

第一创业创和一个月滚动持有  
债券型集合资产管理计划  
招募说明书（更新）

管理人：第一创业证券股份有限公司

托管人：兴业银行股份有限公司

二〇二三年十二月

**【重要提示】**

创金稳定收益 1 期集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”），自 2012 年 12 月 3 日起向社会公众发行，2012 年 12 月 20 日结束募集并于 2012 年 12 月 24 日成立，于 2013 年 1 月 23 日取得《关于核准第一创业证券有限责任公司发起设立创金稳定收益 1 期集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]65 号）获设立批复。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，原集合计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，变更后的《第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》自中国证监会批准后管理人公告生效之日起生效，原《创金稳定收益 1 期集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

第一创业证券股份有限公司保证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备案，但中国证监会对本集合计划募集的备案，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。

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。投资有风险，投资人在申购本集合计划前应当认真阅读集合计划招募说明书、资产管理合同、产品资料概要等信息披露文件，自主判断集合计划的投资价值，自主作出投资决策，自行承担投资风险。投资者在获得集合计划投资收益的同时，亦承担集合计划投资中出现的各类风险，可能包括：本集合计划的特定风险、债券市场风险、集合计划共有的风险、法律文件风险收益特征表述与销售机构计划风险评价可能不一致的风险、流动性风险等。本集合计划的一般风险及特有风险详见本招募说明书的“风险揭示”部分。管理人提醒投资者集合计划投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，计划运营状况与集合计划净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

本集合计划投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，请集合计划份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的集合计划净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

本集合计划投资于国债期货。国债期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。国债期货存在市场风险、信用风险和杠杆风险。详见本招募说明书的“风险揭示”

部分。

本集合计划对于每份集合计划份额，设定一个月的滚动运作期。每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能提出赎回申请。故投资者面临在运作期到期日前无法赎回的风险，以及错过当期运作期到期日未能赎回而进入下一运作期的风险。

对于每份计划份额，第一个运作期到期日指资产管理合同生效日（对资产管理合同生效前相应计划份额而言，下同）或计划份额申购申请日（对申购份额而言，下同）满1个月对应的月度对日，第二个运作期到期日为资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满2个月对应的月度对日，第三个运作期到期日为资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满3个月对应的月度对日，以此类推。每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一工作日起该集合计划份额进入下一个运作期。

本集合计划为债券型集合资产管理计划，长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型集合计划、混合型集合计划，高于货币型集合计划。

本集合计划的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现；管理人管理的其他集合计划的业绩也不构成对本集合计划业绩表现的保证。投资人在申购本集合计划时应认真阅读本集合计划的招募说明书和资产管理合同。

本次更新招募说明书所载内容截止日为2023年11月30日，有关财务数据截止日为2023年9月30日，净值表现截止日为2023年9月30日，所披露的投资组合为2023年第3季度的数据，财务和业绩表现数据未经审计。

## 目录

第一部分 集合计划的历史沿革.....	4
第二部分 绪言 .....	5
第三部分 释义 .....	6
第四部分 管理人.....	11
第五部分 托管人.....	23
第六部分 相关服务机构.....	26
第七部分 集合计划的存续.....	31
第八部分 集合计划份额的申购和赎回.....	32
第九部分 集合计划的投资.....	42
第十部分 集合计划的业绩.....	52
第十一部分 集合计划的财产 .....	53
第十二部分 集合计划资产估值 .....	54
第十三部分 集合计划的收益与分配 .....	60
第十四部分 集合计划的费用与税收 .....	62
第十五部分 集合计划的会计与审计 .....	65
第十六部分 集合计划的信息披露 .....	66
第十七部分 侧袋机制 .....	72
第十八部分 风险揭示 .....	75
第十九部分 集合资产管理合同的变更、终止和集合计划财产的清算.....	81
第二十部分 集合资产管理合同的内容摘要 .....	83
第二十一部分 集合计划托管协议的内容摘要 .....	99
第二十二部分 集合计划份额持有人服务 .....	118
第二十三部分 其他应披露事项 .....	120
第二十四部分 招募说明书的存放及其查阅方式 .....	122
第二十五部分 备查文件 .....	123

## 第一部分

## 集合计划的历史沿革

第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更自原大集合“创金稳定收益 1 期集合资产管理计划”。

原集合计划为限定性集合资产管理计划，自 2012 年 12 月 3 日起向社会公众发行，2012 年 12 月 20 日结束募集并于 2012 年 12 月 24 日成立，于 2013 年 1 月 23 日取得《关于核准第一创业证券有限责任公司发起设立创金稳定收益 1 期集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]65 号）获设立备案。

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，原集合计划已完成规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准后，《第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》自管理人公告生效之日起生效，原《创金稳定收益 1 期集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

## 第二部分

## 绪言

《第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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》”）、《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》和其他法律法规以及《第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称资产管理合同或“《资产管理合同》”）编写。

管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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募集的。本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。

本招募说明书根据集合计划的资产管理合同编写，并经中国证监会备案。资产管理合同是约定计划当事人之间权利、义务的法律文件。集合计划投资人自取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和资产管理合同的当事人，其持有集合计划份额的行为本身即表明其对资产管理合同的承认和接受，并按照《基金法》、资产管理合同及其他有关规定享有权利、承担义务。集合计划投资人欲了解集合计划份额持有人的权利和义务，应详细查阅资产管理合同。

本集合计划按照中国法律法规成立并运作，若资产管理合同、招募说明书的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。

## 第三部分

## 释义

《招募说明书》中除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

- 1、集合计划或本集合计划：指第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划
- 2、管理人：指第一创业证券股份有限公司（简称“第一创业”）
- 3、托管人：指兴业银行股份有限公司
- 4、资产管理合同或《资产管理合同》：指《第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》及对资产管理合同的任何有效修订和补充
- 5、托管协议：指管理人与托管人就本集合计划签订之《第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
- 6、招募说明书或本招募说明书：指《第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新
- 7、产品资料概要：指《第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新
- 8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对资产管理合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
- 9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 10、《销售办法》：指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 11、《信息披露办法》：指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施，并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 12、《运作办法》：指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
- 13、《流动性风险管理规定》：指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

19、合格境外投资者：指符合《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使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

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

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

22、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，销售集合计划份额，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

23、销售机构：指第一创业证券股份有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与管理人签订了集合计划销售服务协议，办理集合计划销售业务的机构

24、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

25、登记机构：指办理登记业务的机构。集合计划的登记机构为第一创业证券股份有限公司

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

27、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（可根据实际情况增减业务类型）

28、资产管理合同生效日：指根据《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》变更后的《第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管



理计划资产管理合同》生效之日，原《创金稳定收益 1 期集合资产管理计划资产管理合同》同日失效

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

30、存续期：指《创金稳定收益 1 期集合资产管理计划资产管理合同》生效至资产管理合同终止之间的期限

31、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

32、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

33、T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)

34、运作期起始日：对于资产管理合同生效前相应计划份额而言，第一个运作期起始日指资产管理合同生效日；对于每份申购份额而言，第一个运作期起始日指该计划份额申购确认日

35、运作期到期日：对于每份计划份额，第一个运作期到期日指资产管理合同生效日（对资产管理合同生效前相应计划份额而言，下同）或计划份额申购申请日（对申购份额而言，下同）满 1 个月对应的月度对日，第二个运作期到期日为资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满 2 个月对应的月度对日，第三个运作期到期日为资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满 3 个月对应的月度对日，以此类推

36、月度对日：指资产管理合同生效日（对资产管理合同生效前相应计划份额而言，下同）或计划份额申购申请日（对申购份额而言，下同）在后续日历月中的对应日期，如没有对应日期或该日为非工作日的，则顺延至下一工作日

37、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

38、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

39、《业务规则》：指本集合计划登记机构办理登记业务的相应规则，由集合资产管理计划管理人和投资人共同遵守

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

41、赎回：指资产管理合同生效后，集合计划份额持有人按资产管理合同和招募说明书规定的条件要求将集合计划份额兑换为现金的行为

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

43、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

44、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

45、巨额赎回：指本集合计划单个开放日，集合计划净赎回申请（赎回申请份额总数加上集合计划转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及集合计划转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一工作日集合计划总份额的 10%

46、元：指人民币元

47、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

48、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

49、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

50、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

51、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

52、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

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

54、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

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

56、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

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

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

59、大集合计划：指《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》规范的大集合产品

## 第四部分 管理人

### 一、管理人概况

#### （一）管理人简况

名称：第一创业证券股份有限公司（以下简称“本公司”）

住所：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：吴礼顺

设立日期：1992 年 11 月

批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行银复[1992]608 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：42.024 亿元

存续期限：持续经营

联系电话：95358

#### 历史沿革

本公司由第一创业证券有限责任公司整体变更设立，第一创业证券有限责任公司的前身为佛山证券公司。

1992 年 11 月，中国人民银行出具《关于成立佛山证券公司的批复》（银复[1992]608 号），同意成立佛山证券公司。

1993 年 4 月，佛山证券公司领取了核发的《企业法人营业执照》，注册资金为 1,000.00 万元。

1997 年 12 月，经中国人民银行批准，佛山证券公司与中国人民银行脱钩改制并增资扩股，同时更名为“佛山证券有限责任公司”。1998 年 1 月，佛山证券有限责任公司领取了核发的《企业法人营业执照》，注册资本增至 8,000.00 万元。

2002 年 4 月，中国证监会核准佛山证券有限责任公司增资扩股，佛山证券有限责任公司注册资本由 80,000,000.00 元增至 747,271,098.44 元，同时更名为“第一创业证券有限责任公司”。2002 年 7 月，第一创业证券有限责任公司领取了核发的《企业法人营业执照》。

2008 年 8 月，中国证监会核准第一创业证券有限责任公司增资扩股，第一创业证券有限责任公司注册资本由 747,271,098.44 元增加至 1,590,000,000.00 元。2008 年 9 月，第一创业证券有

限责任公司领取了核发的《企业法人营业执照》。

2011年8月，中国证监会核准第一创业证券有限责任公司增资扩股，第一创业证券有限责任公司注册资本由15.90亿元增至19.70亿元。2011年8月，第一创业证券有限责任公司领取了核发的《企业法人营业执照》。

2012年2月，中国证监会核准第一创业证券有限责任公司变更为股份有限公司，第一创业证券有限责任公司以2011年9月30日经审计后的公司净资产为基数折股整体变更为本公司，注册资本为19.70亿元。2012年3月，本公司领取了核发的《企业法人营业执照》。

经中国证监会“证监许可〔2016〕814号文”核准，2016年5月，公司首次公开发行股票21,900万股并在深圳证券交易所上市，股票代码：002797。首次公开发行完成后，公司注册资本由197,000.00万元增至218,900.00万元。2016年8月，公司领取了深圳市市场监督管理局核发的《企业法人营业执照》。

2017年5月26日，公司完成2016年度权益分派方案的实施，以21.89亿股本为基数，以资本公积金向全体股东每10股转增6股。转增完成后，公司股本由21.89亿股增加至35.024亿股。2017年7月，公司取得了深圳市市场监督管理局核发的《变更（备案）通知书》，公司注册资本变更为35.024亿元。

经中国证监会“证监许可〔2020〕724号文”核准，2020年7月，公司非公开发行股票7亿股并在深交所上市，公司注册资本由35.024亿元变更为42.024亿元。2020年9月，公司取得了由深圳市市场监督管理局核发的《变更（备案）通知书》。

## 二、主要人员情况（截至2023年9月30日）

### 1、董事会成员

吴礼顺先生：中国国籍，无境外永久居留权，1975年4月出生，研究生学历。吴礼顺先生1997年7月至2001年9月在毕马威华振会计师事务所任职，2001年9月至2008年6月在北京大岳咨询有限责任公司任职，2008年6月至2013年2月任北京市基础设施投资有限公司计划财务部副经理、融资计划部经理，2013年2月至2017年3月任北京首都创业集团有限公司副总经理，2017年3月至2021年2月任北京首都创业集团有限公司党委常委、副总经理，2017年4月至2018年4月任中国人民银行调查统计司副司长（挂职），2019年3月至2020年7月任河北省住房和城乡建设厅副厅长（挂职），2021年2月至2022年4月任北京市人民政府国有资产监督管理委员会党委委员、副主任，2022年4月至今任北京国有资本运营管理有限公司党委副书记、董事、总经理，现任公司董事长、北京国有资本运营管理有限公司党委副书记、董事、总经理，兼任京东方科技集团股份有限公司董事。

王芳女士：中国国籍，无境外永久居留权，1977年9月出生，研究生学历。王芳女士2000年6月至2004年9月任大鹏证券有限责任公司法律支持部经理，2004年10月起历任公司首席律师、法律合规部总经理、合规总监、副总裁、常务副总裁、总裁。2016年8月至2019年8月任银华基金管理股份有限公司监事会主席，现任公司董事、总裁，兼任第一创业证券承销保荐有限责任公司执行董事、深圳第一创业创新资本管理有限公司董事、银华基金管理股份有限公司董事、深圳市第一创业公益基金会副理事长。

