略研究部负责人等职务,在资本运作、研究等方面经验丰富。孙先生于2001年获得清华大学经济学学士学位,于2003年获得清华大学管理学硕士学位。

徐翌成先生,1974年10月出生,自2020年3月起获委任为中金公司总裁

助理。徐翌成先生现任中金公司资产管理业务板块负责人。彼自 2000 年 1 月加入公司投资银行部，2008 年 1 月成为董事总经理，先后担任多个职位，包括董事会秘书、战略发展部负责人、综合办公室负责人。作为中国第一批并购专业人员，他于 2005 年创立并领导了中金的并购业务。徐先生亲自负责完成了大量具有里程碑意义的并购交易，总价值超过 1,500 亿美元。他带领团队连续五年获得中国并购业务排行榜首位的成绩(2006-2010)。近年来，徐先生协助制定了公司的中长期发展战略，包括财富管理业务战略、资产管理业务战略等重要战略，并牵头完成收购中投证券和引入腾讯作为战略投资者等重要资本运作。徐先生于 1997 年获得北京外国语大学英语学士学位，于 2000 年获得中国人民银行研究生部金融学硕士学位。

程龙先生，1976 年 3 月出生，自 2021 年 10 月起获委任为中金公司首席信息官，自 2021 年 3 月起获委任为中金公司信息技术部负责人。加入本集团前，彼于 2018 年 9 月至 2021 年 3 月担任中泰证券股份有限公司首席信息官、金融科技委员会主任、财富管理委员会副主任兼互联网金融部总经理。彼于 2016 年 2 月至 2018 年 9 月担任东兴证券股份有限公司首席信息官。彼于 2010 年 7 月至 2016 年 2 月担任中信证券股份有限公司首席架构师、信息技术总监、PMO 负责人等职务。彼于 2003 年 7 月至 2010 年 7 月就职于 IBM SOA 中国设计中心、IBM 中国研究院，担任金融市场解决方案负责人、高级研究员。程先生于 1998 年 7 月取得南开大学计算机科学、企业管理双学士学位，以及于 2003 年 7 月取得南开大学计算机科学博士学位。

周佳兴先生，1972 年 8 月出生，自 2021 年 12 月起获委任为公司合规总监，自 2021 年 11 月起获委任为公司法律合规部负责人。彼于 2009 年 6 月加入本集团法律部，于 2016 年 1 月成为董事总经理，自 2017 年 10 月起获委任为中国国际金融（香港）有限公司香港地区法律负责人。加入本集团前，周先生在多家律师事务所从事法律工作：于 2008 年 8 月至 2009 年 3 月担任香港伟凯律师事务所律师，于 2004 年 9 月至 2008 年 7 月担任香港司力达律师事务所律师等。周先生于 1993 年 7 月自南京国际关系学院取得英语师资专业学士学位，于 2000 年 7 月自英国南安普顿大学法学院取得法律专业硕士研究生学位。

#### 4、本集合计划的投资经理

本集合计划投资经理为温泉先生和李楠先生。

温泉，北京大学金融学硕士学位，北京大学物理学学士与经济学学士学位。温泉先生曾任中信证券固定收益部高级副总裁，曾负责多家银行委外资金及自营大账户投资，具备扎实的行业背景和丰富的金融行业从业经验。2009 年之后温泉先生就开始从事固定收益投资管理工作，固定收益投资管理工作年限达到 11 年。温泉先生的投资风格以绝对收益为目标，注重安全边际，持续动态调整组合力争实现收益最大化目标；风格稳健，在组合的收益、流动性之间把握好平衡，严格控制组合信用风险。

李楠，南开大学金融学硕士学位，南开大学光信息科学与技术学士学位。6 年证券从业经历，具有基金从业资格。2015 年加入渤海证券债券销售交易总部（自营投资），历任转债及私募交换债研究员、投资经理助理；2018 年加入中金公司资产管理部，曾担任转债研究员，目前为投资经理。李楠先生对可转债、私募可交换债、分级 A 都有丰富的投研经验，是最早一批参与私募交换债市场的投资者；在债权投资方面也有独到的研究。投资风格以绝对收益为导向，注重比较思维，选择高风险收益比的品种进行配置，力争在低回撤的基础实现净值稳定增长。

#### 5、投资决策委员会成员

温泉，北京大学金融学硕士学位，北京大学物理学学士与经济学学士学位。温泉先生曾任中信证券固定收益部高级副总裁，曾负责多家银行委外资金及自营大账户投资，具备扎实的行业背景和丰富的金融行业从业经验。2009 年之后温泉先生就开始从事固定收益投资管理工作，固定收益投资管理工作年限达到 11 年。温泉先生的投资风格以绝对收益为目标，注重安全边际，持续动态调整组合力争实现收益最大化目标；风格稳健，在组合的收益、流动性之间把握好平衡，严格控制组合信用风险。

李楠，南开大学金融学硕士学位，南开大学光信息科学与技术学士学位。6 年证券从业经历，具有基金从业资格。2015 年加入渤海证券债券销售交易总部（自营投资），历任转债及私募交换债研究员、投资经理助理；2018 年加入中金公司资产管理部，曾担任转债研究员，目前为投资经理。李楠先生对可转债、私募可交换债、分级 A 都有丰富的投研经验，是最早一批参与私募交换债市场的投

资者；在权益投资方面也有独到的研究。投资风格以绝对收益为导向，注重比较思维，选择高风险收益比的品种进行配置，力争在低回撤的基础实现净值稳定增长。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、管理人的职责

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

2、办理集合计划备案手续；

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

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

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

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

7、依法接受托管人的监督；

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

9、进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

10、编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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



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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

24、执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

25、建立并保存集合计划份额持有人名册；

26、法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他义务。

#### 四、管理人承诺

1、管理人将根据集合计划合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、

理念、策略及限制等全权处理本集合计划的投资。

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

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

### 3、集合计划投资经理承诺

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

### 五、管理人的内部控制制度

本集合计划管理人建立了完善的风险管理体系和控制体系，从制度上保障本集合计划的规范运作。

### 1、公司内部控制总体情况

作为一家植根中国，融通世界的领先投资银行，及一家于中国内地注册、在香港上市的公司，中金公司严格遵守中国内地和香港颁布的法律、法规及规范性文件的要求，依法运营。中金公司认识到良好的公司治理至关重要，并已建立公开、透明、分权制衡的治理结构。

中金公司自设立以来一直注重公司内部控制系统建设，逐步形成并完善了公司内部控制系统，符合《证券公司内部控制指引》的规定并参考《企业内部控制基本规范》，并把内部控制的建设始终贯穿于公司经营发展过程之中。中金公司已建立与公司业务性质、规模与复杂程度相适应的内部控制系统，在保证公司经营合法合规、资产安全、财务报告及相关信息真实完整，提高经营效率和效果方面取得了成果。

### 2、公司内部控制目标

中金公司内部控制的目的是：保证公司经营的合法合规及内部规章制度的贯彻执行，防范经营风险和道德风险，保障客户及公司资产的安全、完整，保证公司业务记录、财务信息和其他信息的可靠、完整、及时，提高公司经营效率和效果。

### 3、公司内部控制主要特点

中金公司具有良好的企业管治、有效的风险管理措施及严格的内部控制体系。根据相关法律法规及监管要求，中金公司建立了完善的治理结构体系。中金公司股东大会、董事会和监事会根据《公司法》、《证券法》、《证券公司内部控制指引》、《证券公司全面风险管理规范》、《公司章程》履行职责。中金公司建立了合理、有效、互相制衡的内部控制系统，董事会、监事会、管理层、职能部门、业务部门和分支机构在整个内部控制架构体系中，分工明确、各司其职。

