

# 上海海通证券资产管理有限公司

## 海通海升六个月持有期债券型

### 集合资产管理计划

#### 更新招募说明书

#### (2024 年第 1 号)

管理人：上海海通证券资产管理有限公司

托管人：中国农业银行股份有限公司

二〇二四年一月

## 重要提示

海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由海通季季红集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来，原集合计划由管理人依照《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《海通季季红集合资产管理计划资产管理合同》及其他有关规定募集，并于2020年12月18日经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予海通季季红集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2020]3409号）批准。

管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。

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

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

投资有风险，投资人申购集合计划时应当认真阅读本招募说明书。集合计划的过往业绩并不预示其未来表现，管理人管理的其他产品的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。

本集合计划投资于证券、期货市场，集合计划净值会因为证券、期货市场波动等因素产生波动，投资者在投资本集合计划前，需充分了解本集合计划的产品特性，并承担集合计划投资中出现的各类风险，包括：因受到经济因素、政治因素、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而形成的市场风险，由于集合计划投资人连续大量赎回集合计划份额产生的流动性风险，管理人在集合计划管理实施过程中产生的集合计划管理风险，本集合计划的特定风险，操作或技术风险、合规性风险、其他风险等。

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

投资者可申购 A 类份额/C 类份额，且每份 A 类份额/C 类份额均设定 6 个月的锁定持有期，每份 A 类份额/C 类份额在锁定持有期内不办理赎回业务（由红利再投资而来的 A 类份额/C 类份额不受锁定期的限制）。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份 A 类份额/C 类份额自其开放持有期首日起（含）才能办理赎回业务。因此 A 类份额/C 类份额的持有人面临在锁定持有期内不能赎回份额的风险。

原海通季季红集合资产管理计划份额在资产管理合同生效后转换为 A 类份额。

本集合计划的投资范围包括国债期货，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。

本集合计划的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。

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

本更新招募说明书所载内容截止日为 2024 年 1 月 2 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2023 年 9 月 30 日，所披露的投资组合为 2023 年第 3 季度的数据（财务数据未经审计）。

---

---

## 目录

一、 绪言.....	5
二、 释义.....	6
三、 管理人.....	12
四、 托管人.....	23
五、 相关服务机构.....	26
六、 集合计划的历史沿革.....	32
七、 集合计划的存续.....	33
八、 集合计划份额的申购与赎回.....	34
九、 集合计划的投资.....	47
十、 集合计划的业绩.....	59
十一、 集合计划的财产.....	61
十二、 集合计划资产的估值.....	62
十三、 集合计划的收益与分配.....	69
十四、 集合计划的费用与税收.....	71
十五、 集合计划份额的折算.....	74
十六、 集合计划的会计与审计.....	75
十七、 集合计划的信息披露.....	76
十八、 侧袋机制.....	83
十九、 风险揭示.....	86
二十、 资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算.....	91
二十一、 资产管理合同的内容摘要.....	93
二十二、 托管协议的内容摘要.....	110
二十三、 对集合计划份额持有人的服务.....	129
二十四、 其他披露事项.....	130
二十五、 招募说明书的存放及查阅方式.....	131
二十六、 备查文件.....	132

## 一、 绪言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《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》”）和其他有关法律法规的规定，以及《海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”或“资产管理合同”）编写。

本招募说明书阐述了海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）的投资目标、策略、风险、费率等与投资人投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读招募说明书。

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

管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书依据资产管理合同编写，并经中国证监会批准。资产管理合同是约定集合计划当事人之间权利义务的法律文件。招募说明书主要向投资者披露与本集合计划相关事项的信息，是投资者据以选择及决定是否投资于本集合计划的要约邀请文件。投资者自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和资产管理合同的当事人，其持有集合计划份额的行为本身即表明对资产管理合同的承认和接受，并按照《基金法》、资产管理合同及其它有关规定享有权利，承担义务。

投资人欲了解集合计划份额持有人的权利和义务，应详细查阅资产管理合同。

## 二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、集合资产管理计划、集合计划或本集合计划：指海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划

2、管理人：指上海海通证券资产管理有限公司（简称“海通资产管理”）

3、托管人：指中国农业银行股份有限公司

4、集合资产管理计划合同、资产管理合同或《资产管理合同》：指《海通海升六个月持有期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《海通海升六个月持有期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《海通海升六个月持有期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《海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新（资产管理合同关于产品资料概要的编制、披露及更新等内容，将不晚于2020年9月1日起执行）

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对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议第五次通过，经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会议第三十次会议修订，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议第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会议关于修改〈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 日实施的，并经 2020 年 3 月 20 日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