青美平措先生：中国国籍，无境外永久居留权，1987年6月出生，研究生学历。青美平措先生2014年7月至2018年10月任西藏银行股份有限公司公司业务部副总经理、拉萨经济技术开发区支行行长等职务，2018年10月至今任北京国有资本运营管理有限公司综合管理部副总经理、投资管理二部副总经理、重大项目投资部副总经理、重大项目投资部总经理、基金管理部总经理。现任公司董事、北京国有资本运营管理有限公司基金管理部总经理，兼任大和证券（中国）有限责任公司副董事长、北京京管泰富基金管理有限责任公司董事、北京首寰文化旅游投资有限公司董事、北京二商食品股份有限公司董事、北京顺禧私募基金管理有限公司董事。

梁望南先生：中国国籍，无境外永久居留权，1974年12月出生，本科学历，工程师。梁望南先生1996年8月至2003年3月任北京粮食集团有限责任公司干部，2003年3月至2003年11月任北京市委商贸工委干部，2003年11月至2009年5月任北京市人民政府国有资产监督管理委员会干部，2009年5月至2022年10月历任北京国有资本运营管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、人力资源部总经理、基金投资部副总经理、基金投资部总经理、基金管理部总经理，现任公司董事、北京京国瑞国企改革发展基金（有限合伙）投资决策委员会委员兼战略指导委员会委员、北京京国瑞股权投资基金管理有限公司董事兼总经理、北京京国瑞投资管理有限公司董事、北京京国发股权投资基金（有限合伙）投资决策委员会委员、北京京国益投资管理有限公司执行董事兼总经理、北京京国益基金（有限合伙）投资决策委员会委员、北京外企人力资源服务有限公司监事、北京燕东微电子股份有限公司董事、北京股权投资发展管理中心（有限合伙）顾问委员会委员、瑞合致新（北京）企业管理中心（有限合伙）执行事务合伙人委派代表、北京国瑞中鑫股权投资基金（有限合伙）执行事务合伙人委派代表、北京京国管股权投资基金（有限合伙）投资决策委员会委员。

臧莹女士：中国国籍，无境外永久居留权，1979年9月出生，博士研究生学历。臧莹女士2004年7月至2016年1月先后在北京市通州区地方税务局、北京市地方税务局、北京市昌平区金融服务办等单位工作，2016年1月至2018年4月任北京二商集团有限责任公司金融证券部部长，2018年4月至2020年8月任北京首农食品集团有限公司金融投资部部长，现任公司董事、

北京首农食品集团有限公司金融事业部总经理、中化资本投资管理有限责任公司监事、中化资本有限公司监事、北京二商金砖股权投资基金管理有限公司董事、北京首农北信私募基金管理有限公司董事长、北京菜篮子集团有限公司董事、北京糖业烟酒集团有限公司董事。

高天相先生：中国国籍，无境外永久居留权，1958年7月出生，大专学历，高级经济师。高天相先生1975年1月至1981年2月任瓜沥镇航民大队生产队会计、大队会计，1981年2月至1982年8月任萧山县长沙乡农村财务辅导员，1982年9月至1984年4月任萧山县农业局农业统计，1984年5月至1992年9月任萧山市政府办公室法制科长，1992年10月至1998年1月任杭州钱江投资区江南开发总公司总经理助理兼计划财务部经理，1998年1月至2005年6月任浙江航民实业集团有限公司办公室主任、财务总监、总经理助理、董事、副总经理，1999年至2005年6月任浙江航民股份有限公司董事、董事会秘书、副总经理，2008年10月至今任公司董事。现任公司董事、浙江航民实业集团有限公司董事兼副总经理、浙江航民股份有限公司董事、深圳富春成长投资有限公司董事、五村联合控股有限公司董事。

罗飞先生：中国国籍，无境外永久居留权，1952年5月出生，经济学（会计学）博士，加拿大多伦多大学访问学者，博士研究生导师，国务院政府特殊津贴专家、湖北省有突出贡献的中青年专家，财政部首批跨世纪学科（学术）带头人。罗飞先生自1984年起在中南财经大学（现为中南财经政法大学）任职，1994年评为教授，1997年评为博士生导师。1993年至1997年任中南财经大学会计系副主任，1998年至1999年任中南财经大学研究生部主任，1999年至2008年任中南财经政法大学（原中南财经大学）会计学院院长，2008年至2022年任中南财经政法大学经济与会计监管研究中心主任。罗飞先生曾担任武汉钢铁股份有限公司、九州通医药集团股份有限公司、武汉长江通信产业集团股份有限公司、华宝兴业基金管理有限公司、湖北武大有机硅新材料股份有限公司、深圳市麦捷微电子科技股份有限公司、烟台张裕葡萄酿酒股份有限公司等公司独立董事职务。现任公司独立董事、中南财经政法大学教授、武汉科前生物股份有限公司独立董事、武汉里得电力科技股份有限公司独立董事。

彭沛然先生：中国国籍，香港特别行政区永久居民，1961年9月出生，先后取得英国牛津大学本科学历及意大利国际研究学院硕士学位，取得英国特许会计师资格。彭沛然先生自1985年12月至1995年12月在毕马威会计事务所（伦敦、悉尼、奥克兰、香港）从事会计审计工作，1996年1月至2000年底先后在香港证监会、香港证券交易所工作，2001年至2016年先后任华高和升财务顾问公司董事总经理、领展房地产投资基金财务总监、Gulf Fund Management 基金总裁，联合能源集团有限公司首席财务总监，新昌集团控股有限公司首席财务总监、首席投资总监，2016年2月至2016年12月任太平洋网络有限公司首席财务总监，2016年12月至2019年5月

任新昌集团控股有限公司首席营运官。现任公司独立董事、Venturous Group Limited 联合创始人兼首席财务官、Neuron Operations Limited 代理首席执行官。

李旭冬先生：中国国籍，无境外永久居留权，1970年11月出生，本科学历，高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师及中国注册税务师。李旭冬先生1992年10月至1996年11月任呼和浩特锅炉制造总厂会计，1996年12月至1998年10月任内蒙古会计师事务所经理，1998年10月至2000年8月任内蒙古国正会计师事务所部门经理，2000年8月至2011年9月任中天华正会计师事务所合伙人，2012年1月至今任大华会计师事务所（特殊普通合伙）执行合伙人，李旭冬先生曾担任郑州煤矿机械集团股份有限公司、杭州诺邦无纺股份有限公司等公司独立董事职务。现任公司独立董事、大华会计师事务所（特殊普通合伙）执行合伙人、北京金融控股集团外部董事、天津力神电池股份有限公司董事、浙江泰坦股份有限公司独立董事、天津泰达生物医学工程股份有限公司独立董事、金成技术股份有限公司独立董事、郑州恒达智控科技股份有限公司独立董事。

刘晓蕾女士：中国国籍，香港永久居留权，1974年1月出生，博士研究生学历。刘晓蕾女士2005年12月至2014年12月历任香港科技大学助理教授、副教授（终身职），2014年12月至今任北京大学光华管理学院金融系、会计系教授，2015年11月至今任北京大学光华管理学院金融学系主任，刘晓蕾女士曾担任天津友发钢管集团股份有限公司、财信证券有限责任公司等公司独立董事职务。现任公司独立董事、北京大学博雅特聘教授、经济与管理学部副主任、光华管理学院金融系和会计系教授、金融学系主任、富达基金管理（中国）有限公司独立董事。

刘晓华女士：中国国籍，无境外永久居留权，1982年8月出生，研究生学历。刘晓华女士2007年8月至2009年8月在神华（北京）遥感勘查有限责任公司从事公司法务工作，2009年9月至2012年1月在大成律师事务所（上海分所）从事律师工作，2012年2月至2013年10月任安信证券股份有限公司项目经理，2013年11月至2017年4月任西南证券股份有限公司董事，2017年4月至2018年12月任国泰君安创新投资有限责任公司执行董事，2019年1月至2022年3月任北京中经格隆投资顾问有限公司副总裁，2022年3月至今任海南博浩广汇私募基金管理合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人（委派代表）。现任公司独立董事、海南博浩广汇私募基金管理合伙企业（有限合伙）执行事务合伙人（委派代表）、知学云（北京）科技股份有限公司独立董事、特雷西能源科技股份有限公司独立董事、珠海云灏投资中心（有限合伙）执行事务合伙人（委派代表）、北京方灏管理咨询有限公司监事。

## 2、监事会成员

张长宇先生：中国国籍，无境外永久居留权，1978年11月出生，法学硕士、公共管理硕士，



讲师。张长宇先生 2000 年 7 月至 2006 年 10 月任北京交通大学校长办公室干部、电子信息工程学院团委书记，2006 年 10 月至 2011 年 9 月任北京市知识产权局办公室副主任、主任，2011 年 9 月至 2013 年 7 月任北京市海淀区知识产权局局长、中关村科技园区海淀园管委会知识产权处处长，2013 年 7 月至 2014 年 10 月任北京市海淀区青龙桥街道党工委书记、办事处主任，2014 年 10 月至 2020 年 6 月历任北京市人民政府法制办公室秘书处处长、法制四处处长、北京市司法局立法一处处长，2020 年 6 月至 2023 年 6 月历任北京国有资本运营管理有限公司党委办公室主任、董事会秘书、董事会办公室主任、综合管理部总经理。张长宇先生现任公司党委书记、监事会主席。

王学锋先生：中国国籍，无境外永久居留权，1968 年 10 月出生，研究生学历。王学锋先生 1987 年 8 月至 2013 年 3 月先后在北京延庆永宁粮管所、北京市延庆粮食局、北京市昊利恒粮油贸易有限责任公司、北京市延庆粮油总公司等单位工作。2013 年 4 月至 2020 年 8 月历任北京粮食集团有限责任公司审计部外派财务总监、财务部副部长，2020 年 9 月至今任北京首农食品集团有限公司审计部副部长，现任公司监事、北京京粮生物科技集团有限公司董事、北京首农食品集团财务有限公司监事、北京京粮粮油贸易集团有限公司董事。

孙晶女士：中国国籍，无境外永久居留权，1968 年 10 月出生，本科学历。孙晶女士 1992 年 7 月至 1996 年 12 月历任北京贵宾楼饭店人事部秘书、主管，1996 年 12 月至 1997 年 6 月任北京笔电新人信息技术有限公司人力资源部经理。孙晶女士于 1997 年 6 月加入公司，历任公司公关部副经理、人力资源部经理、总裁办公室副主任、北京办事处主任、销售交易部总监、党委办公室扶贫工作负责人。现任公司职工代表监事、党委办公室扶贫工作负责人，兼任深圳市第一创业公益基金会副秘书长。

孙蕤先生：中国国籍，无境外永久居留权，1973 年 8 月出生，本科学历，中级经济师。孙蕤先生于 1994 年 8 月至 1999 年 9 月就职于广州证券交易中心会员部、投资部，1999 年 10 月至 2001 年 1 月任联合证券广州华乐路营业部投资咨询部副经理。孙蕤先生于 2001 年 2 月加入公司，历任公司证券投资部研究员、清算托管部综合管理主管、高级清算师、交易管理总监、运营管理部负责人兼资产托管部负责人，现任公司职工代表监事、运营管理部负责人。

李劲先生：中国国籍，无境外永久居留权，1988 年 1 月出生，研究生学历。李劲先生于 2012 年 7 月至 2014 年 8 月就职于中国平安人寿保险股份有限公司，于 2014 年 8 月加入公司，历任公司法律合规部法律合规岗、经纪业务组负责人，现任公司法律合规部审核组负责人。

### 3、公司高级管理人员

王芳女士，总裁，简历同上。

马东军先生：中国国籍，拥有美国永久居留权，1968年5月出生，研究生学历，注册会计师、注册评估师。马东军先生1991年8月至2001年12月先后任天勤会计师事务所和中天勤会计师事务所合伙人，2001年12月至2003年5月任深圳同盛创业投资管理有限公司合伙人，2005年7月至2007年3月任日域（美国）国际工程有限公司财务部国际财务总监，2007年7月至2012年1月任深圳发展银行总行稽核部副总经理（主持工作）。马东军先生于2012年2月加入公司，曾任计划财务部负责人，2013年8月起任公司财务总监。2014年3月至2017年10月兼任第一创业证券承销保荐有限责任公司董事，2014年6月至2016年4月兼任第一创业期货有限责任公司监事，2016年4月至2020年5月兼任第一创业期货有限责任公司董事，2018年6月至2021年6月兼任公司董事会秘书。现任公司副总裁兼财务总监、深圳第一创业创新资本管理有限公司董事长兼总经理，兼任第一创业投资管理有限公司董事、银华基金管理股份有限公司监事会主席。