### 4、公司内部控制的体系

管理人根据业务发展、风险管理工作的需求，搭建了包括董事会、监事会、高级管理层、风险管理相关职能部门、业务部门及其分支机构在内的多层次的风险管理组织架构。其中，董事会为中金公司风险管理及内部控制治理架构的最高层级，负责推进公司风险文化建设、审议公司风险管理总体目标、风险偏好、风险容忍度、重大风险限额、风险管理制度。董事会主要通过其下设的风险控制委

员会及审计委员会履行其风险管理职责；监事会承担中金公司全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和管理层在风险管理方面的履职尽责情况并监督整改；在董事会之下，中金公司设立由首席执行官担任主席的管理委员会。管理委员会根据董事会设定的风险管理总体目标确定中金公司的风险偏好，对中金公司全面风险管理的有效性承担主要责任。管理委员会下设的风险委员会向管理委员会汇报风险事务，重大事项向董事会风险控制委员会汇报。风险委员会由首席运营官担任主席，首席风险官和合规总监共同担任执行主席，其他成员包括首席财务官及各业务部门负责人及风险管理相关职能部门负责人；风险管理相关职能部门，包括风险管理部、法律合规部、资金部、财务部、运作部、信息技术部、公共关系部等各内部控制部门，从各自角度相互配合管理各类风险；及业务部门负责人和分支机构负责人承担风险管理有效性的直接责任。在日常业务运营中，业务部门及其分支机构参与业务经营的所有员工都被要求履行风险管理职能。

---

---

## 第四部分 托管人

### 一、托管人情况

#### （一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

#### （二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

#### （三）证券投资基金托管情况

截至2021年9月30日，中国银行已托管968只证券投资基金，其中境内基金920只，QDII基金48只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

#### （四）托管业务的内部控制制度

中国银行托管业务部风险管理与控制工作是中国银行全面风险控制工作的组成部分，秉承中国银行风险控制理念，坚持“规范运作、稳健经营”的原则。中国银行托管业务部风险控制工作贯穿业务各环节，通过风险识别与评估、风险控制措施设定及制度建设、内外部检查及审计等措施强化托管业务全员、全面、全程的风险管控。

2007年起，中国银行连续聘请外部会计会计师事务所开展托管业务内部控制审阅工作。先后获得基于“SAS70”、“AAF01/06”“ISAE3402”和“SSAE16”等国际主流内控审阅准则的无保留意见的审阅报告。2020年，中国银行继续获得了基于“ISAE3402”和“SSAE16”双准则的内部控制审计报告。中国银行托管业务内控制度完善，内控措施严密，能够有效保证托管资产的安全。

#### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当及时通知基金管理人，并及时向国务院证券监督管理机构报告。

---

---

## 第五部分 相关服务机构

### 一、集合计划销售机构

#### 1、直销机构

(1) 中国国际金融股份有限公司

住所：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：沈如军

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

联系电话：010-65051166

联系人：吴与伦

#### 2、其他销售机构

(1) 中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

设立日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

联系电话：95566

联系人：王永民

(2) 中国中金财富证券有限公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元  
办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元

法定代表人：高涛

客户服务电话：95532 / 4006008008

网址：<http://www.cjis.cn/>

(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

网址：<http://www.ccb.com/cn/>

管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本集合计划，管理人新增或变更本集合计划的销售机构时，将按照《信息披露办法》进行公告。

## 二、集合计划登记机构

中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：于文强

电话：010-50938782

传真：010-50938828

联系人：赵亦清

## 三、出具法律意见的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

经办律师：安冬、陆奇

## 四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市黄浦区延安东路222号30楼

办公地址：上海市黄浦区延安东路222号30楼



执行事务合伙人：付建超

电话：021-61418888

传真（北京）：021-63350003

签章注册会计师：马晓波、崔丹

联系人：马晓波

## 第六部分 集合计划的历史沿革

中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划由中金转型升级集合资产管理计划变更而来。

中金转型升级集合资产管理计划于 2021 年 8 月 11 日由“金中投转型升级集合资产管理计划”变更而来。“金中投转型升级集合资产管理计划”为非限定性集合资产管理计划，于 2011 年 11 月 4 日经中国证监会证监许可[2011]1757 号文核准设立，自 2012 年 2 月 6 日起开始募集，于 2012 年 3 月 9 日结束募集工作，并于 2012 年 3 月 22 日正式成立。

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

经中国证监会批准，自 2022 年 7 月 29 日起，《中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《中金转型升级集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。原中金转型升级集合资产管理计划的 A 类份额和 B 类份额在集合计划合同生效后变更为 A 类集合计划份额。

## 第七部分 集合计划的存续

集合计划合同生效后，连续 20 个工作日出现集合计划份额持有人数量不满 200 人或者集合计划资产净值低于 5000 万元情形的，管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现前述情形的，本集合计划将根据集合计划合同的约定清算并终止，且无需召开集合计划份额持有人大会。

法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

## 第八部分 集合计划份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

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

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理集合计划份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（若本集合计划参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则管理人有权根据实际情况决定本集合计划暂停申购、赎回及转换业务并公告），但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或集合计划合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

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

集合计划份额在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。如果投资人多次申购本集合计划份额，则其持有的计划份额的赎回开放时间可能不同。在确定申购开始与赎回开始时间后，管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

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

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

#### 3、申购和赎回申请的确认

管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日)，在正常情况下，登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台

或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功，则申购款项退还给投资人。

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

#### 五、申购和赎回的数量限制

1、投资人单笔申购的最低金额为 1 元，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

2、投资者可将其账户中持有的全部或部分份额赎回，持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 0.01 份。持有人赎回时或赎回后在销售机构（网点）保留的份额余额不足 0.01 份的，在赎回时需一次全部赎回。

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。

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

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

#### 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

##### 1、申购费率

本集合计划 C 类份额不收取申购费用，本集合计划 A 类份额申购费率如下：

A 类集合计划份额	
申购金额（M）	费率
M < 100 万	0.8%
100 万 ≤ M < 500 万	0.4%
M ≥ 500 万	1000 元/笔

募集期间投资人多次申购的，费用按每笔申购金额对应的费率档次分别计算。

## 2、赎回费率

本集合计划对投资者认购或申购的每份基金份额设有一年（一年按 365 天计算，下同）的最短持有期限，集合计划份额持有人在满足最短持有期限的情况下方可赎回，持有满一年后赎回不收取赎回费用。

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

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

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

## 七、申购份额、赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算

当投资者选择申购本集合计划份额时，申购份额的计算方法如下：

#### （1）A 类集合计划份额的计算公式

① 申购费用适用比例费率时：

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类份额的集合计划份额净值

② 申购费用为固定金额时：

申购费用 = 固定金额

净申购金额 = 申购金额 - 申购费用

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 A 类份额的集合计划份额净值

申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类集合计划份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的

收益或损失由集合计划财产承担。

例：某投资者投资 5 万元申购本集合计划 A 类份额，则对应的申购费率为 0.8%，假设申购当日 A 类份额的集合计划份额净值为 1.0500 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,000 / (1 + 0.8\%) = 49,603.17 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,000 - 49,603.17 = 396.83 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 49,603.17 / 1.0500 = 47,241.11 \text{ 份}$$