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

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

14、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会

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

17、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

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

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

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

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

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

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

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

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

26、登记机构：指办理登记业务的机构。集合计划的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司或接受上海海通证券资产管理有限公司委托代为办理登记业务的机构

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

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

29、资产管理合同生效日：《海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日，《海通季季红集合资产管理计划资产管理合同》同日失效

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

31、存续期：指《海通季季红集合资产管理计划资产管理合同》生效至《海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》终止之间的期限

32、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

33、锁定持有期：对于每份 A 类份额/C 类份额，锁定持有期指自资产管理合同生效日（对资产管理合同生效日登记在册的 A 类份额/C 类份额而言，下



同)、A 类份额/C 类份额申购申请日(对申购份额而言,下同)或 A 类份额/C 类份额转换转入申请日(对转换转入份额而言,下同)起(含,即锁定持有期起始日),至资产管理合同生效日、A 类份额/C 类份额申购申请日或 A 类份额/C 类份额转换转入申请日次六个月的月度对日的前一日(即锁定持有期到期日)止(含)之间的期间,若该月度对日为非工作日或不存在对应日期的,则顺延至下一个工作日。在锁定持有期内不办理 A 类份额/C 类份额赎回及转换转出业务,由红利再投资而来的 A 类份额/C 类份额不受锁定持有期限限制

34、开放持有期:对于每份 A 类份额/C 类份额,自锁定持有期结束后即进入开放持有期,自其开放持有期首日起(含)的开放日可以办理赎回及转换转出业务。每份 A 类份额/C 类份额的开放持有期首日为锁定持有期起始日次六个月的月度对日,若该月度对日为非工作日或不存在对应日期的,则顺延至下一个工作日

35、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

36、T+n 日:指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 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》:指中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则及其不时做出的修订

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)超过上一开放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、集合计划份额的类别：指根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将集合计划份额分为不同的类别，各集合计划份额类别代码不同，并分别公布集合计划份额净值和集合计划份额累计净值

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

对于投资者依据原《海通季季红集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的海通季季红集合资产管理计划份额，自资产管理合同生效之日起

投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划 A 类份额。

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

56、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

57、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

58、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

59、侧袋机制：指将本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

60、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

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

### 三、 管理人

#### 一、 管理人概况

本集合计划的管理人为上海海通证券资产管理有限公司，基本信息如下：

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

法定代表人：裴长江

成立日期：2012 年 6 月 26 日

实缴注册资本：22 亿元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：海通证券股份有限公司持股 100%

联系人：苗童

电话：021-23219000

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

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

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

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

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

## 二、主要人员情况

### 1、董事会成员

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

王岗先生，法学硕士、公共管理硕士，从事证券相关工作 13 年。先后在税务机关、证券监管部门及国资运营平台公司任职，2020 年 7 月至 2023 年 10 月任海通证券股份有限公司风险管理部总经理，2023 年 11 月加入上海海通证券资产管理有限公司，任总经理、党总支书记、董事。

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

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

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

### 2、监事

简化宇女士，管理学硕士，从事证券相关工作 15 年。先后担任毕马威华振

会计师事务所（特殊普通合伙）上海分所审计部助理经理，上海证监局副主任科员、主任科员，海通恒运融资租赁（上海）有限公司合规总监等。2022年4月加入海通证券，现任海通证券合规管理部副总经理（主持工作），上海海通证券资产管理有限公司监事。

### 3、公司高管人员

裴长江先生，上海海通证券资产管理有限公司董事长。同前述。

王岗先生，上海海通证券资产管理有限公司总经理。同前述。

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

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

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

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

张承启先生，经济学硕士，从事证券工作13年。2019年12月加入上海海通证券资产管理有限公司。先后担任上海申银万国证券研究所有限公司研究员、上海海通证券资产管理有限公司固定收益研究员、长江养老保险股份有限公司

投资经理、上海光大证券资产管理有限公司投资经理、上海海通证券资产管理有限公司固收研究部总监、固收研究部总监兼权益研究部总监。现任上海海通证券资产管理有限公司总经理助理兼公募固收部总监兼固收研究部总监兼权益研究部总监。

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

#### 4、合规负责人

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

#### 5、本集合计划投资经理

邱博文先生：硕士，拥有 9 年金融从业经验，曾就职于国开证券固定收益部任投资经理兼投顾业务负责人，2018 年 6 月加入上海海通证券资产管理有限公司固收二部，现任公募固收部基金经理。