邱巍先生：中国国籍，无境外永久居留权，1968年8月出生，高级经济师，经济学博士。邱巍先生于1990年9月至1994年7月任汕头大学科研处科员，于2000年7月至2011年3月任深圳发展银行广州分行公司部和零售部总经理、科韵支行行长、总行贸易融资部副总经理，2011年4月至2014年5月任广东南粤银行总行副行长。邱巍先生于2014年6月加入公司，曾任企业融资部负责人，2021年4月至2021年10月兼任第一创业投资管理有限公司董事。现任公司副总裁，兼任广东一创恒健融资租赁有限公司副董事长。

卢国聪先生：中国国籍，无境外永久居留权，1980年8月出生，经济法学硕士。卢国聪先生具有执业律师资格，2006年7月至2015年6月就职于深圳证监局，历任科员、副主任科员、主任科员、副处长；2015年6月至2018年7月就职于广发证券股份有限公司，任合规与法律事务部总经理兼广发证券资产管理（广东）有限公司监事长。卢国聪先生于2018年7月加入公司，现任公司合规总监，兼任深圳市第一创业公益基金会理事长。

朱剑锋先生：中国国籍，无境外永久居留权，1971年5月出生，国民经济学博士。朱剑锋先生1996年至2006年就职于中信银行，曾任办公室主任，2006年至2009年就职于渤海银行，曾任战略发展部总经理，2009年至2012年就职于广州银行，曾任深圳分行副行长，2012年至2016年就职于中信证券股份有限公司，曾任经发管委营销管理部总监、广东分公司总经理。朱剑锋先生于2016年10月加入第一创业投资管理有限公司，历任执行委员会委员、董事；2018年8月加入公司，历任销售交易部负责人、经纪业务机构客户部负责人，现任公司副总裁、第一创业投资管理有限公司董事长、深圳第一创业创新资本管理有限公司董事。

王国峰先生：中国国籍，无境外永久居留权，1972年9月出生，博士。王国峰先生2003年8月至2005年5月任中国电子信息产业发展研究院中国计算机用户杂志社总编辑助理、副总编

辑；2006年5月至2006年8月任中国物品编码中心技术部研究员；2006年9月至2014年7月任中信证券股份有限公司风险管理部副总裁、高级副总裁；2014年7月至2017年6月任中国银河证券股份有限公司风险管理部副总经理、副总经理（主持工作）；2017年7月至2021年1月任华兴证券有限公司副总经理、首席风险官。王国峰先生于2021年1月加入公司，现任公司首席风险官、首席信息官。

屈媪女士：中国国籍，无境外永久居留权，1982年6月出生，研究生学历。屈媪女士自2007年9月起历任公司法律合规部合规经理、固收与投资组负责人、法律合规部负责人、公司总裁业务助理，2011年7月至2017年10月兼任第一创业投资管理有限公司监事，2014年7月至2017年10月兼任深圳第一创业创新资本管理有限公司监事，2015年2月至2020年3月兼任北京元富源投资管理有限责任公司监事，2016年7月至2021年4月兼任公司职工代表监事，现任公司董事会秘书，兼任创金合信基金管理有限公司董事。

陈彬霞女士：中国国籍，无境外永久居留权，1985年1月出生，工商管理硕士。陈彬霞女士2009年4月至2011年8月任华鑫证券有限责任公司自营部投资经理，2011年8月至2017年4月任华英证券有限责任公司债券投资交易部总经理，2017年4月至2019年3月任华林证券股份有限公司固定收益部总经理，2019年3月至2021年5月任华林证券股份有限公司副总裁。陈彬霞女士于2021年5月加入公司，现任公司副总裁。

#### 4、集合计划投资经理

崔易，女，中国人民大学经济学硕士，于2019年加入第一创业证券，现任资产管理部大集合投资经理。曾任万联证券股份有限公司信用研究员、第一创业证券资产管理部信用研究员。擅长信用债精选投资，秉承以宏观基本面和行业基本面研判为基础，自上而下发现投资机会，风格稳健。

崔易女士最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

#### 5、大集合投资管理委员会成员

公司大集合投资管理委员会的成员包括：主任委员尹占华先生、委员张振宇先生、崔易女士。

#### 6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、管理人的职责

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

2、办理集合计划备案手续；

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

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

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

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

7、依法接受托管人的监督；

8、采取适当合理的措施使计算集合计划份额申购、赎回和注销价格的方法符合《资产管理合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告集合计划净值信息，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、中期和年度报告；

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

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

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

14、按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

21、监督托管人按法律法规和《资产管理合同》规定履行自己的义务，托管人违反《资产管

理合同》造成集合计划财产损失时，管理人应为集合计划份额持有人利益向托管人追偿；

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

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

24、执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

25、建立并保存集合计划份额持有人名册；

26、法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

#### 四、管理人关于遵守法律法规的承诺

1、管理人承诺遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》、《操作指引》等法律法规的相关规定，并建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止违法违规行为的发生；

2、管理人承诺严格遵守《基金法》、《运作办法》，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止以下《基金法》、《运作办法》禁止的行为发生：

(1) 将管理人固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资；

(2) 不公平地对待管理的不同集合计划财产；

(3) 利用集合计划财产或者职务之便为集合计划份额持有人以外的人牟取利益；

(4) 向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5) 侵占、挪用集合计划财产；

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

(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；

(8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

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

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

#### 五、管理人关于禁止性行为的承诺

为维护集合计划份额持有人的合法权益，本集合计划禁止从事下列行为：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他集合计划份额或基金份额，但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。集合计划投资运作过程中的重大关联交易应经管理人董事会审议，并经三分之二以上的独立董事通过。集合计划管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，管理人在履行适当程序后，本集合计划可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

## 六、集合计划投资经理承诺

- 1、依照有关法律、法规和资产管理合同的规定，本着勤勉尽责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、受雇人或集合计划份额持有人以外的人谋取利益；
- 3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密，尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- 4、不以任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

## 七、管理人的内部控制制度

### 1、内部控制目标

公司内部控制的目的是合理保证经营管理合法合规、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，促进实现发展战略。

### 2、内部控制制度概述

公司依法制定了投资管理制度、风险控制制度、产品会计制度、信息披露制度、监察稽核制

度、业绩评估考核制度、紧急情况处理制度、投资者适当性管理制度、流动性风险管理制度、风险准备金提取制度、信息技术管理制度、公司财务制度、资料档案管理制度、投资管理人员管理制度、公平交易管理制度等多个内部控制制度。内部控制制度体系涵盖公司所有运营环节，且具有较强的指导性和可执行性。

### 3、风险管理和内部控制体系

公司建立了董事会及其风险管理委员会、董事会授权的经理层及其下设执行委员会、履行专项风险管理职责的相关部门、业务及职能部门四级风险管理体系。

第一层级：董事会是风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任。董事会设立风险管理委员会，在董事会授权范围内履行风险管理职责，对董事会负责并报告工作。

第二层级：公司经理层对全面风险管理承担主要责任。

第三层级：公司风险管理部、法律合规部、计划财务部、总裁办公室、董事会办公室等部门分别承担相应的风险管理职责，构成公司风险管理体系的第三层级。法律合规部主要负责对公司可能面临的法律风险、合规风险与洗钱风险进行识别、评估、控制和报告；风险管理部主要负责对公司可能面临的市场风险、信用风险、操作风险以及公司总体风险制定并完善风险管理政策、制度和流程。稽核部负责检查、报告和评价公司风险管理体系的健全性和执行的有效性。计划财务部负责流动性风险管理。公司总裁办公室负责声誉风险管理，董事会办公室负责公司的重大信息批露，并协助总裁办公室管理公司的声誉风险。

第四层级：各业务（含营业部）及职能部门负责全面识别、评估、应对与报告其业务相关的各类风险，并针对主要风险点和风险性质，结合业务实际制订并执行统一的业务流程、操作规范和风险控制措施，对本部门风险进行一线管控。各业务及职能部门负责人对本部门风险管理的有效性承担直接责任。各业务及职能部门设立业务风险管理岗，负责定期报告本部门的业务风险。各业务及职能部门共同构成公司风险管理体系的第四层级。

## 第五部分

## 托管人

### 一、托管人基本情况

名称：兴业银行股份有限公司（以下简称“兴业银行”）

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市银城路 167 号

邮政编码：200120

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

### 二、发展概况及财务状况

兴业银行成立于 1988 年 8 月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007 年 2 月 5 日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本 207.74 亿元。截至 2023 年 6 月 30 日，兴业银行资产总额达 9.89 万亿元，实现营业收入 1110.47 亿元，同比降低 4.15%，全年实现归属于母公司股东的净利润 426.80 亿元。

开业三十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。

### 三、主要人员情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、基金证券业务处、信托保险业务处、理财私募业务处、产品管理处、稽核监察处、投资监督管理处、运行管理处等处室，共有员工 100 余人，业务岗位人员均具有基金从业资格。



#### 四、证券投资基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于 2005 年 4 月 26 日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字[2005]74 号。截至 2023 年 9 月 30 日，兴业银行共托管证券投资基金 670 只，托管基金的基金资产净值合计 23386.83 亿元，基金份额合计 22572.13 亿份。

#### 五、托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

##### 2、内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部控制组织架构由总行内部控制委员会、总行风险管理部门、总行审计部、总行资产托管部、总行运营管理部及分行托管运营机构共同组成。各级内部控制组织依照兴业银行相关制度对兴业银行托管业务风险管理和内部控制实施管理。

##### 3、内部控制原则

(1) 全面性原则：内部控制贯穿资产托管业务的全过程，覆盖各项业务和产品，以及从事资产托管业务的各机构和从业人员；

(2) 重要性原则：内部控制应当在全面控制的基础上，关注重要业务事项和高风险领域；

(3) 独立性原则：开展托管业务的部门和岗位的设置应权责分明、相对独立、相互制衡；

(4) 审慎性原则：内控与风险管理必须以防范风险，保证托管资产的安全与完整为出发点，“内控优先”，“制度优先”，审慎发展资产托管业务；

(5) 制衡性原则：内部控制应当在治理结构、机构设置及权责分配、业务流程等方面形成相互制约、相互监督，同时兼顾运营效率；

(6) 适应性原则：内部控制体系应同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

(7) 成本效益原则：内部控制应当权衡实施成本与预期效益，以适当的成本实现有效控制。

##### 4、内部控制制度和措施

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

- (2) 建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。
- (3) 风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。
- (4) 相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。
- (5) 人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。
- (6) 应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

#### 六、托管人对管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

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

托管人发现管理人有违反《基金法》、《运作办法》、集合计划合同和有关法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对并以书面形式对托管人发出回函。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。托管人发现管理人有重大违规行为，立即报告中国证监会，同时，通知管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

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

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

## 第六部分

## 相关服务机构

### 一、销售机构

#### 1、第一创业证券股份有限公司：

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：吴礼顺

客户服务电话：95358

官方网站：<https://www.firstcapital.com.cn>

#### 2、上海好买基金销售有限公司：

注册地址：上海市虹口区东大名路 501 号 6211 单元

办公地址：上海市浦东新区张杨路 500 号华润时代广场 12 层

法人代表：陶怡

客户咨询电话：400-700-9665

官方网站：<https://www.howbuy.com>

#### 3、珠海盈米基金销售有限公司：

注册地址：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室

办公地址：广东省广州市海珠区阅江中路 688 号保利国际广场北塔 33 层

法人代表：肖雯

客户咨询电话：020-89629066

官方网站：<https://www.yingmi.com>

#### 4、财咨道信息技术有限公司：

注册地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

办公地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

法人代表：朱荣晖

客户咨询电话：400-003-5811

官方网站：<https://www.jinjiwo.com>

#### 5、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司：

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

办公地址：浙江省杭州市西溪路 556 蚂蚁 Z 空间

法人代表：王珺

客户咨询电话：95188-8

官方网站：<http://www.fund123.cn>

6、上海中正达广基金销售有限公司：

注册地址：上海市徐汇区龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室

办公地址：上海市徐汇区龙兰路 277 号 1 号楼 1203、1204 室

法人代表：黄欣

客户咨询电话：400-6767-523

官方网站：<https://www.zhongzhengfund.com>

7、京东肯特瑞基金销售有限公司：

注册地址：北京市海淀区知春路 76 号(写字楼)1 号楼 4 层 1-7-2

办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号院京东集团总部 A 座 15 层

法人代表：邹保威

客户咨询电话：400 098 8511（个人业务）；400 088 8816（企业业务）

官方网站：<http://kenterui.jd.com>

8、上海天天基金销售有限公司：

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼二层

办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号东方财富大厦

法人代表：其实

客户咨询电话：95021

官方网站：<https://www.1234567.com.cn>

9、上海基煜基金销售有限公司：

注册地址：上海市黄浦区广东路 500 号 30 层 3001 单元

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法人代表：王翔

客户咨询电话：400-820-5369

官方网站：<https://www.jigoutong.com/products/>

10、上海联泰基金销售有限公司：

注册地址：上海市普陀区兰溪路 900 弄 15 号 526 室

办公地址：上海市虹口区临潼路 188 号

法人代表：尹彬彬

客户咨询电话：400-118-1188

官方网站：<https://www.66liantai.com>

11、上海利得基金销售有限公司：

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

办公地址：上海市虹口区东大名路 1098 号浦江国际金融广场 53 层

法人代表：李兴春

客户咨询电话：400-032-5885

官方网站：<https://www.leadfund.com.cn/website/home>

12、奕丰基金销售有限公司：

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

办公地址：深圳市南山区海德三道航天科技广场 A 座 17 楼 1704 室

法人代表：TEO WEE HOWE

客户咨询电话：400-684-0500

官方网站：<https://www.ifastps.com.cn>

13、北京坤元基金销售有限公司：

注册地址：北京市石景山区古城大街特钢公司十一区（首特创业基地 A 座）八层 816 号

办公地址：北京市石景山区古城大街特钢公司十一区（首特创业基地 A 座）八层 816 号

法人代表：杜福胜

客户咨询电话：4006498989

官方网站：<https://www.kunyuanfund.com>

14、中证金牛（北京）基金销售有限公司：

注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址：北京市丰台区丽泽金融商务区铭丰大厦 4 层 401