即：投资者投资 5 万元申购本集合计划 A 类份额，假设申购当日 A 类份额集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 47,241.11 份的 A 类集合计划份额。

例：某投资者投资 550 万元申购本集合计划 A 类份额，则其对应的申购费用为 1000 元，假设申购当日 A 类份额的集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到的集合计划份额的份数计算如下：

$$\text{申购费用} = 1000 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 5,500,000 - 1000 = 5,499,000 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 5,499,000 / 1.0500 = 5,237,142.86 \text{ 份}$$

即：投资人投资 550 万元申购本集合计划 A 类份额，假设申购当日 A 类份额集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 5,237,142.86 份 A 类集合计划份额。

## (2) C 类集合计划份额的计算公式

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} / \text{申购当日 C 类份额的集合计划份额净值}$$

例：某投资者投资 550 万元申购本集合计划 C 类份额，则其对应的申购费用为 0 元，假设申购当日 C 类份额的集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到的集合计划份额的份数计算如下：

$$\text{申购份额} = 5,500,000 / 1.0500 = 5,238,095.24 \text{ 份}$$

即：投资人投资 550 万元申购本集合计划 C 类份额，假设申购当日 C 类份额集合计划份额净值为 1.0500 元，则其可得到 5,238,095.24 份 C 类集合计划份额。

## 2、赎回金额的计算

本集合计划的赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以 T 日的该类别集合计



划份额净值为基准进行计算，本集合计划的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用。

赎回金额的计算方法如下：

赎回费用=赎回份额×T 日该类基金份额的基金份额净值×该类基金份额的赎回费率

赎回金额=赎回份额×T 日该类基金份额的基金份额净值-赎回费用

例：某投资人赎回 10,000 份本集合计划 A 类份额，假设该笔份额持有期限为 100 天，由于持有期限尚未达到最短持有期限（365 天），管理人会对投资人的赎回申请做赎回失败处理。

例：某投资人赎回 10,000 份本集合计划 A 类份额，假设该笔份额持有期限为 500 天，持有期限已达到最短持有期限（365 天），赎回不收取赎回费用。假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为：

赎回费用 = 0.00 元

赎回金额 =  $10,000 \times 1.0160 - 0.00 = 10,160.00$  元

即：投资人赎回 10,000 份本集合计划 A 类份额，假设赎回当日 A 类基金份额净值是 1.0160 元，则其可得到的赎回金额为 10,160.00 元。

### 3、集合计划份额净值计算

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

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

### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致集合计划无法正常运转。
- 2、发生集合计划合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券、期货交易所交易时间非正常停市或休市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值。

4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有集合计划份额持有人利益时。

5、集合计划资产规模过大，使管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对集合计划业绩产生负面影响，或发生其他损害现有集合计划份额持有人利益的情形。

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

7、管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有集合计划份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。

8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

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

#### 九、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

1、因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

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

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

4、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份额持有人利益的情形时，管理人可暂停接受份额持有人的赎回申请。

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，按集合计划合同的相关条款处理。份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

### 十、巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

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

#### 2、巨额赎回的处理方式

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

（1）全额赎回：当管理人认为有能力支付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) 在出现巨额赎回时，对于单个集合计划份额持有人当日超过上一开放日集合计划总份额 10%以上的赎回申请，管理人可以对超过的部分全部进行延期办理，具体措施如下：延期的赎回申请将自动与下一个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。如该单个集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于此类持有人未超过上述比例的部分，管理人有权根据前述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”的方式与其他持有人的赎回申请一并办理。但是，如此类持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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

### 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，并根据《信息披露办法》的规定在规定媒介上刊登公告。

### 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

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

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

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

### 十二、集合资产管理计划转换

管理人可以根据相关法律法规以及集合计划合同的规定决定开办本集合计

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

### 十三、集合计划的非交易过户

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

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

### 十四、集合计划的转托管

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

### 十五、定期定额投资计划

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

### 十六、集合计划份额的冻结和解冻

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

### 十七、集合计划份额的转让

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

公告，集合计划份额持有人应根据管理人公告的业务规则办理集合计划份额转让业务。

十八、如相关法律法规允许管理人办理其他集合计划业务，管理人将制定和实施相应的业务规则。

十九、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回

本集合计划实施侧袋机制的，本集合计划的申购与赎回安排详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定或相关公告。

## 第九部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

在严格控制风险的前提下，力争实现集合计划资产持续稳定增值。

### 二、投资范围

本集合计划投资于国内依法发行上市的股票（含创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本集合计划可以根据法律法规的规定参与融资业务。

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

可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券及股票资产的比例为集合计划资产的 0-30%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）。

每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划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、应收申购款等；股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本集合计划的投资比例将做相应调整。

### 三、投资策略

#### 1、资产配置策略

本集合计划将密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产和权益类资产等资产类别之间进行动态配置，确定资产的配置比例。

## 2、固收收益类资产投资策略

### (1) 债券投资策略

本集合计划在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理。

1) 在久期配置方面，本集合计划将对宏观经济走势、经济周期所处阶段和宏观经济政策动向等进行研究，预测未来收益率曲线变动趋势，并据此积极调整债券组合的平均久期，提高债券组合的总投资收益。

2) 在类属配置方面，本集合计划将对宏观经济周期、市场利率走势、资金供求变化，以及信用债券的信用风险等因素进行分析，根据各债券类属的风险收益特征，定期对债券类属资产进行优化配置和调整，确定债券类属资产的权重。

3) 在期限结构配置方面，本集合计划将对市场收益率曲线变动情况进行研判，在长期、中期和短期债券之间进行配置，适时采用子弹型、哑铃型或梯型策略构建投资组合，以期在收益率曲线调整的过程中获得较好收益。

4) 在个券选择方面，对于国债、央行票据等非信用类债券，本集合计划将根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析，预测未来收益率曲线的变动趋势，综合考虑组合流动性决定投资品种；对于信用类债券，本集合计划将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素，对信用债进行信用风险评估，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。本集合计划投资的信用债券中，其经国内依法成立并拥有证券评级资质的信用评级机构认定的最新债项评级须在 AA 及以上，评级机构为中债资信评级除外，前述品种无债项评级或债项评级为短期信用评级的则参考主体评级。其中，债项评级为 AAA 的信用债投资占信用债资产的比例不低于 50%；债项评级为 AA+ 的信用债投资占信用债资产的比例为 0-50%；债项评级为 AA 的信用债投资占信用债资产的比例为 0-20%。

以上信用债券包括金融债（不含政策性金融债）、公司债、企业债、公开发行的次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、证券公司短期公司债券、资产支持证券等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

### 5) 证券公司短期公司债券投资策略



本集合计划将根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。此外，由于证券公司短期公司债券整体流动性相对较差，本集合计划将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资，保证本集合计划的流动性。

#### （2）可转换债券及可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值，本集合计划管理人将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。个券挑选方面，主要关注正股资质、正股估值和转债估值，精选正股资质较好、成长性和正股估值匹配且转债估值合理的个券，或是有条款博弈机会的个券。风险控制方面，具体关注转债价格、转股溢价率、平价底价溢价率（即转股价值/纯债价值-1）等估值风险关注回售、强制赎回等条款的影响，关注转债的信用风险和退市风险等。本集合计划投资可转换债券及可交换债券的比例不高于本集合计划资产的 20%。

此外，本集合计划还将根据新发可转债和可交换债券的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转债和可交换债券新券的申购。