肖彦女士，北京大学管理学硕士，9 年证券从业经验，曾就职于花旗环球金融亚洲有限公司，2017 年加入海通资管，曾任固定收益部研究员、固定收益三部投资经理，现任公募固收部基金经理。

目前邱博文先生、肖彦女士已通过基金从业资格考试。

#### 6、投资决策委员会成员

胡倩女士，总经理助理兼专户权益部总监兼公募权益部总监。

张承启先生，总经理助理兼公募固收部总监兼固收研究部总监兼权益研究部总监。

钱玲玲女士，公募权益部总监助理。

李夏女士，公募固收部总监助理。

邱博文先生，公募固收部基金经理。

董晖先生，公募固收部基金经理。

钱韬先生，公募固收部基金经理。

董传盛先生，量化部投资经理。

### 三、管理人的职责

- 1、办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理集合计划份额的申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金手续；
- 3、对所管理的不同集合计划资产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照资产管理合同的约定确定集合计划收益分配方案，及时向集合计划份额持有人分配收益；
- 5、进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；
- 6、编制季度报告、中期报告和年度报告；
- 7、计算并公告集合计划净值信息，确定集合计划份额申购、赎回价格；
- 8、办理与集合计划资产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、召集集合计划份额持有人大会；
- 10、保存集合计划资产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以管理人名义，代表集合计划份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、法律法规和中国证监会规定的或《资产管理合同》约定的其他职责。

### 四、管理人承诺

- 1、管理人将根据资产管理合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制全权处理本集合计划的投资。
- 2、管理人不得从事违反《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、《信息披露办法》及其他有关法律法规的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》及其他有关法律法规行为的发生。
- 3、管理人不得从事下列违反《基金法》的行为，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止法律法规规定的禁止行为的发生：
  - （1）违反集合计划份额持有人的利益，将集合计划资产用于向第三人抵押、担保、资金拆借或者贷款，按照国家有关规定进行融资担保的除外；
  - （2）从事有可能使集合计划承担无限责任的投资；



- (3) 从事证券承销行为；
- (4) 违反证券交易业务规则，操纵和扰乱市场价格；
- (5) 违反法律法规而损害集合计划份额持有人利益的；
- (6) 法律、法规及监管机关规定禁止从事的其它行为。

4、管理人将加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责，不从事以下行为：

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

#### 5、集合计划投资经理承诺

- (1) 依照有关法律法规和资产管理合同的规定，本着谨慎的原则为集合计划份额持有人谋取最大利益；
- (2) 不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其它第三人谋取不当利益；
- (3) 不泄漏在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密、尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息；
- (4) 不以任何形式为其它组织或个人进行证券交易。

#### 五、管理人的风险管理体系

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

## 1、风险管理原则

管理人风险管理体系的构建将严格遵循以下原则：

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

和稳固的基础上，内部风险控制应与公司公募业务发展放在同等地位上。

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

## 2、风险管理组织架构

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

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

①公司董事会为公募业务风险管理的最高决策机构。

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

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

中国证监会等。

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

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

### 3、风险管理内容

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

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

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

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

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

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

## 六、管理人的内部控制制度

### 1、内部控制的目标

(1) 确保公司经营运作严格遵守国家有关法律、法规和行业监管规则，自

觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念。

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

(3) 建立行之有效的风险控制体系，保障公司资产及客户资产的安全完整，维护公司股东的合法权益，并最大限度地保护投资者的合法权益。

(4) 确保公司业务记录、财务信息和其它信息真实、准确、完整、及时。

(5) 保证公司内部规章制度的贯彻执行，提高公司经营效益。

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

## 2、内部控制的原则

管理人内部控制遵循以下原则：

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

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

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

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

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

## 3、内部控制体系

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

公司应建立贯穿于整个公司相互制衡、权责统一、监管明确的内部控制防线：

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

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

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

#### 4、管理人关于内部合规控制声明书

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

## 四、 托管人

### 一、 托管人情况

#### (一) 基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：谷澍

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：34,998,303.4 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：秦一楠