法人代表：吴志坚

客户咨询电话：4008-909-998

官方网站：<https://www.jnlc.com>

15、济安财富（北京）基金销售有限公司：

注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 10 层 1005

办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 11 层 1105

法人代表：杨健

客户咨询电话：400-673-7010

官方网站：<http://www.jianfortune.com>

16、上海万得基金销售有限公司：

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区浦明路 1500 号 8 层 M 座

办公地址：中国（上海）浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 8 楼

法人代表：简梦雯

客户咨询电话：400-799-1888

官方网站：<https://www.520fund.com.cn>

17、泛华普益基金销售有限公司：

注册地址：成都市成华区建设路 9 号高地中心 1101 室

办公地址：成都市金牛区花照壁西顺街 399 号 1 栋 1 单元龙湖西宸天街 B 座 1201 号

法人代表：杨远芬

客户咨询电话：400-080-3388

官方网站：<https://www.puyifund.com>

18、和耕传承基金销售有限公司：

注册地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

办公地址：河南自贸试验区郑州片区（郑东）东风南路东康宁街北 6 号楼 5 楼 503

法人代表：温丽燕

客户咨询电话：400-0555-671

官方网站：<https://www.hgccpb.com>

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

## 二、登记机构

名称：第一创业证券股份有限公司

住所及办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

法定代表人：吴礼顺

客户服务电话：95358

传真：0755-23838109

联系人：雷岩

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-31358600

经办律师：丁媛、安冬

### 四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市黄浦区南京东路 61 号四楼

执行事务合伙人：朱建弟、杨志国

联系人：唐成

联系电话：15000782499

传真：021-63392558

经办注册会计师：唐成

## 第七部分

## 集合计划的存续

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

本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。



## 第八部分

## 集合计划份额的申购和赎回

### 一、申购与赎回场所

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

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

### 二、申购与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，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或资产管理合同的约定公告暂停申购、赎回时除外。

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

#### 2、申购、赎回开始日及业务办理时间

管理人自资产管理合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。此后的每个工作日为本集合计划的申购业务开放日。

集合计划份额每个运作期到期日，本集合计划份额持有人可提出赎回申请。管理人自资产管理合同生效日满 1 个月对应的月度对日起开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

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

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

### 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

### 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，必须按销售机构规定的方式全额交付申购款项，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。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。份额持有人赎回(T日)申请生效后，管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。在发生巨额赎回时或资产管理合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照资产管理合同有关条款处理。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至前述因素消失日的下一个工作日划出。

投资者在提交赎回申请时须持有足够的集合计划份额余额，否则所提交的赎回申请无效而不予成交。

#### 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（包括该日）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）及时到销售机构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。若申购不成功或无效，则管理人或管理人指定的销售机构将投资者已交付的申购款项本金退还给投资人。管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申购申请及申购份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。因投资人怠于行使权利，致使其相关权益受损的，管理人、托管人、销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

## 五、申购和赎回的数量限制

1、本集合计划首次申购和追加申购的单笔最低金额均为人民币 1 元，各销售机构在符合上述规定的前提下，可根据情况调整首次申购和追加申购的最低金额，具体以销售机构公布的为准，投资者需遵循销售机构的相关规定。

2、投资者可将其全部或部分集合计划份额赎回。本集合计划单笔赎回申请不低于 1 份，集合计划份额持有人赎回时或赎回后在销售机构网点保留的集合计划份额余额不足 1 份的，在赎回时需一次全部赎回。各销售机构在符合上述规定的前提下，可根据情况调整单笔最低赎回份额要求，具体以销售机构公布的为准，投资者需遵循销售机构的相关规定。

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

4、管理人可以规定单个投资人累计持有的集合计划份额上限或持有的集合计划份额占集合计划份额总数的比例上限，具体规定请参见相关公告。

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

6、管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定的数量、金额和/或比例限制。管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

## 1、申购费

(1) 投资人申购集合计划份额时，需交纳申购费用，申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在开放期内可以多次申购集合计划，申购费率按单笔分别计算。具体申购费率如下表所示：

单笔申购金额(含申购费, M)	申购费率
M < 100 万元	0.40%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.30%
500 万元 ≤ M < 1000 万元	0.10%
M ≥ 1000 万元	每笔 1000 元

(2) 申购费用由投资人承担，不列入集合计划财产，主要用于集合计划的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

## 2、赎回费

由于本集合计划对于每份集合计划份额，设定一个月的滚动运作期，本集合计划不收取赎回费用。

3、管理人可以在《资产管理合同》规定的范围内调整申购费率和赎回费率，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照有关规定在规定媒介上公告，调整后的申购费率和赎回费率在更新的招募说明书中列示。

## 七、申购份额与赎回金额的计算

### 1、集合计划申购份额的计算方法如下：

#### (1) 适用于比例费率

本集合计划的申购金额包括申购费用和净申购金额。申购份额的计算公式为：

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

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

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

#### (2) 适用于固定费用

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

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

例一：某投资者投资 10 万元申购本集合计划，对应申购费率为 0.4%，假设申购当日集合计

划份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 100,000 / (1 + 0.4\%) = 99,601.59 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 100,000 - 99,601.59 = 398.41 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 99,601.59 / 1.0160 = 98,033.06 \text{ 份}$$

例二：某投资者投资 1000 万元申购本集合计划，则对应的申购费用为 1,000.00 元，假设申购当日集合计划份额净值为 1.0160 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 1,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 10,000,000.00 - 1,000.00 = 9,999,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,999,000.00 / 1.0160 = 9,841,535.43 \text{ 份}$$

## 2、集合计划赎回金额的计算

在本集合计划的赎回金额的计算公式为：

$$\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日集合计划份额净值}$$

例三：某投资人申购本集合计划，并于运作期到期日赎回 10 万份，假设赎回当日集合计划份额净值是 1.0170 元，则其可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回金额} = 100,000 \times 1.0170 = 101,700.00 \text{ 元}$$

## 3、集合计划份额净值的计算

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

## 4、申购份额的计算及余额的处理方式

申购的有效份额为净申购金额除以当日的集合计划份额净值，有效份额单位为份。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。

## 5、赎回金额的处理方式

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

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

7、当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。

8、管理人可以在不违反法律法规规定及资产管理合同约定的情形下根据市场情况制定促销计划，定期或不定期地开展促销活动。在促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，管理人可以适当调低集合计划的申购费率和赎回费率。

#### 八、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

- 1、因不可抗力导致集合计划无法正常运作。
- 2、发生资产管理合同约定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的申购申请。
- 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值或无法办理申购业务。
- 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、当特定资产占前一估值日集合计划资产净值 50%以上时，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停接受集合计划申购申请。
- 7、管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有集合计划份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形。
- 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述第 1、2、3、5、6、8 项暂停申购情形之一且管理人决定暂停接受投资人申购申请时，管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7 项情形时，管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。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、暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，管理人可暂停接受份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- 1、因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。
- 2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受份额持有人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值或者无法办理赎回业务。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

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

6、当特定资产占前一估值日集合计划资产净值 50%以上时，经与托管人协商确认后，管理人应当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，管理人应按规定报中国证监会备案，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按资产管理合同的相关条款处理。集合计划份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## 十、巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本集合计划单个开放日内的集合计划份额净赎回申请（赎回申请份额总数加上集合计划转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及集合计划转换中转入申请份额总数后的余额）超过前一工作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份额持有人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

（2）部分延期赎回：当管理人认为支付份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付份额持有人的赎回申请而进行的财产变现可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作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，份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期

赎回的，将自动转入下一个工作日继续赎回，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工作日赎回申请一并处理，无优先权并以下一工作日的集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

若本集合计划发生巨额赎回且单个集合计划份额持有人单个开放日内的集合计划份额赎回申请超过上一工作日集合计划总份额 20%（即“单一巨额赎回申请人”）的情形下，管理人根据本集合计划当时的资产组合状况决定部分延期赎回时，按照保护剩余其他赎回申请人利益的原则，管理人可以优先确认前述剩余其他赎回申请人的赎回申请。如前述剩余其他赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日集合计划总份额的 10%的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对单一巨额赎回申请人的赎回申请按比例确认，其余赎回申请参照前段“（2）部分延期赎回”的约定方式延期办理；如前述剩余其他赎回申请人的赎回申请未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含前述剩余其他赎回申请人的其余赎回申请与单一巨额赎回申请人的全部赎回申请）参照前段“（2）部分延期赎回”的约定方式延期办理。管理人应当对延期办理的事宜在规定媒介上进行公告。

（3）暂停赎回：连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，如管理人认为有必要，可暂停接受集合计划的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过 20 个工作日，并应当在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、传真或者管理人网站等其他方式在 3 个交易日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，并在两日内在规定媒介上刊登公告。

## 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，管理人应在规定期限内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 个开放日的集合计划份额净值。

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

4、如发生暂停的时间超过 2 周，暂停期间，管理人应每 2 周至少刊登暂停公告 1 次。暂停



结束，集合计划重新开放申购或赎回时，管理人应提前 2 日在规定媒介上连续刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公告最近 1 个开放日的集合计划份额净值。

## 十二、集合计划的转换

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

## 十三、集合计划的非交易过户

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

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

## 十四、集合计划的转托管

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

## 十五、定期定额投资计划

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

## 十六、集合计划的冻结和解冻

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

产生的权益一并冻结，被冻结部分份额仍然参与收益分配与支付，法律法规另有规定的除外。

#### 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。

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

#### 十八、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回

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

## 第九部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

本集合计划投资目标为通过在严格管理风险和保障必要流动性的前提下，为集合计划持有人追求资产的长期稳健增值。

### 二、投资范围

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、可转换债券（含可分离交易的可转债）、可交换债、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及经中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本集合计划不直接投资于股票等权益类资产，但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的股票等权益资产。因上述原因持有的股票，本集合计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

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

集合计划的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于可转换债券（含可分离交易的可转债）及可交换债券的比例合计不超过集合计划资产的 20%。本集合计划每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后应当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。

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

### 三、投资策略

#### 1、信用债投资策略

本集合计划将重点投资信用类债券，以提高组合收益能力。信用债券相对央票、国债等利率产品的信用利差是本集合计划获取较高投资收益的来源，本集合计划采用第一创业内部评估体系

对债券发行人以及债券的信用风险进行评估。债券研究员根据国民经济运行周期阶段，分析信用债券发行人所处行业发展前景、发展状况、市场地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，评价债券发行人的信用风险，并根据特定债券的发行契约，评价债券的信用级别，确定信用债券的信用风险利差。

信用债投资策略具体包括：

#### （1）久期配置策略

本集合计划以研究宏观经济走势、经济周期所处阶段和宏观经济政策动向等为出发点，采取自上而下分析方法，预测未来收益率曲线变动趋势，并据此积极调整信用债券组合的平均久期，提高债券组合的投资收益。

#### （2）类属配置策略

本集合计划将对经济周期和债券市场变化，以及不同类型信用债券的信用风险、税赋水平、市场流动性、相对价差收益等因素进行分析，判断信用利差曲线走势，制定和调整信用债券类属配置比例。

#### （3）个券精选策略

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。

本集合计划采用分散化投资策略，出于更为审慎的流动性及信用风险管理目的，本集合计划投资债券的信用评级不低于 AA+级，其中投资于 AA+信用等级的信用债不超过信用债资产的 50%，投资于 AAA 信用等级的信用债占信用债资产的 50%-100%。其中，信用评级为债项评级，若无债项评级或债项评级为短期信用评级的，依照其主体评级。

### 2、收益率曲线策略

收益率曲线形状变化代表长、中、短期债券收益率差异变化，相同久期债券组合在收益率曲线发生变化时差异较大。通过对同一类属下的收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，首先可以确定债券组合的目标久期配置区域并确定采取子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略；其次，通过不同期限间债券当前利差与历史利差的比较，可以进行增陡、减斜和凸度变化的交易。

### 3、杠杆放大策略

杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用买断式回购、质押式回购等方式融入低成本资金，并购买剩余年限相对较长并具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。