#### （3）杠杆投资策略

本集合计划将对资金面进行综合分析的基础上，比较债券收益率、存款利率和融资成本，判断利差空间，力争通过杠杆操作提高组合收益。

#### （4）银行存款、同业存单投资策略

本集合计划根据宏观经济指标分析各类资产的预期收益率水平，并据此制定和调整资产配置策略。当银行存款、同业存单投资具有较高投资价值时，本集合计划将提高银行存款、同业存单投资比例。

### 3、股票投资策略

#### （1）行业配置策略

本集合计划将通过分析以下因素，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。

##### 1) 行业景气度

本集合计划将密切关注国家相关产业政策、规划动态，并结合行业数据持续

跟踪、上下游产业链深入进行调研等方法，根据相关行业盈利水平的横向与纵向比较，适时对各行业景气度周期与行业未来盈利趋势进行研判，重点投资于景气度较高且具有可持续性的行业。

## 2) 行业竞争格局

本集合计划主要通过密切跟踪行业进入者的数量、行业内各公司的竞争策略及各公司产品或服务的市场份额来判断公司所处行业竞争格局的变化，重点投资于行业竞争格局良好的行业。

### (2) 个股投资策略

#### 1) 公司基本面分析

在行业配置的基础上，本集合计划将重点投资于满足管理人以下分析标准的公司：公司经营稳健，盈利能力较强或具有较好的盈利预期；财务状况运行良好，资产负债结构相对合理，财务风险较小；公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范、具有清晰的长期愿景与企业文化、信息透明。

#### 2) 估值水平分析

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，选择合适的股票估值方法。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。

#### 3) 股票组合的构建与调整

本集合计划在行业分析、公司基本面分析及估值水平分析的基础上，进行股票组合的构建。当行业、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动态调整。

考虑到香港股票市场与 A 股股票市场的差异，对于港股通标的股票，本集合计划除按照上述“自下而上”的个股精选策略，还将结合公司基本面、国内经济和相关行业发展前景、香港市场资金面和投资者行为，以及世界主要经济体经济发展前景和货币政策、主流资本市场对投资者的相对吸引力等因素，精选符合本集合计划投资目标的港股通标的股票。

#### 4、存托凭证投资策略

本集合计划可投资存托凭证，本集合计划将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。

#### 5、衍生产品投资策略

##### (1) 股指期货、国债期货、股票期权投资策略

本集合计划可投资股指期货、国债期货、股票期权。若本集合计划投资股指期货、国债期货、股票期权，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、国债期货、股票期权合约进行交易，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量、降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。

(2) 本集合计划将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许基金投资前述衍生工具，本集合计划将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本集合计划投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。

6、为了更好地实现投资目标，在综合考虑预期风险、收益、流动性等因素的基础上，本集合计划可参与融资业务。

7、未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，管理人履行适当程序后，可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在招募说明书更新中公告。

#### 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) 可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券及股票资产的比例为集合计划资产的0-30%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%）；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和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的5%的现金或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、应收申购款等；

(3) 本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港市场同时上市的A+H股合并计算）不超过集合计划资产净值的10%；

(4) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

(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) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9) 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；

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

(11) 本集合计划参与股指期货、国债期货交易，应当符合下列投资限制：

1) 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%；

2) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债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；

3) 在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%；

4) 本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合《集合计划合同》关于股票投资比例的有关规定；

5) 本集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交

金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 20%；

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

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

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

(12) 本集合计划投资股票期权的，应当遵守下列限制：

1) 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) 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) 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；

(13) 本集合计划的集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的 140%；

(14) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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

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

(17) 本集合计划参与融资业务后，在任何交易日日终，本集合计划持有的

融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%；

(18) 本集合计划投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(19) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等集合计划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，为被动超标，不属于集合计划管理人违反集合计划合同的情形。集合计划管理人应当在所涉证券可交易之日起 10 个交易日内进行调整，上述第 (2)、(15)、(15) 项对调整时间另有约定的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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

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

## 2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他集合资产管理计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

(5) 向其管理人、托管人出资；

(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其

他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求，在履行适当程序后，本集合计划可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述禁止行为规定或从事关联交易的条件和要求进行变更的，在履行适当程序后，本集合计划可以变更后的规定为准。

#### 五、业绩比较基准

本集合计划的业绩比较基准为中债新综合指数(财富)收益率 $\times$ 85%+中证800指数收益率 $\times$ 12%+中证港股通综合指数收益率 $\times$ 3%。

本集合计划选定被市场广泛认同的中证 800 指数和中证港股通综合指数作为股票部分的业绩比较基准，中债新综合指数（财富）作为固定收益部分的业绩比较基准。此外，本集合计划还参考预期的大类资产配置比例设置了业绩比较基准的权重。

如果指数编制单位停止计算编制该指数或更改指数名称，或今后法律法规发生变化，或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本管理人可依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，经履行适当程序，调整业绩比较基准并及时公告，而无需召开集合计划份额持有人大会。

#### 六、风险收益特征

本集合计划为混合型集合资产管理计划，预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划，低于股票型基金、股票型集合资产管理计划。

#### 七、管理人代表集合计划行使股票或债权人权利的处理原则及方法

- 1、管理人按照国家有关规定代表集合计划独立行使股东或债权人权利，保护集合计划份额持有人的利益；
- 2、不谋求对上市公司的控股；
- 3、有利于集合计划财产的安全与增值；

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

#### 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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



## 第十部分 集合计划的财产

### 一、集合计划资产总值

集合计划资产总值是指购买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托管账户、证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的集合计划专用账户与管理人、托管人、集合计划销售机构和登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。

### 四、集合计划财产的保管和处分

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

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

---

---

## 第十一部分 集合计划资产估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

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

### 三、估值原则

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

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

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

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

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

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、存托凭证等），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实行净价交易的固定收益品种（本合同另有规定的除外），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；交易所上市或挂牌转让的实行全价交易的固定收益品种，选取第三方估值机构提供的当日估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，具体估值机构由管理人与托管人另行协商约定；

(3) 交易所上市交易的可转换债券，以每日收盘价作为估值全价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境或证券发行机构未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；如最近交易日后经济环境或证券发行机构发生了重大变化的，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；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；

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

##### 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、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、对全国银行间市场交易的固定收益品种，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。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，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、债券回购以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

6、定期存款以本金列示，按商定的存款利率在实际持有期间内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。

7、股指期货、国债期货合约以及交易所交易的股票期权一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

8、如本集合计划投资股票市场交易互联互通机制允许买卖的境外证券市场上市的股票，涉及相关货币对人民币汇率的，届时根据相关法律法规及监管机构的要求确定汇率来源，如法律法规及监管机构无相关规定，管理人与托管人协商一致后确定本集合计划的估值汇率来源。

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

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

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

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

## 五、估值程序

1、各类集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，该类集合计划资产净

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。集合计划管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

管理人每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。

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

## 六、估值错误的处理

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

集合计划合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后, 有关的当事人应当及时进行处理, 处理的程序如下:

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

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

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

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

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下:

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

(2) 错误偏差达到或超过该类集合计划份额净值的 0.25% 时, 管理人应当通报托管人并报中国证监会备案; 错误偏差达到或超过该类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。如果行业另有通行做法, 管理人和托管人应本着平等和保护集合计划份额持有人利益的原则进行协商。

## 七、暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4、中国证监会和集合计划合同认定的其它情形。

## 八、集合计划净值的确认

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

## 九、特殊情况的处理

(1) 管理人或托管人按集合计划合同约定的估值方法第 9 项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理；