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服

务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007 年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准（ISAE3402）认证，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2012 年荣获第十届中国财经风云榜“最佳资产托管银行”称号；2013 年至 2017 年连续荣获上海清算所授予的“托管银行优秀奖”和中央国债登记结算有限责任公司授予的“优秀托管机构奖”称号；2015 年、2016 年荣获中国银行业协会授予的“养老金业务最佳发展奖”称号；2018 年荣获中国基金报授予的公募基金 20 年“最佳基金托管银行”奖；2019 年荣获证券时报授予的“2019 年度资产托管银行天玑奖”称号；2020 年被美国《环球金融》评为中国“最佳托管银行”；2021 年荣获全国银行间同业拆借中心首次设立的“银行间本币市场优秀托管行”奖；2022 年在权威杂志《财资》年度评选中首次荣获“中国最佳保险托管银行”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，目前内设风险合规部/综合管理部、业务管理部、客户一部、客户二部、客户三部、客户四部、系统与信息管理部、营运管理部、营运一部、营运二部，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## （二）主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工近 283 名，其中具有高级职称的专家 60 名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## （三）托管业务经营情况

截止到 2023 年 9 月 30 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 831 只。

## 二、托管人的内部风险控制制度说明

### （一）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，保证集合计划财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护集合计划份额持有人的合法权益。

## （二）内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作，对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，独立行使监督稽核职权。

## （三）内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理实行严格的复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

## 三、托管人对管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、资产管理合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统，每日登录监控系统监督管理人的投资运作，并通过集合计划资金账户、管理人的投资指令等监督管理人的其他行为。

当集合计划出现异常交易行为时，托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

（一）电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示管理人；

（二）书面警示。对本集合计划投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对管理人进行提示；

（三）书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关管理人并报中国证监会。

## 五、相关服务机构

### 一、集合计划销售机构：

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

##### （1）直销柜台

名称：上海海通证券资产管理有限公司

注册地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 3 2 层 01-12 室单元

法定代表人：裴长江

成立日期：2012 年 6 月 26 日

实缴注册资本：22 亿元人民币

股东名称、股权结构及持股比例：海通证券股份有限公司持股 100%

电话：021-23219000

##### （2）网上交易平台

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

#### 2、其他销售机构：

##### （1）海通证券股份有限公司

法定代表人：周杰

住所：上海市广东路 689 号

客户服务电话：95553

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

##### （2）交通银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：任德奇

客户服务电话：95559

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

##### （3）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：[田国立](#)

客户服务电话：95533

公司网站：<http://www.ccb.com>

(4) 中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：谷澍

客户服务电话：95599

公司网站：<http://www.abchina.com/cn>

(5) 宁波银行股份有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

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

(6) 上海农村商业银行股份有限公司

住所：上海市黄浦区中山东二路 70 号

法定代表人：徐力

客户服务电话：021-962999

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

(7) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客服电话：95021

网址：[fund.eastmoney.com](http://fund.eastmoney.com)

(8) 京东肯特瑞基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西三旗建材城中路 12 号 17 号平房 157

法定代表人：李骏

客服电话：95118

网址：[jr.jd.com](http://jr.jd.com)

(9) 上海云湾基金销售有限公司

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

法定代表人：冯轶明

客户服务电话：4008201515

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

(10) 北京新浪仓石基金销售有限公司

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

法定代表人：穆飞虎

客户服务电话：400-052-0066

公司网址：[finance.sina.com.cn](http://finance.sina.com.cn)

(11) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：杭州市文二西路1号903室

法定代表人：吴强

客服电话：952555

网址：[fund.10jqka.com.cn](http://fund.10jqka.com.cn)

(12) 北京雪球基金销售有限公司

住所：北京市朝阳区创远路34号院6号楼15层1501室

法定代表人：钟斐斐

客户服务电话：400-159-9288

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

(13) 北京植信基金销售有限公司

住所：北京市密云区兴盛南路8号院2号楼106室-67

法定代表人：王军辉

客户服务电话：4006-802-123

公司网站：[www.zhixin-inv.com](http://www.zhixin-inv.com)