### 4、资产支持证券投资策略

资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析，本集合计划将在国内资产

证券化产品具体政策框架下，采用基本面分析和数量化模型相结合，对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。本集合计划将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

#### 5、国债期货策略

实施国债期货套期保值的目标是利用国债期货与现货资产组合收益率波动相关性而持有相应比例的相同或相反方向头寸从而降低资产组合收益波动率，或减少资产组合价值下跌风险。拟实施的国债期货套期保值策略主要包括久期中性策略、DV01 套保策略以及 Beta 比例套保。在具体操作方面可以选择单一目标价位套保和多目标价位套保及套利形式套保等。信用债由于有信用风险补偿存在，国债期货只能对冲利率风险，组合仍会留有信用风险的敞口。

今后，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，还将积极寻求其他投资机会，如法律法规或监管机构以后允许计划投资其他品种，本集合计划将在履行适当程序后，将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

### 四、投资限制

#### 1、组合限制

集合计划的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%；
- (2) 本集合计划每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后应当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；
- (3) 本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的 10%；
- (4) 本集合计划管理人管理的全部大集合资产管理计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种可以不受此条款规定的比例限制；
- (5) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合计划资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使计划不符合前款所规定比例限制的，管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；
- (6) 本集合计划与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与资产管理合同约定的投资范围保持一致；
- (7) 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%;

(8) 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%;

(9) 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%;

(10) 本集合计划管理人管理的全部大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%;

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

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

(13) 本集合计划总资产不超过集合计划净资产的 140%;

(14) 本集合计划在任何交易日日终, 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%; 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%; 集合计划所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合资产管理合同关于债券投资比例的有关约定; 在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 30%;

(15) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(5)、(6)、(11)项另有约定外, 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的, 管理人应当在 10 个交易日内进行调整, 但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的, 从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制, 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或以变更后的规定为准。

## 2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

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

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。集合计划投资运作过程中的重大关联交易应经管理人董事会审议，并经三分之二以上的独立董事通过。集合计划管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，管理人在履行适当程序后，本集合计划可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

## 五、业绩比较基准

本集合计划业绩比较基准：中债综合指数收益率\*95%+1年期定期存款利率（税后）\*5%。

根据集合计划的投资范围、投资目标及流动性特征，本集合计划选取中债综合指数收益率及1年期定期存款利率（税后）作为本集合计划的业绩比较基准。中债综合指数是一个反映境内人民币债券市场价格走势情况的宽基指数，是中债指数应用最广泛指数之一，由中央国债登记结算有限责任公司专门针对债券市场投资性需求开发的指数；由于本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的80%，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，采用中债综合指数收益率\*95%作为业绩比较基准中债券投资所代表的权重，1年期定期存款利率（税后）\*5%作为业绩比较基准中现金资产投资所代表的权重可以较好的反映本集合计划的风险收益特征。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称，或者今后法律法规发生变化，又或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出时，本集合计划管理人可以与托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，无需召开份额持有人大会。

## 六、风险收益特征

本集合计划为债券型集合资产管理计划，长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型集合计划、混合型集合计划，高于货币型集合计划。

## 七、管理人代表集合计划行使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相关权利，保护集合计划份额持有人的利益；
- 2、有利于集合计划财产的安全与增值；
- 3、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正当利益。

## 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

## 九、投资组合报告(截至 2023 年 9 月 30 日)

### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	59,159,892.47	96.26
	其中：债券	54,603,022.33	88.85



	资产支持证券	4,556,870.14	7.41
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,105,283.45	3.43
8	其他资产	193,324.66	0.31
9	合计	61,458,500.58	100.00

## 2、报告期末按行业分类的股票投资组合

### (1) 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有股票。

### (2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通投资股票。

## 3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本集合计划本报告期末未持有股票。

## 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,597,852.33	4.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	36,566,422.71	67.65
5	企业短期融资券	2,856,330.49	5.28
6	中期票据	12,125,114.94	22.43
7	可转债(可交换债)	457,301.86	0.85
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	54,603,022.33	101.02

## 5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	175846	21天易02	40,000	4,202,202.74	7.77
2	138991	23民生G1	35,000	3,646,419.86	6.75
3	188809	21天风C1	35,000	3,563,867.81	6.59
4	2280206	22许昌小微债01	35,000	3,513,659.59	6.50
5	184190	21应城01	30,000	3,166,158.90	5.86

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	260426	淮保安02	25,000	2,513,301.37	4.65
2	143056	崖州湾1A	20,000	2,043,568.77	3.78

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

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

## 8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

## 9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

## (1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

根据本集合计划合同规定，本集合计划不参与股指期货交易。

## (2) 本基金投资股指期货的投资政策

根据本集合计划合同规定，本集合计划不参与股指期货交易。

## 10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## (1) 本期国债期货投资政策

本集合计划本报告期末未持有国债期货合约。

## (2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货合约。

## (3) 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货合约。

## 11、投资组合报告附注

(1) 本报告期内，本集合计划投资的前十名证券发行主体中，民生证券股份有限公司、淮北市建投控股集团有限公司出现编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

2023年4月3日，上交所发布关于对民生证券股份有限公司予以书面警示的决定。经查明，民生证券在从事债券承销及受托管理业务过程中，存在以下问题：一是债券承销尽职调查方面，在个别债券项目中对其他中介机构提供的专业意见核查不充分，对审计报告中内容遗漏、数据错误等情况未要求审计机构补充或更正；个别债券项目尽职调查工作底稿内容不准确，部分尽职调查材料引述的财务数据有误。二是债券受托管理方面，个别债券项目未及时就发行人的严重失信

行为向市场公告临时受托管理事务报告。鉴于上述违规事实和情节，上交所做出如下监管措施决定：对民生证券股份有限公司予以书面警示。

2022年11月9日，中国证监会发布关于对民生证券股份有限公司采取责令改正措施的决定。证监会表示，公司存在以下违规问题：一是投资银行类业务内部控制不完善，内控组织架构独立性不足，中小企业发展部履行质量控制职责的同时还存在承做投行项目的情况，部分项目质控、内核把关不严；二是廉洁从业风险防控机制不完善，第三方服务机构审查制度执行不到位。证监会决定对公司采取责令改正的行政监督管理措施。

2022年11月30日，淮北市建投控股集团有限公司收到安徽证监局出具的警示函。经查，发现淮北市建投控股集团存在以下问题：一、募集资金专户管理不规范。二、未按照募集说明书约定用途使用募集资金。上述行为违反《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第180号）第十三条的规定，根据《公司债券发行与交易管理办法》（证监会令第180号）第六十八条的规定，安徽证监局决定对公司采取出具警示函的监管措施，并根据《证券期货市场诚信监督管理办法》将相关情况记入诚信档案。

本集合计划管理人对上述证券的投资决策程序符合合同及公司制度的相关规定，并会对上述证券继续保持跟踪研究。

(2) 根据本集合计划合同规定，本集合计划的投资范围不包括股票。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,324.66
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	189,000.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	193,324.66

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113065	齐鲁转债	205,699.34	0.38
2	113037	紫银转债	105,860.21	0.20
3	128129	青农转债	71,425.65	0.13
4	113056	重银转债	51,906.21	0.10
5	110073	国投转债	22,410.45	0.04

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
本集合计划本报告期末未持有股票。

## 第十部分

## 集合计划的业绩

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

本集合计划资产管理合同生效日为2021年12月9日，集合计划业绩截止日为2023年9月30日。本报告期集合计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较如下：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2021年12月9日-2021年12月31日	0.21%	0.01%	0.34%	0.03%	-0.13%	-0.02%
2022年1月1日-2022年12月31日	1.68%	0.04%	0.53%	0.06%	1.15%	-0.02%
2023年1月1日-2023年6月30日	2.46%	0.02%	1.19%	0.03%	1.27%	-0.01%
自合同生效日（2021年12月9日）至2023年9月30日	5.34%	0.03%	2.10%	0.05%	3.24%	-0.02%

## 第十一部分

## 集合计划的财产

### 一、集合计划资产总值

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

### 二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

### 三、集合计划财产的账户

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

### 四、集合计划财产的保管和处分

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

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

## 第十二部分

## 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、债券、资产支持证券、国债期货和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

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

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

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

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

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

#### 四、估值方法

##### 1、股票的估值方法

(1) 上市流通的股票，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；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，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在0.25%以上的，可参考停牌股票的估值方法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 首次发行未上市股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值。

(3) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票，按估值日在证券交易所上市同一股票的收盘价进行估值。

(4) 流通受限股票（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）按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

##### 2、债券估值方法

(1) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（资产管理合同另有约定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，具体估值机构由管理人和托管人协商约定。

(2) 交易所上市交易的可转换债券，按估值日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进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 交易所挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(5) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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



### 3、国债期货的估值方法

交易所交易的国债期货按估值日交易所公布的当日结算价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的结算价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者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、银行定期存款或通知存款估值方法

银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。

5、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。

6、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。

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

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

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

## 五、估值程序

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

每个工作日计算集合计划资产净值及集合计划份额净值，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资产管理合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人对外公布。

## 六、估值错误的处理

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

资产管理合同的当事人应按照以下约定处理:

### 1、估值错误类型

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

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

### 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

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

4、中国证监会和资产管理合同认定的其它情形。

## 八、集合计划净值的确认

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

## 九、特殊情形的处理

1、管理人或托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为计划份额净值错误处理。

2、由于不可抗力原因、有关会计制度变化或由于证券、期货交易所、证券经纪机构、期货公

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

#### 十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

## 第十三部分

## 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、本集合计划收益分配方式为仅现金分红；
- 2、集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即收益分配基准日的计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；
- 3、每一集合计划份额享有同等分配权；
- 4、在符合上述原则和具备收益分配条件的情况下，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；
- 5、在对计划份额持有人利益无实质不利影响的前提下，管理人可调整计划收益的分配原则和支付方式，不需召开计划份额持有人大会审议；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

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

### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

### 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。

#### 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。

## 第十四部分

## 集合计划的费用与税收

### 一、集合计划费用的种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的信息披露费用；
- 5、《资产管理合同》生效后与集合计划相关的会计师费、审计费、律师费和诉讼费和仲裁费等；
- 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、集合计划的账户开户费用、账户维护费用；
- 10、按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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提，逐日累计至每季季末，按季支付，由管理人向托管人发送集合计划管理费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 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 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每季季末，按季支付，由管理人向托管人发送集合计划托管费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

本集合计划的销售服务费按前一日集合计划资产净值的 0.20% 年费率计提。本销售服务费将用于本集合计划的销售与份额持有人服务，管理人将在集合计划年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划销售服务费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划销售服务费每日计提，逐日累计至每季季末，按季支付，由管理人向托管人发送集合计划销售服务费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

### 三、不列入集合计划费用的项目

下列费用不列入集合计划费用：

- 1、管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划财产的损失；
- 2、管理人和托管人处理与集合计划运作无关的事项发生的费用；
- 3、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。

## 第十五部分

## 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在 2 日内在规定媒介公告。

## 第十六部分 集合计划的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

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

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

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

### 五、公开披露的集合计划信息

公开披露的集合计划信息包括：

（一）集合计划招募说明书、产品资料概要、《资产管理合同》、集合计划托管协议

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

2、集合计划招募说明书应当最大限度地披露影响集合计划投资者决策的全部事项，说明集合计划申购和赎回安排、集合计划投资、集合计划产品特性、风险揭示、信息披露及集合计划份额持有人服务等内容。

3、产品资料概要是集合计划招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的集合计划概要信息。集合计划管理人应当按照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新产品资料概要。

资产管理合同生效后，集合计划招募说明书、产品资料概要的信息发生重大变更的，集合计划管理人应当在三个工作日内，更新集合计划招募说明书和产品资料概要，并登载在规定网站上，其中产品资料概要还应当登载在集合计划销售机构网点或营业网点；集合计划招募说明书、产品资料概要其他信息发生变更的，集合计划管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，除资产管理合同另有约定外，集合计划管理人可以不再更新集合计划招募说明书和产品资料概要。

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

集合计划变更申请经中国证监会批准后，管理人将集合计划招募说明书提示性公告和《资产管理合同》提示性公告登载在规定报刊上，将集合计划招募说明书、产品资料概要、《资产管理合同》和集合计划托管协议登载在规定网站上；托管人应当同时将《资产管理合同》、集合计划托管协议登载在网站上。

（二）《资产管理合同》生效公告

管理人应当在规定媒介上登载《资产管理合同》生效公告。

（三）集合计划净值信息

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

在开始办理集合计划份额申购或者赎回后，管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、集合计划销售机构网站或营业网点，披露开放日的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

的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

#### （四）集合计划份额申购、赎回价格

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

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

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

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

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

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

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

#### （六）临时报告

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

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

- 1、集合计划份额持有人大会的召开及决定的事项；
- 2、《资产管理合同》终止、集合计划清算；
- 3、集合计划扩募、延迟《资产管理合同》期限；
- 4、转换集合计划运作方式、集合计划合并；
- 5、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；
- 6、管理人委托服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托服务