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

## 十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

---

---

## 第十二部分 集合计划的收益与分配

### 一、集合计划利润的构成

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

### 二、集合计划可供分配利润

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

### 三、集合计划收益分配原则

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

2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；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份额持有期保持一致。

3、集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的某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、同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；

5、由于本集合计划A类和C类计划份额的销售费用收取方式存在不同，各集合计划份额类别对应的可供分配收益将有所不同；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规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，集合计划管理人可对集合计划收益分配原则进行调整，无需召开集合计划份额持有人大会。

### 四、收益分配方案



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

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

#### 六、集合计划收益分配中发生的费用

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

#### 七、实施侧袋机制期间的收益分配

本集合计划实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配。

## 第十三部分 集合计划费用与税收

### 一、集合计划费用的种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、C类份额的销售服务费；
- 4、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 5、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费等；
- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券、期货交易费用；
- 8、集合计划的银行汇划费用；
- 9、集合计划的开户费用、账户维护费用；
- 10、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 11、投资其他基金而产生的费用（包括但不限于申购费、赎回费以及销售服务费用等），但法律法规禁止从基金财产中列支的除外；
- 12、按照国家有关规定和《集合计划合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的集合计划管理费

E为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，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、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。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。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。

## 2、托管人的托管费

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

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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算，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、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。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。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。

## 3、C 类份额的销售服务费

本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额销售服务费年费率为 0.4%。

本集合计划销售服务费按前一日 C 类集合计划资产净值的 0.4%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日的集合计划资产净值

C 类份额的销售服务费每日计算，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、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。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。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。

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、《集合计划合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目。

#### 四、实施侧袋机制期间的集合计划费用

本集合计划实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

#### 五、集合计划税收

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

## 第十四部分 集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

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

### 二、集合计划的年度审计

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

## 第十五部分 集合计划的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

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

四、本集合计划公开披露的信息应采用中文文本。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）招募说明书、《集合计划合同》、托管协议、产品资料概要

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

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

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

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

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

### （二）《集合计划合同》生效公告

管理人应当在规定媒介上登载《集合计划合同》生效公告。

### （三）集合计划净值信息

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

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

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

#### （四）集合计划份额申购、赎回价格

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

#### （五）集合计划定期报告，包括年度报告、中期报告和季度报告

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

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

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

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

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

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

#### （六）临时报告

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



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

- 1、集合计划份额持有人大会的召开及决定的事项;
- 2、《集合计划合同》终止、集合计划清算;
- 3、转换集合计划运作方式、集合计划合并;
- 4、更换管理人、托管人、份额登记机构,集合计划改聘会计师事务所;
- 5、管理人委托相关服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项,托管人委托相关服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项;
- 6、管理人、托管人的法定名称、住所发生变更;
- 7、管理人变更持有百分之五以上股权的股东、管理人的实际控制人变更;
- 8、管理人的分管资产管理业务的高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门基金托管部门负责人发生变动;
- 9、管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十,管理人、托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十;
- 10、涉及集合计划财产、集合资产管理计划管理业务、集合资产管理计划托管业务的诉讼或仲裁;
- 11、管理人或其高级管理人员、集合计划投资经理因集合资产管理计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚,托管人或其专门基金托管部门负责人因托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚;
- 12、管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易事项,但中国证监会另有规定的除外;
- 13、集合计划收益分配事项;
- 14、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更;
- 15、集合计划份额净值估值错误达集合计划份额净值百分之零点五;
- 16、本集合计划开始办理申购、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、本集合计划连续 30、40、45 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 万元的情形；
  - 23、集合计划信息披露义务人认为可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### （七）澄清公告

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

#### （八）集合计划份额持有人大会决议

集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （九）投资资产支持证券的信息披露

管理人应在年报及中期报告中披露集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

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

#### （十）参与港股通交易的信息披露

管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本集合计划参与港股通交易的相关情况。

#### （十一）投资股指期货的信息披露

管理人应按照法规要求在季度报告、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。

#### （十二）投资国债期货的信息披露

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

#### （十三）投资股票期权相关公告

管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股票期权交易情况,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等。

#### （十四）清算报告

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

#### （十五）实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### （十六）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

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

确认。

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

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

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

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

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

## 第十六部分 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

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

管理人应当在启用侧袋机制后及时发布临时公告，并在五个工作日内聘请侧袋机制启用日发表意见且符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

### 二、实施侧袋机制期间集合计划份额的申购与赎回

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

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

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

### 三、实施侧袋机制期间的集合计划投资

侧袋机制实施期间，招募说明书“集合计划的投资”部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。管理人计算各项投资运作指标和集合计划业绩指标时仅需考虑主袋账户资产。

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

管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### 四、实施侧袋机制期间的集合计划估值

本集合计划实施侧袋机制的，管理人和托管人应对主袋账户资产进行估值并

披露主袋账户的集合计划净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。侧袋账户的会计核算应符合《企业会计准则》的相关要求。

#### 五、实施侧袋账户期间的集合计划费用

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

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

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

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

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

侧袋账户资产全部完成变现并终止侧袋机制后，管理人应及时聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行审计并披露专项审计意见。

#### 七、侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

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

##### 2、集合计划净值信息

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

##### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，管理人应当在集合计划定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，集合计划定期报告中的集合计划会计报表仅需针对主袋账户进行编

制。会计师事务所对集合计划年度报告进行审计时，应对报告期内集合计划侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

## 第十七部分 风险揭示

### 一、投资本集合计划的风险

#### 1、市场风险

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

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

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

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

(4) 再投资风险。债券、票据偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率，由此本集合计划面临再投资风险。

(5) 信用风险。债券发行人不能按期还本付息或回购交易中交易对手在回购到期履行交割责任时，不能偿还全部或部分证券或价款，都可能使本集合计划面临信用风险。

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

(7) 购买力风险。集合计划份额持有人收益将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀因素而使其购买力下降，从而使集合计划的实际收益下



降。

(8) 债券回购风险。债券回购为提升整体集合计划组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成集合计划净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对集合计划组合收益进行放大的同时，也对集合计划组合的波动性（标准差）进行了放大，即集合计划组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对集合计划净值造成损失的可能性也就越大。

## 2、管理风险

在集合计划管理运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有以及对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响集合计划收益水平。

管理人和托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响集合计划收益水平。

## 3、流动性风险

集合计划的流动性风险主要表现在两方面：一是管理人建仓时或为实现投资收益而进行组合调整时，可能会由于特定投资标的流动性相对不足而无法按预期的价格将股票或债券买进或卖出；二是为应付投资者的赎回，当个券的流动性较差时，管理人被迫在不适当的价格大量抛售股票或债券。两者均可能使集合计划净值受到不利影响。

### (1) 集合计划申购、赎回安排

本集合计划为开放式，投资人可在本集合计划的开放日办理集合计划份额的申购和赎回业务。为切实保护存量份额持有人的合法权益，遵循份额持有人利益优先的原则，管理人将合理控制集合计划份额持有人集中度，审慎确认申购、赎回业务申请，包括但不限于：

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

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

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

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

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

#### (2) 拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本集合计划的投资市场主要为证券交易所、全国银行间债券市场等流动性较好的规范型交易场所，主要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（含创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。同时，本集合计划基于分散投资的原则在行业 and 个券方面未有高集中度的特征，综合评估在正常市场环境下本集合计划的流动性风险适中。

#### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

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

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

1) 全额赎回：当管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常

赎回程序执行。

2) 部分延期赎回：当管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日集合计划总份额的 10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的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) 在出现巨额赎回时，对于单个集合计划份额持有人当日超过上一开放日集合计划总份额 10%以上的赎回申请，管理人可以对超过的部分全部进行延期办理，具体措施如下：延期的赎回申请将自动与下一个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。如该单个集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于此类持有人未超过上述比例的部分，管理人有权根据前述“1) 全额赎回”或“2) 部分延期赎回”的方式与其他持有人的赎回申请一并办理。但是，如此类持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

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

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

(4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响  
在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及集合计划

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

#### （5）侧袋机制

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向集合计划份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但集合计划启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露集合计划份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有集合计划份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，集合计划份额持有人可能因此面临损失。

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

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

启用侧袋机制后，管理人计算各项投资运作指标和集合计划业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的集合计划净资产减少进行按投资损失处理，因此本集合计划披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

### 4、本集合计划特有风险

（1）本集合计划投资于股票资产的投资比例为集合计划资产的 0%-30%；

因此，管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。

(2) 本集合计划投资资产支持证券，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。

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

(4) 集合计划参与内地与香港股票市场交易互联互通机制（以下简称“港股通机制”）下港股通相关业务，集合计划资产投资于港股，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（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（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（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）等。

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

(5) 本集合计划对每份集合计划份额设置一年的最短持有期限。在最短持

有期限内，集合计划份额不能赎回；在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），持有人方可就集合计划份额提出赎回申请。

#### 5、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT 系统故障等风险。

在开放式集合计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致集合计划份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自集合计划管理公司、登记机构、销售机构、证券/期货交易所、证券/期货登记结算机构等等。

#### 6、合规性风险

合规性风险指集合计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者集合计划投资违反法规及集合计划合同有关规定的风险。

#### 7、其他风险

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

## 二、声明

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

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

---

---

## 第十八部分 集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算

### 一、《集合计划合同》的变更

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

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

### 二、《集合计划合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《集合计划合同》应当终止：

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

### 三、集合计划财产的清算

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

2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

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

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、集合计划财产清算的公告

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

#### 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。



## 第十九部分 集合计划合同的内容摘要

### 一、集合计划份额持有人、管理人及托管人的权利义务

#### （一）管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

（1）依法募集资金；

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

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

（4）销售集合计划份额；

（5）按照规定召集集合计划份额持有人大会；

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

（7）在托管人更换时，提名新的托管人；

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

（9）担任或委托其他符合条件的机构担任登记机构办理集合计划登记业务并获得《集合计划合同》规定的费用；

（10）依据《集合计划合同》及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；

（11）在《集合计划合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

（13）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《集合计划合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

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

(2) 办理集合计划备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受托管人的监督；

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

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

(12) 保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《集合计划合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公

开披露前应予保密，不向他人泄露；

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他义务。

## （二） 托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

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

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

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

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

（5）提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

（6）在管理人更换时，提名新的管理人；

（7）法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

（1）以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

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

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

(5) 保管由管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 从管理人或其委托的登记机构处接收集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《集合计划合同》的规定监督管理人的投资运作；

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

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

(19) 因违反《集合计划合同》导致集合计划财产损失时，应承担赔偿责

任，其赔偿责任不因其退任而免除；

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

(21) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他义务。

(三) 集合计划份额持有人

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

同一类别每份集合计划份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享集合计划财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余集合计划财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的集合计划份额；

(4) 按照规定要求召开集合计划份额持有人大会或者召集集合计划份额持有人大会；

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

(6) 查阅或者复制公开披露的集合计划信息资料；

(7) 监督管理人的投资运作；

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

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他权利。

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

- (1) 认真阅读并遵守《集合计划合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 了解所投资集合计划产品，了解自身风险承受能力，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；
- (3) 关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；
- (4) 交纳集合计划申购款项及法律法规和《集合计划合同》所规定的费用；
- (5) 在其持有的集合计划份额范围内，承担集合计划亏损或者《集合计划合同》终止的有限责任；
- (6) 不从事任何有损集合计划及其他《集合计划合同》当事人合法权益的活动；
- (7) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；
- (8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他义务。

## 二、集合计划份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

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

### (一) 召开事由

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

- (1) 终止《集合计划合同》；
- (2) 更换管理人；
- (3) 更换托管人；
- (4) 转换集合计划运作方式；
- (5) 调整管理人、托管人的报酬标准或提高销售服务费；

- (6) 变更集合计划类别;
- (7) 本集合计划与其他集合资产管理计划的合并;
- (8) 变更集合计划投资目标、范围或策略;
- (9) 变更集合计划份额持有人大会程序;
- (10) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会;
- (11) 单独或合计持有本集合计划总份额 10%以上(含 10%)集合计划份额的集合计划份额持有人(以管理人或托管人收到提议当日的集合计划份额计算,下同)就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会;
- (12) 对本合同当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;
- (13) 法律法规、《集合计划合同》或中国证监会规定的其他应当召开集合计划份额持有人大会的事项。

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

- (1) 法律法规要求增加的集合计划费用的收取;
- (2) 调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率、销售服务费或变更收费方式;
- (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《集合计划合同》进行修改;
- (4) 对《集合计划合同》的修改对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《集合计划合同》当事人权利义务关系发生变化;
- (5) 集合计划管理人更换为本集合计划管理人独资设立的子公司;
- (6) 按照法律法规和《集合计划合同》规定不需召开集合计划份额持有人大会的其他情形。

3、集合计划合同生效后,连续 50 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,本集合计划将根据集合计划合同的约定清算并终止,且无需召开集合计划份额持有人大会。

## (二) 会议召集人及召集方式

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



2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集。

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

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

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

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

（三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

（1）会议召开的时间、地点和会议形式；

（2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；

（3）有权出席集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人的权益登记日；

(4) 授权委托书证明的内容要求（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书委派代表出席，现场开会时管理人和托管人的授权代表应当列席集合计划份额持有人大会，管理人或托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行集合计划份额持有人大会议程：

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

3、在不与法律法规冲突的前提下，集合计划份额持有人大会亦可采用网

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

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

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

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

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

集合计划份额持有人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## （七）计票

### 1、现场开会

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

会由集合计划份额持有人自行召集或大会虽然由管理人或托管人召集，但是管理人或托管人未出席大会的，集合计划份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的集合计划份额持有人中选举三名集合计划份额持有人代表担任监票人。管理人或托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

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

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

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

## 2、通讯开会

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

## (八) 生效与公告

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

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

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

致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开集合计划份额持有人大会审议。

(十) 实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。

### 三、集合计划合同的终止事由、程序与集合计划资产的清算

#### (一) 《集合计划合同》的变更

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

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

#### (二) 《集合计划合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《集合计划合同》应当终止：

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

#### (三) 集合计划资产的清算

1、集合计划资产清算小组：自出现《集合计划合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组，管理人组织集合计划资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、集合计划资产清算小组组成：集合计划资产清算小组成员由管理人、托管人、具有证券、期货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。集合计划资产清算小组可以聘用必要的工作人员。

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

#### 4、集合计划资产清算程序：

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

(2) 对集合计划资产和债权债务进行清理和确认；



(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

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

(6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 集合计划财产清算的公告

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

#### (七) 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。

### 四、争议解决方式

各方当事人同意，因《集合计划合同》而产生的或与《集合计划合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会