(14) 北京度小满基金销售有限公司

住所：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼1层103室

法定代表人：盛超

客户服务电话：95055-4

公司网站：www.duxiaomanfund.com

（15）上海陆金所基金销售有限公司

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

法定代表人：陈祎彬

客服电话：400-866-6618

网站：www.lu.com

（16）上海好买基金销售有限公司

住所：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

公司网址：www.ehowbuy.com

（17）上海万得基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦

法定代表人：宋晓言

客户服务电话：021-51327185

公司网址：www.520fund.com.cn

（18）珠海盈米基金销售有限公司

住所：珠海市横琴新区环岛东路 3000 号 2719 室

法定代表人：肖雯

客户服务电话：020-89629066

公司网址：www.yingmi.cn

（19）北京汇成基金销售有限公司

住所：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 4 层 401-2

法定代表人：王伟刚

客服电话：400-619-9059

网站：www.hcfunds.com

(20) 北京中植基金销售有限公司

住所：北京市北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

法定代表人：武建华

客户服务电话：400-8980-618

公司网址：www.chtfund.com

(21) 上海利得基金销售有限公司

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

法定代表人：李兴春

客户服务电话：4000325885400-032-5885

公司网站：leadfund.com.cn

(22) 中证金牛（北京）基金销售有限公司

住所：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

法定代表人：吴志坚

客户服务电话：4008-909-998

公司网站：www.jnlc.com

(23) 上海联泰基金销售有限公司

住所：上海市普陀区曹杨路 2009 弄 88 号 806 室-2

法定代表人：尹彬彬

客户服务电话：400-118-1188

公司网站：www.66liantai.com

(24) 东方财富证券股份有限公司

住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

法定代表人：戴彦

客户服务电话：95357

公司网站：www.xzsec.com

(以上排名不分先后)

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

二、集合计划登记机构：

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

三、律师事务所与经办律师：

名称：上海市通力律师事务所

注册地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

联系电话：021- 31358666

传真：021- 31358600

联系人：丁媛

经办律师：黎明、丁媛

四、审计集合计划财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦  
507 单元 01 室

办公地址：上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11  
楼

联系电话：021-23238888

执行事务合伙人：李丹

经办注册会计师：许康玮、王振华

联系人：许康玮

## 六、集合计划的历史沿革

海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划变更自原大集合“海通季季红集合资产管理计划”（以下简称“原集合计划”）。

原集合计划为限定性集合资产管理计划，2008年10月31日经中国证监会证监许可〔2008〕1245号核准设立，自2008年11月20日起向社会公众发行，2009年1月12日结束募集并于2009年1月19日成立。

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

经中国证监会批准，《海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》自管理人公告的生效之日起生效，《海通季季红集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。



---

---

## 七、集合计划的存续

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

本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期至 2024 年 12 月 31 日。本集合计划后，按照中国证监会相关规定执行。如本集合计划到期后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合计划份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

## 八、集合计划份额的申购与赎回

### 一、申购和赎回场所

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

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

### 二、申购和赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

投资人在开放日办理集合计划份额的申购和/或赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或资产管理合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间在届时相关公告中载明。

资产管理合同生效后，若出现新的证券/期货交易市场、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 A 类份额/C 类份额的申购业务，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。资产管理合同剩余存续期限不足 180 天时，份额的申购届时根据管理人公告办理。

对于申购 A 类份额/C 类份额的锁定持有期到期后，管理人开始办理赎回业务，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。对于每份 A 类份额/C 类份额，其锁定持有期结束后即进入开放持有期，自其开放持有期首日起（含）才可以办理赎回。由红利再投资而来的 A 类份额/C 类份额不受锁定持有期的限制。如果投资人多次申购 A 类份额/C 类份额，则其持有的 A 类份额/C 类计划份额的

## 赎回开放时间可能不同。

原海通季季红集合资产管理计划份额在资产管理合同生效后变更为 A 类份额。

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该类集合计划份额申购、赎回的价格。

### 三、申购与赎回的原则

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

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购与赎回申请可以在管理人规定的时间以内撤销；

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

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

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

### 四、申购与赎回的程序

#### 1、申购和赎回的申请方式

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

#### 2、申购和赎回的款项支付

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

集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；集合计划份额登记机构确

认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，将在法律法规规定的期限内支付赎回款项。正常情况下，投资者赎回（T 日）申请生效后，管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或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。

### 3、申购和赎回申请的确认

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

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

### 五、申购和赎回的数量限制

1、其他销售机构（网点）每个基金账户单笔申购最低金额为 1 元人民币（含申购费），其他销售机构另有规定的，从其规定；管理人直销柜台每个基金账户首次最低申购金额、单笔申购最低金额均为 1 元人民币（含申购费）；通过管理人网上交易平台申购本集合计划时，最低申购金额、定投最低金额均为 1 元人民币（含申购费）。

2、集合计划份额持有人在销售机构赎回时，每次赎回申请不得低于 1 份集合计划份额。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。

3、管理人可以规定投资人首次申购和每次申购的最低金额以及每次赎回的最低份额，具体规定请参见更新的招募说明书。

4、管理人可以规定投资人每个集合计划交易账户的最低集合计划份额余额，具体规定请参见更新的招募说明书。

5、管理人可以规定单个投资人累计持有的集合计划份额上限，具体规定请参见更新的招募说明书，但本集合计划单一投资者持有集合计划份额数不得达到或超过集合计划份额总数的 50%（运作过程中，因集合计划份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外）。