机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项；

7、管理人、托管人的法定名称、住所发生变更；

8、管理人变更持有 5%以上股权的股东、变更实际控制人；

9、集合计划募集期延长或者提前结束募集；

10、管理人的高级管理人员、公开募集性质的集合计划投资经理和托管人专门托管部门负责人发生变动；

11、管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，管理人、托管人专门托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；

12、涉及集合计划财产、集合计划管理业务、集合计划托管业务的诉讼或仲裁；

13、管理人或其高级管理人员、投资经理因集合计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，托管人或其专门托管部门负责人因集合计划托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；

14、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，中国证监会另有规定的情形除外；

15、集合计划收益分配事项；

16、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；

17、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；

18、本集合计划开始办理申购、赎回；

19、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；

20、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；

21、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；

22、管理人采用摆动定价机制进行估值；

23 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；

24、集合计划信息披露义务人认为可能对份额持有人权益或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《资产管理合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对集合计划份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害份额持有人权益的，相关信息

披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

#### （八）集合计划份额持有人大会决议

集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （九）投资资产支持证券的信息披露

管理人应在集合计划年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。

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

#### （十）投资国债期货的信息披露

集合计划管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和更新的招募说明书等文件中披露国债期货的交易情况，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。

#### （十一）清算报告

资产管理合同终止的，集合计划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。

#### （十二）实施侧袋机制期间的信息披露

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

#### （十三）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

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

向管理人进行书面或者电子确认。

管理人、托管人应当在规定报刊中选择披露信息的报刊，单只集合计划只需选择一家报刊。

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

为强化投资者保护，提升信息披露服务质量，集合计划管理人应当按照中国证监会规定向投资者及时提供对其投资决策有重大影响的信息。

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相关规定。前述自主披露如产品信息披露费用，该费用不得从集合计划财产中列支。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，但不得早于规定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

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

#### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

#### 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，管理人和托管人可暂停或延迟披露集合计划相关信息：

- 1、集合计划投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其他情形致使集合计划管理人、集合计划托管人无法准确评估集合计划资产价值时；
- 3、法律法规、《资产管理合同》或中国证监会规定的其他情况。



## 第十七部分

## 侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

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

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

### 二、实施侧袋机制期间集合计划份额的申购与赎回

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

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

3、除管理人应按照主袋账户的份额净值办理主袋账户份额的申购和赎回外，本招募说明书“集合计划份额的申购和赎回”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工作日主袋账户总份额的 10%认定。

### 三、实施侧袋机制期间的集合计划投资

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

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

管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

### 四、实施侧袋机制期间的集合计划估值

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

#### 五、实施侧袋账户期间的集合计划费用

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

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

#### 六、侧袋账户中特定资产的处置变现和支付

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

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

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

#### 七、侧袋机制的信息披露

##### 1、临时公告

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

##### 2、集合计划净值信息

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

##### 3、定期报告

侧袋机制实施期间，管理人应当在集合计划定期报告中披露报告期内侧袋账户相关信息，集

合计划定期报告中的集合计划会计报表仅需针对主袋账户进行编制。会计师事务所对集合计划年度报告进行审计时，应对报告期内集合计划侧袋机制运行相关的会计核算和年度报告披露等发表审计意见。

## 第十八部分

## 风险揭示

本集合计划为债券型集合资产管理计划（公开募集性质的集合产品），长期来看，其预期风险和预期收益水平低于股票型集合计划、混合型集合计划，高于货币型集合计划。

投资人应当认真阅读本集合计划《资产管理合同》、《招募说明书》、产品资料概要等法律文件，了解本集合计划的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本集合计划是否和投资人的风险承受能力相适应，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。

管理人提醒投资人在作出投资决策后，须了解并自行承担以下风险：

本集合计划面临包括但不限于以下风险：

### 一、本集合计划的特有风险

1、本集合计划为债券型集合资产管理计划，债券投资占集合计划资产的比例不低于 80%，因此，本集合计划除承担由于市场利率波动造成的利率风险外还要承担如企业债、公司债等信用品种的发债主体信用恶化造成的信用风险。

2、本集合计划的投资范围包括资产支持证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

（1）信用风险也称为违约风险，它是指资产支持证券参与主体对它们所承诺的各种合约的违约所造成的可能损失。从简单意义上讲，信用风险表现为证券化资产所产生的现金流不能支持本金和利息的及时支付而给投资者带来损失。

（2）利率风险是指资产支持证券作为固定收益证券的一种，也具有利率风险，即资产支持证券的价格受利率波动发生变动而造成的风险。

（3）流动性风险是指资产支持证券不能迅速、低成本地变现的风险。

（4）提前偿付风险是指若合同约定债务人有权在产品到期前偿还，则存在由于提前偿付而使投资者遭受损失的可能性。

（5）操作风险是指相关各方在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

（6）法律风险是指因资产支持证券交易结构较为复杂、参与方较多、交易文件较多，而存在的法律风险和履约风险。

3、本集合计划的投资范围包括国债期货等金融衍生品。投资金融衍生品存在以下风险：

（1）市场风险

由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利情形时，标的证券微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失；场内期权实行当日无负债结算制度，对资金管理要求非常高。价格波动剧烈的时候可能面临追加保证金的问题，如果没有在规定时间内补足保证金，按规定将面临平仓的风险。

### （2）信用风险

对于衍生品交易而言，信用风险发生的概率极小，原因是在进行衍生产品交易时，交易所有一套独特的交易体系，如设立一系列的保证金制度，最低资金要求，逐日盯市结算措施及强行平仓制度等，使整个市场的信用风险下降。但这种由结算公司充当所有投资者的交易对手，并承担履约责任，一旦结算公司出现风险暴露，由于其风险过度集中，在重大风险事件发生时，或风险监控制度不完善时也会发生信用风险。

### （3）杠杆风险

金融衍生品投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本计划可能承受超出保证金甚至本计划财产本金的损失。

4、本集合计划对于每份集合计划份额，设定一个月的滚动运作期。每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能提出赎回申请。故投资者面临在运作期到期日前无法赎回的风险，以及错过当期运作期到期日未能赎回而进入下一运作期的风险。

## 二、债券市场风险

债券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致集合计划收益水平变化，产生风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观经济形势、货币政策和财政政策等发生变化，导致债券价格波动而产生风险。

2、利率风险。利率波动直接影响着债券的价格和收益率，从而影响计划的净值表现。利率波动可能导致债券集合计划跌破面值。在利率波动时，债券集合计划的净值波动一般会高于货币集合计划。

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

4、购买力风险。集合计划的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使集合计划的实际收益下降。

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

6、再投资风险。再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资收益的影响，这与利率上升所带来的价格风险（即前面所提到的利率风险）互为消长。具体为当利率下降时，集合计划从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较少的收益率。

7、债券回购风险。较高的债券正回购比例可能增加组合的流动性风险和利率风险。

8、经济周期风险。证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运作具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

### 三、集合计划共有的风险

1、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和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响集合计划收益水平，造成管理风险。

2、流动性风险。集合计划投资组合中的投资品种会因各种原因面临流动性风险，使证券交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，本集合计划属开放式资产管理产品，在所有开放日管理人都有义务接受投资人的赎回。如果出现巨额赎回的情形，可能造成集合计划仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。

为了克服流动性风险，本集合计划将在坚持分散化投资和精选个券原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但管理人并不保证完全避免此类风险。

### 3、其他风险

- （1）因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- （2）因业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等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、欺诈行为等产生的风险；
- （4）对主要业务人员如投资主办的依赖而可能产生的风险；
- （5）因业务竞争压力可能产生的风险；
- （6）不可抗力可能导致集合计划资产的损失，影响集合计划收益水平，从而带来风险；
- （7）其他意外导致的风险。

### 四、本集合计划法律文件风险收益特征表述与销售机构计划风险评价可能不一致的风险

本集合计划法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本集合计划的长期风险收益特征。销售机构根据相关法律法规对本集合计划进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因

此销售机构的风险等级评价与集合计划法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本集合计划时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

## 五、流动性风险评估

### (1) 本集合计划的申购、赎回安排

本集合计划采用开放方式运作，管理人在开放日办理集合计划份额的申购，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或资产管理合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。具体业务办理时间在申购赎回开始公告中规定。

### (2) 投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本集合计划为债券型集合计划，债券投资占集合计划资产的比例不低于 80%。根据《流动性风险管理规定》的相关要求，本集合计划会审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本集合计划流动性风险也可以得到有效控制。

### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

当单个开放日集合计划的净赎回申请超过集合计划总份额的 10%时，本集合计划将可能无法及时赎回持有的全部集合计划份额，即认为是发生了巨额赎回。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。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。

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份额持有人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2) 部分延期赎回：当管理人认为支付份额持有人的赎回申请有困难或认为因支付份额持有人的赎回申请而进行的财产变现可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作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，份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个工作日继续赎回，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工作日赎回申请一并处理，无优先权并以下一工

作日的集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

若本集合计划发生巨额赎回且单个集合计划份额持有人单个开放日内的集合计划份额赎回申请超过上一工作日集合计划总份额 20%（即“单一巨额赎回申请人”）的情形下，管理人根据本集合计划当时的资产组合状况决定部分延期赎回时，按照保护剩余其他赎回申请人利益的原则，管理人可以优先确认前述剩余其他赎回申请人的赎回申请。如前述剩余其他赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认，则管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日集合计划总份额的 10%的前提下，在仍可接受赎回申请的范围内对单一巨额赎回申请人的赎回申请按比例确认，其余赎回申请参照前段“2）部分延期赎回”的约定方式延期办理；如前述剩余其他赎回申请人的赎回申请未被全部确认，则对全部未确认的赎回申请（含前述剩余其他赎回申请人的其余赎回申请与单一巨额赎回申请人的全部赎回申请）参照前段“2）部分延期赎回”的约定方式延期办理。管理人应当对延期办理的事宜在规定媒介上进行公告。

#### （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

本集合计划在面临大规模赎回的情况下有可能因为无法变现造成流动性风险。如果出现流动性风险，管理人经与托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可实施备用的流动性风险管理工具，作为特定情形下管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停集合计划估值、摆动定价机制、实施侧袋机制以及中国证监会认定的其他措施。同时管理人应时刻防范可能产生的流动性风险，对流动性风险进行日常监控，保护持有人的利益。当实施备用的流动性风险管理工具时，有可能无法按合同约定的时限支付赎回款项。

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,集合计划业绩指标应当以主袋账户资产为基准,因此本集合计划披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

## 第十九部分 集合资产管理合同的变更、终止和 集合计划财产的清算

### 一、《资产管理合同》的变更

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

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

### 二、《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

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

### 三、集合计划财产的清算

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

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

- (1) 《资产管理合同》终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管集合计划；
- (2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

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

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、集合计划财产清算的公告

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

#### 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。

## 第二十部分

## 集合资产管理合同的内容摘要

### 一、资产管理合同当事人及权利义务

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

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

(3) 销售集合计划份额；

(4) 按照规定召集集合计划份额持有人大会；

(5) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定监督托管人，如认为托管人违反了《资产管理合同》及国家有关法律的规定，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及相关当事人的利益；

(6) 在托管人更换时，提名新的托管人；

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

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

(9) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；

(10) 在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

(11) 依照法律法规为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利；

(12) 在法律法规允许的前提下，为集合计划的利益依法为集合计划进行融资；

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

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

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

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

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

(2) 办理集合计划备案手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受托管人的监督；

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

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

- (6) 在管理人更换时，提名新的管理人；
  - (7) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：
- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；
  - (2) 设立专门的托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉托管业务的专职人员，负责集合计划财产托管事宜；
  - (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保集合计划财产的安全，保证其托管的集合计划财产与托管人自有财产以及不同的集合计划财产相互独立；对所托管的不同的集合计划分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同集合计划之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
  - (4) 除依据《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定外，不得利用集合计划财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管集合计划财产；
  - (5) 保管由管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；
  - (6) 按规定开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《资产管理合同》的约定，根据管理人的投资指令或登记结算机构业务规则，及时办理清算、交割事宜；
  - (7) 保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
  - (8) 复核、审查管理人计算的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购、赎回价格；
  - (9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；
  - (10) 对集合计划财务会计报告、季度、中期和年度集合计划报告出具意见，说明管理人在各重要方面的运作是否严格按照《资产管理合同》的规定进行；如果管理人有未执行《资产管理合同》规定的行为，还应当说明托管人是否采取了适当的措施；
  - (11) 保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；
  - (12) 建立并保存集合计划份额持有人名册；
  - (13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；
  - (14) 依据管理人的指令或有关规定向集合计划份额持有人支付集合计划收益和赎回款项；

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

(16) 按照法律法规和《资产管理合同》、托管协议的规定监督管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