并按其届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

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

《集合计划合同》受中国法律（为本合同之目的，不含港澳台立法）管辖并从其解释。

## **五、集合计划合同的存放地及投资者取得方式**

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

## 第二十部分 集合计划托管协议的内容摘要

### 一、托管协议当事人

#### (一) 管理人（或简称“管理人”）

名称：中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸3期B座42层

邮政编码：100020

法定代表人：沈如军

成立日期：1995年7月31日

投资管理业务批准文号：证监机构字[2007]196号

组织形式：股份有限公司

注册资本：482,725.6868万人民币

存续期间：持续经营

经营范围：一、人民币特种股票、人民币普通股票、境外发行股票，境内外政府债券、公司债券和企业债券的经纪业务；二、人民币普通股票、人民币特种股票、境外发行股票，境内外政府债券、公司债券和企业债券的自营业务；三、人民币普通股票、人民币特种股票、境外发行股票，境内外政府债券、公司债券和企业债券的承销业务；四、基金的发起和管理；五、企业重组、收购与合并顾问；六、项目融资顾问；七、投资顾问及其他顾问业务；八、外汇买卖；九、境外企业、境内外商投资企业的外汇资产管理；十、同业拆借；十一、客户资产管理；十二、网上证券委托业务；十三、融资融券业务；十四、代销金融产品；十五、证券投资基金代销；十六、为期货公司提供中间介绍业务；十七、证券投资基金托管业务；十八、经金融监管机构批准的其他业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）

#### (二) 托管人（或简称“托管人”）

名称：中国银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：刘连舸

成立时间：1983年10月31日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

经营范围：吸收人民币存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；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；从事同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇兑换；国际结算；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；结汇、售汇；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营外汇买卖；代客外汇买卖；外汇信用卡的发行和代理国外信用卡的发行及付款；资信调查、咨询、见证业务；组织或参加银团贷款；国际贵金属买卖；海外分支机构经营与当地法律许可的一切银行业务；在港澳地区的分行依据当地法令可发行或参与代理发行当地货币；经中国人民银行批准的其他业务。

存续期间：持续经营

## 二、托管人与管理人之间的业务监督、核查

### 托管人对管理人的业务监督和核查

（一）托管人根据有关法律法规的规定对管理人的下列投资运作进行监督：

1、对集合计划的投资范围、投资对象进行监督。管理人应将拟投资的股票库、债券库等各投资品种的具体范围及时提供给托管人。管理人可以根据实际情况的变化，对各投资品种的具体范围予以更新和调整，并及时通知托管人。

本集合计划投资于国内依法发行上市的股票（含创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票（以下简称“港股通标的股票”）、国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、中期票据、短期融资券、超短期

融资券、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本集合计划可以根据法律法规的规定参与融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许本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。

托管人根据上述投资范围对集合计划的投资进行监督。

## 2、对集合计划投融资比例进行监督：

(1) 可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券及股票资产的比例为集合计划资产的 0-30%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；

(2) 每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和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的 5% 的现金或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、应收申购款等；

(3) 本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值（同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算）不超过集合计划资产净值的 10%；

(4) 本集合计划管理人管理的且在本托管人处托管的全部集合资产管理计划持有一家公司发行的证券（同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算），不超过该证券的 10%；

(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 15%；

(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) 本集合计划管理人管理的且在本托管人处托管的全部集合资产管理计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(9) 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；

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

(11) 本集合计划参与股指期货、国债期货交易，应当符合下列投资限制：

1) 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%；

2) 在任何交易日日终，持有的买入股指期货和国债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；

3) 在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%；

4) 本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合《集合计划合同》关于股票投资比例的有关规定，即股票资产的比例为集合计划资产的 0-30%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；

5) 本集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 20%；

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

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

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

(12) 本集合计划的集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的 140%；

(13) 本集合计划管理人管理的且在本托管人处托管的全部集合资产管理计划持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本集合计划管理人管理的且在本托管人处托管的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

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

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

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

(17)本集合计划投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算；

(18)法律法规及中国证监会规定的其他投资比例限制。

因证券、期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等集合计划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，为被动超标，不属于集合计划管理人违反集合计划合同的情形。集合计划管理人应当在所涉证券可交易之日起 10 个交易日内进行调整，上述第（2）、（15）、（16）项对调整时间另有约定的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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

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

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

(二) 托管人应根据有关法律法规的规定及《集合计划合同》的约定,对集合计划资产净值计算、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定、集合计划收益分配、相关信息披露登载集合计划业绩表现数据等进行复核。

(三) 托管人在上述第(一)、(二)款的监督和核查中发现管理人违反上述约定,应及时提示管理人,管理人收到提示后应及时核对确认并以书面形式对托管人发出回函并改正。在限期内,托管人有权随时对提示事项进行复查。管理人对托管人提示的违规事项未能在限期内纠正的,托管人应及时向中国证监会报告。

(四) 托管人发现管理人的投资指令违反法律法规、本协议的规定,应当拒绝执行,及时提示管理人,并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。托管人发现管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律法规、本协议规定的,应当及时提示管理人,并依照法律法规的规定及时向中国证监会报告。

(五) 管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查,包括但不限于:在规定时间内答复托管人并改正,就托管人的疑义进行解释或举证,提供相关数据资料和制度等。

#### **管理人对托管人的业务核查**

(一) 在本协议的有效期内,在不违反公平、合理原则以及不妨碍托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,管理人有权对托管人履行本协议的情况进行必要的核查,核查事项包括但不限于托管人安全保管集合计划财产、开设集合计划财产的资金账户和证券账户、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、根据管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督集合计划投资运作等行为。

(二) 管理人发现托管人擅自挪用集合计划财产、未对集合计划财产实行分账管理、无正当理由未执行或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法律法规、《集合计划合同》及本协议有关规定时,应及时以书面形式通知托管人限期纠正,托管人收到通知后应及时核对并以书面形式对管理人发出回函。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,管理人应依照



法律法规的规定报告中国证监会。

(三) 托管人应积极配合管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复管理人并改正。

### 三、集合计划财产的保管

#### (一) 集合计划财产保管的原则

- 1、集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。
- 2、托管人应安全保管集合计划财产，未经管理人的合法合规指令或法律法规、《集合计划合同》及本协议另有规定，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何财产。
- 3、托管人按照规定开设集合计划财产的资金账户和证券账户。
- 4、托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，确保集合计划财产的完整与独立。
- 5、除依据《基金法》、《运作办法》、《集合计划合同》及其他有关法律法规规定外，托管人不得委托第三人托管集合计划财产。

#### (二) 集合计划的银行账户的开设和管理

- 1、托管人应负责本集合计划的银行账户的开设和管理。
- 2、托管人以本集合计划的名义开设本集合计划的银行账户。本集合计划的银行预留印鉴由托管人保管和使用。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付集合计划收益、收取申购款，均需通过本集合计划的银行账户进行。
- 3、本集合计划银行账户的开立和使用，限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本集合计划的银行账户进行本集合计划业务以外的活动。
- 4、集合计划银行账户的管理应符合法律法规的有关规定。

#### (三) 集合计划进行定期存款投资的账户开设和管理

管理人以集合计划名义在托管人认可的存款银行的指定营业网点开立存款账户，托管人负责该账户银行预留印鉴的保管和使用。在上述账户开立和账户相关信息变更过程中，管理人应提前向托管人提供开户或账户变更所需的相关资料。

（四）集合计划证券账户、结算备付金账户及其他投资账户的开设和管理

1、托管人应当代表本集合计划，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设证券账户。

2、本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或转让本集合计划的证券账户，亦不得使用本集合计划的证券账户进行本集合计划业务以外的活动。