6、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。具体规定请参见相关公告。

7、管理人可以规定本集合计划的总规模上限、当日申购金额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

8、管理人可以规定单个投资人当日申购金额上限，具体规定请参见更新的招募说明书或相关公告。

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

## 六、申购和赎回的价格、费用及其用途

### 1、申购费用

本集合计划 A 类份额在申购时收取申购费用，C 类份额不收取申购费用。本集合计划 A 类份额的申购费率按申购金额进行分档。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。

(1) 本集合计划 A 类份额的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	0.3%
100 万元 ≤ M < 500 万元	0.2%
M ≥ 500 万元	每笔 1000 元

申购费用由申购 A 类份额的投资人承担，不列入集合计划资产，申购费用主要用于本集合计划的市场推广、销售和注册登记等各类费用。

(2) 本集合计划 C 类份额不收取申购费

## 2、赎回费用

本集合计划的赎回费率按持有期限递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回，适用费率按单笔分别计算。

本集合计划 A 类份额、C 类份额赎回费率如下表所示：

持有期限 (N)	赎回费率
N < 7 日	1.5%
7 日 ≤ N	0%

赎回费用由赎回 A 类份额/C 类份额的集合计划份额持有人承担，在 A 类份额持有人赎回 A 类份额/ C 类份额持有人赎回 C 类份额时收取。

对持有期限少于 7 日的投资人收取的赎回费，将全额计入集合计划财产；对持续持有期长于或等于 7 日的投资人不收取赎回费。

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

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

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。

## 七、申购份数与赎回金额的计算方式

### 1、申购份额的计算

本集合计划 A 类份额/C 类份额申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类集合计划份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

#### (1) A 类份额申购份额的计算方式

申购本集合计划的申购费用采用前端收费模式（即申购本集合计划时缴纳

申购费)，投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

①申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方式如下：

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

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

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{申购当日 A 类份额净值}$$

②申购费用为固定金额时，申购份额的计算方式如下：

$$\text{申购费用} = \text{固定金额}$$

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

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日 A 类份额净值}$$

申购份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

例：某投资者投资 10,000 元申购本集合计划 A 类份额，且该申购申请被全额确认，对应的申购费率为 0.3%，假定申购当日 A 类份额净值为 1.2000 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 10,000 / (1 + 0.3\%) = 9,970.09 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 10,000 - 9,970.09 = 29.91 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,970.09 / 1.2000 = 8308.41 \text{ 份}$$

即投资者选择投资 10,000 元申购本集合计划 A 类份额，假定申购当日 A 类份额净值为 1.2000 元，可得到 8308.41 份 A 类份额。

(2) C 类份额申购份额的计算方式：

$$\text{申购份数} = \text{净申购金额} / \text{申购当日 C 类份额净值}$$

例：某投资者投资 10,000 元申购本集合计划 C 类份额，且该申购申请被全额确认，假定申购当日 C 类份额净值为 1.2000 元，则可得到的申购份额为：

$$\text{申购份额} = 10,000 / 1.2000 = 8333.33 \text{ 份}$$

即投资者选择投资 10,000 元申购本集合计划 C 类份额，假定申购当日 C 类份额净值为 1.2000 元，可得到 8333.33 份 C 类份额。

## 2、赎回金额的计算

净赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类集合计划份额净值并扣除相应的费用，净赎回金额单位为元，上述计算结果均按照四舍五入方法，

保留到小数点后两位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用以及管理人，其中：

赎回总金额=赎回份额×赎回当日该类集合计划份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

例 1：某投资者赎回 10,000 份本集合计划 A 类份额，持有时间为 200 日，对应赎回费率为 0%，假设赎回申请当日 A 类份额净值是 1.2000 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.2000=12,000.00 元

即投资者赎回 10,000 份 A 类份额，持有时间为 200 日，假设赎回申请当日 A 类份额净值是 1.2000 元，则其可得到净赎回金额为 12,000.00 元。

例 2：某投资者赎回 10,000 份本集合计划 A 类份额（红利再投资所得份额），假设持有期限为 5 天，对应赎回费率为 1.5%，假设赎回申请当日 A 类份额净值是 1.2000 元，则其可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.2000=12,000 元

赎回费用=12,000×1.5%=180.00 元

净赎回金额=12,000-180=11,820.00 元

即投资者赎回 10,000 份 A 类份额（红利再投资所得份额），持有时间为 5 日，假设赎回申请当日 A 类份额净值是 1.2000 元，则其可得到净赎回金额为 11,820.00 元。

### 3、集合计划份额净值计算

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

T 日某类集合计划份额净值=T 日该类集合计划资产净值/T 日该类集合计划份额的余额数量。集合计划份额净值单位为人民币元，计算结果保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。