### (三) 集合计划份额持有人的权利与义务

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

每份集合计划份额具有同等的合法权益。

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

(1) 分享集合计划财产收益；

(2) 参与分配清算后的剩余集合计划财产；

(3) 依法转让或者申请赎回其持有的集合计划份额；

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

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

(6) 查阅或者复制公开披露的集合计划信息资料；

(7) 监督管理人的投资运作；



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

(9) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

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

(1) 认真阅读并遵守《资产管理合同》、招募说明书等信息披露文件；

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

(3) 关注集合计划信息披露，及时行使权利和履行义务；

(4) 交纳集合计划申购款项及法律法规和《资产管理合同》、招募说明书所规定的费用；

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

(6) 不从事任何有损集合计划及其他《资产管理合同》当事人合法权益的活动；

(7) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决定；

(8) 返还在集合计划交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(9) 遵守管理人、托管人及销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；

(10) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## 二、集合计划份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

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：

(1) 终止《资产管理合同》；

(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、提高销售服务费率，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

(6) 变更集合计划类别；

(7) 本集合计划与其他集合计划的合并；

(8) 变更集合计划投资目标、范围或策略；

(9) 变更集合计划份额持有人大会议事程序；

(10) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；

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

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

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

(1) 法律法规要求增加的集合计划费用的收取；

(2) 在法律法规和《资产管理合同》规定的范围内调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费率、调整收费方式；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《资产管理合同》进行修改；

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

(5) 集合计划推出新业务或服务；

(6) 调整本集合计划份额类别的设置；

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

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

(二) 会议召集人及召集方式

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

2、管理人未按规定召集或不能召集时，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%）的份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。集合计划份额持有人依法自行召集集合计划份额持有人大会的，管理人、托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

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

（三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

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

(7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

(四) 集合计划份额持有人出席会议的方式

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

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

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

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

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

3、在不与法律法规冲突的前提下, 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。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, 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份额持有人大会并行使表决权, 授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式, 具体方式在会议通知中列明。

## (五) 议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

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

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

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

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

### (2) 通讯开会

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

### (六) 表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## （七）计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

### 2、通讯开会

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

## （八）生效与公告

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

除法律法规另有规定外，集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

#### （九）实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定

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

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

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

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

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

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

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

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

同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。



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

### 三、资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算

#### (一) 《资产管理合同》的变更

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

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

#### (二) 《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的, 经履行相关程序后, 《资产管理合同》应当终止:

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

#### (三) 集合计划财产的清算

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

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序:

- (1) 《资产管理合同》终止情形出现时, 由集合计划财产清算小组统一接管集合计划;
- (2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认;

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

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

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 集合计划财产清算的公告

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

#### (七) 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。

### 四、争议的处理和适用的法律

各方当事人同意，因《资产管理合同》而产生的或与《资产管理合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交深圳国际仲裁院根据该院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁的地点在深圳市。仲裁裁决是终局性的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

争议处理期间，资产管理合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护集合计划份额持有人的合法权益。

《资产管理合同》受中国法律管辖。

#### 五、资产管理合同存放地和投资人取得合同的方式

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

## 第二十一部分

## 集合计划托管协议的内容摘要

### 一、集合计划托管协议当事人

#### (一) 管理人

名称：第一创业证券股份有限公司（简称：第一创业）

住所：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 层

邮政编码：518000

法定代表人：吴礼顺

成立日期：1992 年 11 月

批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行银复[1992]608 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：42.024 亿元

存续期间：持续经营

#### (二) 托管人

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

办公地址：上海市银城路 167 号

法定代表人：吕家进

成立日期：1988 年 8 月 22 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复[1988]347 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字[2005]74 号

组织形式：股份有限公司

注册资本：207.74 亿元人民币

存续期间：持续经营

### 二、托管人对管理人的业务监督和核查

(一) 托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同的约定，对集合计划投资范围、投资

对象进行监督。

1、本集合计划将投资于以下金融工具：

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债、地方政府债、可转换债券（含可分离交易的可转债）、可交换债、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及经中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本集合计划不直接投资于股票等权益类资产，但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的股票等权益资产。因上述原因持有的股票，本集合计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

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

本集合计划的投资组合比例为：投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于可转换债券（含可分离交易的可转债）及可交换债券的比例合计不超过集合计划资产的 20%。本集合计划每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后应当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。

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

2、本集合计划不得投资于相关法律、法规、部门规章及资产管理合同禁止投资的投资工具。

对管理人发送的不符合资产管理合同规定的投资指令，托管人可以拒绝执行，并立即书面通知管理人；对于已经执行的投资，托管人发现该投资行为不符合资产管理合同的规定的，托管人应立即书面通知管理人进行整改，并将该情况报告中国证监会。

（二）托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同的约定，对集合计划的下列投资、融资比例进行监督：

（1）本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%；

（2）本集合计划每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后应当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；

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

(4) 本集合计划管理人管理且由本集合计划托管人托管的全部大集合资产管理计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种可以不受此条款规定的比例限制；

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

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

(7) 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%；

(8) 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%；

(9) 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%；

(10) 本集合计划管理人管理且由本集合计划托管人托管的全部大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%；

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

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

(13) 本集合计划总资产不超过集合计划净资产的 140%；

(14) 本集合计划在任何交易日日终，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%；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%；集合计划所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于债券投资比例的有关约定；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 30%；

(15) 法律法规及中国证监会规定的和资产管理合同约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（5）、（6）、（11）项另有约定外，因证券、期货市场波动、证券发行人

合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

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

法律法规或监管部门取消或变更上述限制，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或以变更后的规定为准。

（三）托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同的约定，对本托管协议项下的集合计划投资禁止行为进行监督。

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他集合计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向管理人、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。

法律法规或监管部门取消上述组合限制、禁止行为规定，本集合计划可不受相关限制。法律法规或监管部门对上述组合限制、禁止行为规定进行变更的，本集合计划可以变更后的规定为准。经与托管人协商一致，管理人可依据法律法规或监管部门规定直接对资产管理合同进行变更，该变更无须召开集合计划份额持有人大会审议。

如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，管理人在履行适当程序后，本集合计划可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准。

（四）托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同的约定，对管理人参与银行间债券市场进行监督。

管理人应在集合计划投资运作之前向托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本集合计划适用的银行间债券市场交易对手名单，并约定各交易对手所适用的交易结算方式。管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。托管人监督管理人是否按事前提提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易，如管理人在集合计划首次投资银行间债券市

场之前仍未向托管人提供银行间债券市场交易对手名单的，视为管理人认可全市场交易对手。管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单及结算方式进行更新，新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。如管理人根据市场情况需要临时调整银行间债券市场交易对手名单及结算方式的，应向托管人说明理由，并在与交易对手发生交易前3个工作日内与托管人协商解决。

管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责处理因交易对手不履行合同而造成的纠纷，托管人不承担由此造成的任何法律责任及损失。若未履约的交易对手在托管人与管理人确定的时间前仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，管理人有权向相关交易对手追偿，托管人应予以必要的协助与配合。托管人根据银行间债券市场成交单对本集合计划银行间债券交易的交易对手及其结算方式进行监督。如托管人发现管理人没有按照事先约定的交易对手或交易方式进行交易时，托管人应及时书面或以双方认可的其他方式提醒管理人，经提醒后仍未改正，造成集合计划财产损失的，托管人不承担由此造成的相应损失和责任。如果托管人未能切实履行监督职责，导致集合计划出现风险或造成集合计划资产损失的，托管人应承担相应责任。

#### （五）托管人对集合计划投资银行存款进行监督。

管理人、托管人应当与存款银行建立定期对账机制，确保集合计划银行存款业务账目及核算的真实、准确。管理人应当按照有关法规规定，与托管人、存款机构签订相关书面协议。托管人应根据有关相关法规及协议对集合计划银行存款业务进行监督与核查，严格审查、复核相关协议、账户资料、投资指令、存款证实书等有关文件，切实履行托管职责。

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

集合计划投资银行存款的，管理人应根据法律法规的规定及资产管理合同的约定，确定符合条件的所有存款银行的名单，并及时提供给托管人，托管人应据以对集合计划投资银行存款的交易对手是否符合有关规定进行监督。如管理人在集合计划首次投资银行存款之前仍未向托管人提供存款银行名单的，视为管理人认可所有银行。

因管理人过错需提前支取定期存款而造成集合计划财产的损失由管理人承担。

#### （六）托管人对本集合计划投资流通受限证券的监督。

（1）此处的流通受限证券与本协议提及的流动性受限资产并不完全一致，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市



证券、回购交易中的质押券等流通受限证券。本集合计划投资流通受限证券，还应遵守《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

(2) 管理人投资流通受限证券，应事先根据中国证监会相关规定，明确本集合计划投资流通受限证券的比例，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。托管人对管理人是否遵守相关制度、流动性风险处置预案以及相关投资额度和比例等的情况进行监督。

本集合计划投资流通受限证券前，管理人应向托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，如相关制度、预案、投资额度和比例等。管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至托管人，保证托管人有足够的时间进行审核。

(3) 托管人应按照《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》规定，对管理人是否遵守法律法规进行监督，并审核管理人提供的有关书面信息。托管人认为上述资料可能导致本集合计划出现风险的，有权要求管理人在投资流通受限证券前就该风险的消除或防范措施进行补充书面说明，并保留查看管理人风险管理部门就本集合计划投资流通受限证券出具的风险评估报告等备查资料的权利。否则，托管人有权拒绝执行有关指令。因拒绝执行该指令造成本集合计划财产损失的，托管人不承担任何责任，并有权报告中国证监会。如管理人和托管人无法达成一致，应及时上报中国证监会请求解决。如果托管人切实履行监督职责，则不承担任何责任。

(七) 托管人根据有关法律法规的规定及资产管理合同的约定，对集合计划资产净值计算、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、集合计划宣传推介材料中登载集合计划业绩表现数据等进行监督和核查。

(八) 托管人发现管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、资产管理合同和本托管协议的规定时，应及时采用书面形式并电话提醒的方式通知管理人限期纠正。

管理人应积极配合和协助托管人的监督和核查。管理人收到书面通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给托管人发出回函，就托管人的疑义进行解释或举证，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。

(九) 管理人有义务配合和协助托管人依照法律法规、资产管理合同和本托管协议对集合计划业务执行核查。

对托管人发出的书面提示，管理人应在规定时间内答复并改正，或就托管人的疑义进行解释

或举证；对托管人按照法律法规、资产管理合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送集合计划监督报告的事项，管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

（十）若托管人发现管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反资产管理合同约定的，应当立即通知管理人。

（十一）托管人发现管理人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经托管人提出警告仍不改正的，托管人应报告中国证监会。

（十二）托管人依据有关法律法规的规定、资产管理合同和本协议的约定对于集合计划关联交易进行监督。

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

如法律法规或监管部门取消或变更上述规定的，如适用本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受上述规定限制或适用变更后的规定，无需要经集合计划份额持有人大会审议。

为履行上述信息披露义务，管理人和托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的关联方名单及其更新，加盖公章并书面提交，并确保所提供的关联方名单的真实性、完整性、全面性。名单变更后管理人或托管人应及时发送对方，管理人或托管人于2个工作日内电话或回函确认已知名单的变更。名单变更时间以管理人或托管人收到对方电话或回函确认的时间为准。

### 三、管理人对托管人的业务核查

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

集合计划投资运作等行为。

(二) 管理人发现托管人擅自挪用集合计划财产、未对集合计划财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行管理人资金划拨指令、泄露集合计划投资信息等违反《基金法》、资产管理合同、本托管协议及其他有关规定时，应及时以书面形式通知托管人限期纠正。

托管人应积极配合和协助管理人的监督和核查。托管人收到通知后应在下一工作日前及时核对并以书面形式给管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内，管理人有权随时对通知事项进行复查，督促托管人改正。托管人应积极配合管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复管理人并改正。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，管理人应报告中国证监会。管理人有义务要求托管人赔偿集合计划因此所遭受的损失。

(三) 管理人发现托管人有重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知托管人限期纠正，并要求其将纠正结果报告中国证监会。

管理人基于正当合理理由可定期和不定期地对托管人保管的集合计划财产进行核查。托管人应积极配合管理人的核查行为，包括但不限于：提交相关资料以供管理人核查托管财产的完整性和真实性，在规定时间内答复管理人并改正。

托管人无正当理由，拒绝、阻挠管理人根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经管理人提出警告仍不改正的，管理人应报告中国证监会。

#### 四、集合计划财产的保管

##### (一) 集合计划财产保管的原则

- 1、集合计划财产应独立于管理人、托管人的固有财产。
- 2、托管人应安全、完整地保管集合计划财产，除依据法律法规规定、资产管理合同和本托管协议约定及管理人的正当指令外，不得自行运用、处分、分配集合计划的任何财产。
- 3、托管人按照规定开设集合计划财产的资金账户、证券账户等投资所需账户。
- 4、托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，与托管人的其他业务和其他集合计划的托管业务实行严格的分账管理，确保集合计划财产的完整与独立。
- 5、托管人根据管理人的指令，按照资产管理合同和本托管协议的约定保管集合计划财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6、对于因为集合计划投资产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并