3、托管人以自身法人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，用于办理托管人所托管的包括本集合计划在内的全部集合计划在证券交易所进行证券投资所涉及的资金结算业务。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、在本托管协议生效日之后，本集合计划被允许从事其他投资品种的投资业务的，涉及相关账户的开设、使用的，若无相关规定，则托管人应当比照并遵守上述关于账户开设、使用的规定。

（五）债券托管专户的开设和管理

集合计划合同生效后，管理人负责以集合计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表集合计划进行交易；由管理人负责向中国人民银行报备，在上述手续办理完毕之后，托管人负责以集合计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司开设银行间债券市场债券托管账户，并代表集合计划进行银行间债券市场债券和资金的清算。

（六）集合计划财产投资的有关有价凭证的保管

集合计划财产投资的实物证券、银行定期存款存单等有价凭证由托管人负责妥善保管。托管人对其以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

（七）与集合计划财产有关的重大合同及有关凭证的保管

托管人按照法律法规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及有关凭证。管理人代表集合计划签署有关重大合同后应在收到合同正本后30日内将一份正本的原件提交给托管人。除本协议另有规定外，管理人

在代表集合计划签署与集合计划有关的重大合同时，应保证集合计划一方持有两份以上的正本，以便管理人和托管人至少各持有一份正本的原件。对于无法取得两份以上的正本的，管理人应向托管人提供加盖公章的合同复印件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。重大合同由管理人与托管人按规定各自保管不低于法律法规规定的最低期限。

#### 四、集合计划资产净值计算与复核

##### （一）集合计划资产净值的计算和复核

1、集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。集合计划份额净值是指计算日集合计划资产净值除以计算日该集合计划份额总数后的价值。

2、管理人应每个开放日对集合计划财产估值。估值原则应符合《集合计划合同》、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定。用于集合计划信息披露的集合计划资产净值和集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人复核。管理人应于每个开放日结束后计算得出当日的集合计划份额净值，并以双方约定的方式发送给托管人。托管人应对净值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给管理人，由管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与集合计划会计账目的核对同时进行。

3、当相关法律法规或《集合计划合同》规定的估值方法不能客观反映集合计划财产公允价值时，管理人可根据具体情况，并与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、管理人、托管人发现集合计划估值违反《集合计划合同》订明的估值方法、程序以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，双方应及时进行协商和纠正。

5、当集合计划资产的估值导致集合计划份额净值小数点后四位内发生差错时，视为集合计划份额净值估值错误。当集合计划份额净值出现错误时，管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；当计价错误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；当计价错误达到集合计划份额净值的0.5%时，管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。如法律法规或监管机关对前述内容另有规定的，按其规定处

理。如果行业另有通行做法，管理人和托管人应本着平等和保护集合计划份额持有人利益的原则进行协商。

6、由于管理人对外公布的任何集合计划净值数据错误，导致该集合计划财产或集合计划份额持有人的实际损失，管理人应对此承担责任。若托管人计算的净值数据正确，则托管人对该损失不承担责任；若管理人对外公布的净值经托管人复核同意的，则托管人也应承担相应未正确履行复核义务的责任，托管人不承担管理人未接受托管人的正确复核意见进行信息披露产生的责任。如果上述错误造成了集合计划财产或集合计划份额持有人的不当得利，且管理人及托管人已各自承担了赔偿责任，则管理人应负责向不当得利之主体主张返还不当得利。如果返还金额不足以弥补管理人和托管人已承担的赔偿金额，则双方按照各自赔偿金额的比例对返还金额进行分配。

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

8、如果托管人的复核结果与管理人的计算结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，管理人可以按照其对集合计划份额净值的计算结果对外予以公布，托管人可以将相关情况报中国证监会备案。

## （二）集合计划会计核算

### 1、集合计划账册的建立

管理人和托管人在《集合计划合同》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、登记和保管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。

### 2、会计数据和财务指标的核对

管理人和托管人应定期就会计数据和财务指标进行核对。如发现存在不符，双方应及时查明原因并纠正。

### 3、集合计划财务报表和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；招募说明书在《集合计划合同》生效后每六个月更新并公告一次，于该等期间届满后 45 日内公告。季度报告应在每个季度结束之日起 10 个工作日内编制完毕并于每个季度结束之日起 15 个工作日内予以公告；半年度报告在会计年度半年终了后 40 日内编制完毕并于会计年度半年终了后 60 日内予以公告；年度报告在会计年度结束后 60 日内编制完毕并于会计年度终了后 90 日内予以公告。集合计划合同生效不足两个月的，管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

管理人应及时完成报表编制，将有关报表提供给托管人复核，托管人在收到后应及时进行复核，并将复核结果书面通知管理人；管理人应留足充分的时间，便于托管人复核相关报表及报告。

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；若双方无法达成一致以管理人的账务处理为准。核对无误后，托管人在管理人提供的报告上加盖托管业务部门公章或者出具加盖托管业务部门公章的复核意见书，双方各自留存一份。如果管理人与托管人不能于应当发布公告之日之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证监会备案。

## 五、集合计划份额持有人名册的登记与保管

集合计划份额持有人名册至少应包括集合计划份额持有人的名称和持有的集合计划份额。集合计划份额持有人名册由集合计划登记机构根据管理人的指令编制和保管，管理人和托管人应分别保管集合计划份额持有人名册，集合计划登记机构对其保存期自集合计划账户销户之日起不少于 20 年，法律法规另有规定或有权机关另有要求的除外。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在托管人要求或编制中期报告和年报前，管理人应将有关资料送交托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。托管人不得将所保管的集合计划份额持有人名册用于集合计划托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 六、争议解决方式

（一）本协议适用中华人民共和国法律（为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）并从其解释。

（二）管理人与托管人之间因本协议产生的或与本协议有关的争议可通过友好协商解决，如经友好协商未能解决的，则任何一方有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，并按其时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对仲裁各方当事人均具有约束力。仲裁费用和律师费用由败诉方承担。

（三）除争议所涉的内容之外，本协议的当事人仍应履行本协议的其他规定。

## **七、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，可以对协议进行变更。变更后的新协议，其内容不得与《集合计划合同》的规定有任何冲突。变更后的新协议应当报中国证监会备案。

### **（二）托管协议的终止**

发生以下情况，本托管协议应当终止：

- 1、《集合计划合同》终止；
- 2、本集合计划更换托管人；
- 3、本集合计划更换管理人；
- 4、发生《基金法》、《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**

管理人和托管人应按照《集合计划合同》及有关法律法规的规定对本集合计划的财产进行清算。

## 第二十一部分 对集合计划份额持有人的服务

管理人承诺为集合计划份额持有人提供一系列的服务。管理人将根据份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送及查询

#### 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。集合计划份额持有人可以通过管理人网站获取集合计划和管理人的各类信息，包括法律文件、定期报告、临时公告和管理人最新动态等相关资料。

### （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）客户服务

投资人或份额持有人如果了解集合计划情况、产品和服务等信息，可拨打管理人咨询电话或查询管理人网站。

咨询电话：800-810-8802（固话用户免费） | （010）6505-0105（直线）

网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

## 第二十二部分 招募说明书的存放及查阅方式

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



## 第二十三部分 备查文件

- (一) 中国证监会准予中金转型升级集合资产管理计划变更的文件
- (二) 中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划资产管理合同
- (三) 中金丰裕稳健一年持有混合型集合资产管理计划托管协议
- (四) 法律意见书
- (五) 管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 托管人业务资格批件、营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件

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

中国国际金融股份有限公司

二〇二二年 七月