T 日的集合计划份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。



4、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。

#### 八、申购与赎回的注册登记

1、投资人申购本集合计划成功后，集合计划注册登记人在 T+1 日为投资人增加权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日起有权赎回该部分集合计划份额。

2、投资人赎回集合计划成功后，集合计划注册登记人在 T+1 日为投资人扣除权益并办理相应的注册登记手续。

3、管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并最迟于开始实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

#### 九、拒绝或暂停申购的情形

发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：

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

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

#### 十、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

发生下列情形时，管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

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

发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应及时报中国证监会备案，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。

#### 十一、巨额赎回的情形及处理方式

## 1、巨额赎回的认定

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

## 2、巨额赎回的处理方式

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

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

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

(3) 如发生单个开放日内单个集合计划份额持有人申请赎回的集合计划份额超过前一开放日的集合计划总份额的 20%时，管理人有权先行对该单个集合计划份额持有人超出 20%以上的部分赎回申请实施延期办理，管理人只接受其集合计划总份额 20%部分作为当日有效赎回申请，而对该单个集合计划份额持有人 20%以内(含 20%)的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述“(1) 全额赎回”或“(2) 部分延期赎回”条款处理，对单个集合计划份额持有人超过集合计划总份额 20%以上的赎回申请延期赎回。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类集合计划份额净值为基

础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。

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

## 十二、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，和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。

## 十三、集合计划转换

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

## 十四、集合计划的非交易过户

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

继承是指集合计划份额持有人死亡,其持有的集合计划份额由其合法的继承人继承;捐赠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。

#### 十五、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标准收取转托管费。

#### 十六、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。

#### 十七、集合计划的冻结和解冻与质押

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

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

#### 十七、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回

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

#### 十八、集合计划份额的转让

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

## 九、集合计划的投资

### 一、投资目标

在控制和分散投资组合风险的前提下，实现集合计划资产长期稳定增值。

### 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，包括债券（国债、金融债券、中央银行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或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，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类资产。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。

本集合计划各类资产的投资比例范围为：投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，集合计划保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会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、久期管理策略

在全球经济的框架下，管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化做出判断，密切跟踪 CPI、PPI、汇率、M2 等利率敏感指标，运用数量化工具，对未来市场利率趋势进行分析与预测，并据此确定合理的债券组合目标久期，通过合理的久期控制实现对利率风险的有效管理。

#### 2、类属配置策略

类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本集合计划通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。

### 3、期限结构配置策略

本集合计划对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析，在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下，确定最优的期限结构。本集合计划期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。

### 4、信用债券投资策略

信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本集合计划将通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析等调查研究，分析违约风险即合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。

本集合计划依靠内部信用评级体系跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估，以此作为个券选择的基本依据。为了准确评估发债主体的信用风险，管理人设计了定性和定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体系遵循从“行业风险”—“公司风险”（公司背景+公司行业地位+企业盈利模式+公司治理结构和信息披露状况+企业财务状况）—“外部支持”（外部流动性支持能力+债券担保增信）—“得到评分”的评级过程。其中，定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析，定量分析主要包括四个方面：盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量信息的分析和研究，它是对定量分析的重要补充，能够有效提高定量分析的准确性。

本集合计划内部的信用评级体系定位为即期评级，侧重于评级的准确性，为信用产品的实时交易提供参考。本集合计划会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪，并快速做出反应，以便及时有效地抓住信用利差变化带来的市场交易机会。

本集合计划所投资的信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于 AA，



并将视经济周期、信用周期的变化，动态调整不同行业、不同评级信用债券的配置比例，在综合考虑信用风险、信用利差、流动性风险等因素的基础上，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。

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

（1）本集合计划投资于 AAA 信用评级的信用债的比例占资产总值的 30%—100%；

（2）本集合计划投资于 AA+信用评级的信用债的比例占资产总值的 0%—70%；

（3）本集合计划投资于 AA 信用评级的信用债的比例占资产总值的 0%—30%，且本集合计划投资的 AA 评级信用债仅为国企信用债；且本集合计划主动投资于单一 AA 评级信用债，其市值不得超过集合计划资产净值的 3%。

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

本集合计划所指信用债包括金融债券（不包括政策性金融债）、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、次级债券等。