通知托管人，到账日集合计划财产没有到达集合计划账户的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收。由此给集合计划财产造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿集合计划财产的损失，托管人应予以必要的协助与配合，但对此不承担任何责任。

7、不属于托管人实际有效控制下的实物证券的损坏、灭失，托管人不承担责任。

8、除依据法律法规和资产管理合同的规定外，托管人不得委托第三人管理本集合计划财产。

## （二）集合计划银行账户的开立和管理

1、托管人以托管人的名义开设集合计划托管专户，保管集合计划财产的银行存款。该集合计划托管专户同时也是托管人在法人集中清算模式下，代表所托管的包括本集合计划财产在内的所有托管资产与中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登公司”或“中国结算公司”）进行一级结算的专用账户。该账户的开设和管理由托管人承担。本集合计划的一切货币收支活动，均需通过托管人的集合计划托管专户进行。托管人可根据实际情况需要，为本集合计划开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。

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

3、集合计划银行账户的开立和管理应符合银行业监督管理机构的有关规定。

## （三）集合计划证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1、托管人在中登公司上海分公司、深圳分公司为集合计划开立托管人与集合计划联名的证券账户。

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

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

4、托管人以托管人的名义在中登公司开立结算备付金账户，并代表所托管的集合计划完成与中登公司的一级法人清算工作，管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保集合计划、交收价差资金等的收取按照中登公司的规定执行。

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

使用的规定执行。

#### （四）债券托管专户的开设和管理

资产管理合同生效后，托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，以本集合计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司与银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管账户，并代表集合计划进行银行间市场债券的结算。

#### （五）其他账户的开立和管理

1、因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和资产管理合同的规定，由管理人与托管人协商后由托管人负责办理。新账户按有关规定使用并管理。

2、法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

#### （六）集合计划财产投资的有关有价凭证等的保管

集合计划财产投资的有关实物证券等有价凭证由托管人存放于托管人的保管库，也可存入中央国债登记结算有限责任公司、中登公司上海分公司/深圳分公司，保管凭证由托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由托管人根据管理人的指令办理。属于托管人实际有效控制下的实物证券在托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由托管人承担。托管人对由托管人以外机构实际有效控制的证券不承担保管责任。

#### （七）与集合计划财产有关的重大合同的保管

由管理人代表集合计划签署的、与集合计划财产有关的重大合同的原件分别由管理人、托管人保管。除协议另有规定外，管理人在代表集合计划签署与集合计划财产有关的重大合同时，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。管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给托管人，并及时将正本送达托管人处。因管理人发送的合同传真件与事后送达的合同原件不一致所造成的后果，由管理人负责。重大合同的保管期限不低于法律法规规定的最低期限。

对于无法取得二份以上的正本的，管理人应向托管人提供加盖授权业务章的合同传真件，未经双方协商或未在合同约定范围内，合同原件不得转移。

#### （八）特别约定

本集合计划属于对创金稳定收益 1 期集合资产管理计划的规范，本协议生效后，针对以创金稳定收益 1 期集合资产管理计划的名义已经开立的账户，包括但不限于托管账户、证券账户、银行间账户、开放式集合计划账户、存款账户等，管理人与托管人应互相配合，共同完成账户名称及开户资料的变更。

## 五、集合计划资产净值计算和会计核算

### (一) 集合计划资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

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

管理人每个工作日计算集合计划资产净值及集合计划份额净值，经托管人复核，按规定公告。

#### 2、复核程序

管理人每个工作日对集合计划资产进行估值后，将集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人按照规定对外公布。

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

### (二) 集合计划资产估值方法和特殊情形的处理

#### 1、估值对象

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

#### 2、估值方法

##### 1、股票的估值方法

(1) 上市流通的股票，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；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，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在 0.25% 以上的，可参考停牌股票的估值方法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值。

(3) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市

的同一股票的收盘价进行估值。

(4) 流通受限股票（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）按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

## 2、债券估值方法

(1) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（资产管理合同另有约定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，具体估值机构由管理人和托管人协商约定。

(2) 交易所上市交易的可转换债券，按估值日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进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，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进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，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。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 交易所挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(5) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

(6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

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

## 3、国债期货的估值方法

交易所交易的国债期货按估值日交易所公布的当日结算价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的结算价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者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、银行定期存款或通知存款估值方法

银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。

5、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。

6、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。

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

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

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

### （三）估值错误的处理

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

资产管理合同的当事人应按照以下约定处理：

#### 1、估值错误类型

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

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

#### 2、估值错误处理原则

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

（2）估值错误的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错



误的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

### 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

### 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

### 5、特殊情况的处理

(1) 管理人或托管人按估值方法的第 6 项进行估值时，所造成的误差不作为计划份额净值错误处理；

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

## 6、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

### （四）暂停估值的情形

- 1、集合计划投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；
- 3、当特定资产占前一估值日集合计划资产净值 50%以上的，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停估值；
- 4、中国证监会和资产管理合同认定的其它情形。

### （五）集合计划会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

### （六）集合计划账册的建立

管理人进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告。管理人、托管人分别独立地设置、记录和保管本集合计划的全套账册。若管理人和托管人对会计处理方法存在分歧，应以管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到集合计划资产净值的计算和公告的，以管理人的账册为准。

### （七）集合计划财务报表与报告的编制和复核

#### 1、财务报表的编制

集合计划财务报表由管理人编制，托管人复核。

#### 2、报表复核

托管人在收到管理人编制的集合计划财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

#### 3、财务报表的编制与复核时间安排

##### （1）报表的编制

管理人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制；在季度结束之日起 15 个工作日内完成集合计划季度报告的编制；集合计划招募说明书的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新集合计划招募说明书并登载在规定网站上；集合计划招募说明书其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。在上半年结束之日起两个月内完成集合计划中期报告的编制；在每年结束之日起三个月内完成集合计划年度报告的编制。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。

## （2）报表的复核

管理人在月度报表完成当日，将报表盖章后提供给托管人复核；托管人在收到后应在 3 日内进行复核，并将复核结果通过书面或电子确认方式通知管理人。管理人在季度报告完成当日，将有关报告提供给托管人复核，托管人应在收到后 5 个工作日内完成复核，并将复核结果通过书面或电子确认方式通知管理人。管理人在中期报告完成当日，将有关报告提供给托管人复核，托管人应在收到后 15 日内完成复核，并将复核结果通过书面或电子确认方式通知管理人。管理人在年度报告完成当日，将有关报告提供托管人复核，托管人应在收到后 20 日内完成复核，并将复核结果通过书面或电子确认方式通知管理人。具体复核期限可根据情况由双方协商确定以确保相关报告按照监管部门要求及时披露。管理人和托管人之间的上述文件往来均以传真的方式或双方商定的其他方式进行。

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。核对无误后，托管人在管理人提供的报告上加盖业务印鉴或者出具加盖印章的复核意见书，或者进行电子确认，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中国证监会备案。

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

## 六、集合计划份额持有人名册的保管

管理人和托管人须分别妥善保管集合计划份额持有人名册，包括资产管理合同生效日、资产管理合同终止日、集合计划份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、12 月 31 日的集合计划份额持有人名册。集合计划份额持有人名册的内容必须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的集合计划登记机构根据管理人的指令编制和保管，管理人和托管人应按照目前相关规则分别保管集合计划份额持有人名册。保管方式可以采用电子或文档的形式。保管期限不低于法律法规规定的最低期限。

管理人应当及时向托管人提交下列日期的集合计划份额持有人名册：资产管理合同生效日、资产管理合同终止日、集合计划份额持有人大会权益登记日、每年 6 月 30 日、每年 12 月 31 日的集合计划份额持有人名册。集合计划份额持有人名册的内容必须包括集合计划份额持有人的名称和持有的集合计划份额。其中每年 12 月 31 日的集合计划份额持有人名册应于下月前十个工作

日内提交；资产管理合同生效日、资产管理合同终止日等涉及到集合计划重要事项日期的集合计划份额持有人名册应于发生日后十个工作日内提交。

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

## 七、争议解决方式

双方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，协商不能解决的，任何一方有权将争议提交深圳国际仲裁院根据该院届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁的地点在深圳市。仲裁裁决是终局性的，对双方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担，除非仲裁裁决另有决定。

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

本托管协议受中华人民共和国法律管辖。

## 八、托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

本托管协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与资产管理合同的规定有任何冲突。托管协议的变更报中国证监会备案。

### （二）托管协议终止出现的情形

- 1、资产管理合同终止；
- 2、托管人解散、依法被撤销、破产或由其他托管人接管集合计划资产；
- 3、管理人解散、依法被撤销、破产或由其他管理人接管集合计划管理权；
- 4、发生法律法规、中国证监会或资产管理合同及本托管协议规定的终止事项。

### （三）集合计划财产的清算

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

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

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

4、集合计划财产清算程序：

- (1) 资产管理合同终止情形出现时，由集合计划财产清算小组统一接管集合计划；
- (2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对集合计划财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；
- (7) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

(四) 清算费用

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

(五) 集合计划财产清算剩余资产的分配

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

(六) 集合计划财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经托管人进行书面或电子确认复核无误，并经符合《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，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。

## 第二十二部分

## 集合计划份额持有人服务

如本招募说明书存在任何您/贵机构无法理解的内容，请及时通过下述方式联系管理人。请确保投资前，您/贵机构已经全面理解本招募说明书，并同意全部内容。

对集合计划份额持有人的服务主要由管理人及销售机构提供，以下是管理人提供的主要服务内容。管理人根据集合计划份额持有人的需要和市场的变化，有权在符合法律法规的前提下，增加和修改相关服务项目。如因系统、第三方或不可抗力等原因，导致下述服务无法提供，管理人不承担任何责任。

### 一、集合计划份额持有人交易资料的发送服务

#### 1、对账单

管理人至少每个季度以邮寄方式或其他方式向投资者发送对账单。对账单内容应包括投资者持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。

投资者应向管理人提供邮寄地址等资料，因投资者未正常提供以上信息、邮寄运营商系统平台故障及内部操作等原因导致投资者未能获得对账单的，管理人不负担相关责任。

### 二、在线服务

通过管理人网站(<https://www.firstcapital.com.cn>)或客户端，投资人可获得如下服务：

#### 1、查询服务

机构投资者通过管理人网站，个人投资者通过管理人网站、或客户端，可享有集合计划交易查询、账户查询和集合计划信息查询服务。

#### 2、网上交易服务

机构投资者可通过管理人网站，个人投资者可通过管理人网站、或客户端办理开户、申购、赎回及信息查询等业务。有关管理人电子直销具体规则请参见管理人网站相关公告和业务规则。

#### 3、信息资讯服务

投资人可以利用管理人网站等获取集合计划和管理人的各类信息，包括集合计划的法律文件、集合计划公告、定期报告和管理人最新动态等各类最新资料。

#### 4、网上人工服务

投资人可通过管理人网站或客户端获得投资咨询、业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、

信息定制等专项服务。

### 三、客户服务中心电话服务

投资人拨打管理人客服热线 95358 可享有如下服务：

1、自助语音服务：提供 7×24 小时计划净值信息、账户信息等自助查询服务。

2、人工服务：提供每周七天，每日不少于 8 小时的人工服务（法定节假日除外）。投资人可以通过该热线获得投资咨询、业务咨询、信息查询、服务投诉及建议、信息定制等专项服务。

### 四、客户投诉及建议受理服务

投资人可以通过管理人客户服务中心人工热线、在线客服、微客服、书信、电子邮件、短信、传真及各销售机构网点柜台等不同的渠道对管理人和销售机构网点所提供的服务进行投诉或提出建议。



## 第二十三部分 其他应披露事项

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

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-08
2	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-08
3	第一创业证券股份有限公司关于新增第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-09
4	第一创业证券股份有限公司关于新增第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-09
5	第一创业证券股份有限公司关于新增第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-12
6	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-13
7	第一创业证券股份有限公司关于新增第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-19
8	第一创业证券股份有限公司关于新增第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-26
9	第一创业证券股份有限公司关于新增第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-09
10	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划暂停申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-18

11	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划2022年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-20
12	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划2022年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-30
13	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划2023年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-21
14	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划暂停申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-25
15	第一创业证券股份有限公司关于新增第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-10
16	第一创业证券股份有限公司关于新增第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-08
17	第一创业证券股份有限公司关于新增第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-26
18	第一创业证券股份有限公司关于董事长及法定代表人变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-30
19	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划2023年第2季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-21
20	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-26
21	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划2023年中期报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-08-31
22	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划暂停申购及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-09-25
23	第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划2023年第3季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2023-10-25

## 第二十四部分 招募说明书的存放及其查阅方式

依法必须披露的信息发布后，集合计划管理人、集合计划托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所，以供社会公众查阅、复制。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。

## 第二十五部分

## 备查文件

以下备查文件存放在管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

- 1、中国证监会准予创金稳定收益 1 期集合资产管理计划资产管理合同变更并注册的文件；
- 2、《第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《第一创业创和一个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

第一创业证券股份有限公司

2023 年 12 月 8 日