#### 5、可转换债券投资策略

本集合计划将结合可转换债券的条款，根据其标的股票股价的波动率水平、分红率、市场的基准利率、可转换债券的剩余期限、当前股价水平等因素，运用 BS 模型以及蒙特卡洛模型等，计算期权价值，从而确定可转换债券的理论价值。本计划将理论价值作为可转换债券投资价值的参考，并与市场真实价格进行比较。如果理论价值显著高于当前价格，说明该可转换债券可能被低估，如果理论价值显著低于当前价格，显示该可转换债券可能被高估。本计划将持续跟踪可转换债券市场的供求变化、流动性以及估值溢价水平，判断转股溢价率和纯债溢价率，从而挑选出具有投资价值的可转换债券。同时，在控制风险的基础上，运用转股策略、条款博弈策略、套利策略等进行投资，获取收益。

本集合计划投资于可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券的比例

占资产总值的 0%-20%。本集合计划主动投资于单一可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券，其市值不得超过集合计划资产净值的 3%。

#### 6、资产支持证券投资策略

本集合计划投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和资产管理合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### 7、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，根据风险管理的原则，以套期保值为目的，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证集合计划资产安全的基础上，力求实现所资产的长期稳定增值。

### 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）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，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，其市值不得超过集合计划资产净值的 10%；
- （4）管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；
- （5）本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过集合计划资产净值的 10%；
- （6）本集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产

净值的 20%;

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

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

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

(10) 本集合计划进行债券正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;

(11) 本集合计划的资产总值不得超过资产净值的 140%;

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

(13) 本集合计划投资国债期货,遵循以下投资比例限制:

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,持有的买入国债期货合约价值与有价证券市值之和不得超过集合计划资产净值的 95%;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%;本集合计划所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合资产管理合同关于债券投资比例的有关约定;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%;

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

限资产的投资；

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

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述第(2)、(9)、(14)、(15)项外，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或资产管理合同另有约定的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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

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

## 2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

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

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

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

#### 五、业绩比较基准

中债综合财富（总值）指数收益率 $\times$ 90%+1年期定期存款利率（税后） $\times$ 10%。

本集合计划选择上述业绩比较基准的原因为本集合计划是通过债券资产的配置和个券的选择来增强债券投资的收益。中债综合财富（总值）指数由中央国债登记结算有限公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。指数涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性，适合作为市场债券投资收益的衡量标准；由于本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，集合计划保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计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90%作为业绩比较基准中债券投资所代表的权重，10%作为现金资产所对应的权重可以较好的反映本集合计划的风险收益特征。

若未来法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本集合计划的业绩基准的指数，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布时，本集合计划管理人在与托管人协商一致并在按照监管部门要求履行适当程序后，可调整或变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开集合计划份额持有人大会。

#### 六、风险收益特征

本集合计划属于债券型集合资产管理计划，预期风险和收益水平低于股票型集合资产管理计划、股票型基金、混合型集合资产管理计划和混合型基金、高于货币型集合资产管理计划和货币市场基金。

#### 七、管理人代表集合计划行使股东或债权人权利的处理原则及方法

1、管理人按照国家有关规定代表集合计划独立行使股东或债权人权利，保

护集合计划份额持有人的利益；

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

#### 八、侧袋机制的实施和投资运作安排

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

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

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

#### 九、集合计划投资组合报告（未经审计）

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

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

本投资组合报告所载数据取自海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告，所载数据截至 2023 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

#### 1、报告期末集合计划资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,228,320,597.81	98.59
	其中：债券	1,228,320,597.81	98.59
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	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	17,481,882.00	1.40
8	其他资产	86,582.20	0.01
9	合计	1,245,889,062.01	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

注：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

注：本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

## 3、期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

注：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	2,030,803.84	0.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	121,048,138.35	10.89
	其中：政策性金融债	60,895,796.43	5.48
4	企业债券	276,113,902.45	24.83
5	企业短期融资券	4,012,466.67	0.36
6	中期票据	537,412,788.55	48.33
7	可转债（可交换债）	64,284,287.75	5.78
8	同业存单	-	-
9	其他	223,418,210.20	20.09
10	合计	1,228,320,597.81	110.47

5、报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	1928031	19 广发银行永续债	370,000	37,617,596.72	3.38
2	2028006	20 邮储银行永续债	360,000	37,136,213.11	3.34
3	230201	23 国开 01	300,000	30,423,270.49	2.74
4	2028051	20 浦发银行永续债	280,000	30,122,476.71	2.71

5	102103104	21 宜兴城投 MTN002	280,000	28,950,887.67	2.60
---	-----------	-------------------	---------	---------------	------

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

注：本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占集合计划资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本集合计划本报告期末未持有权证。

9、报告期末本集合计划投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

无。

(2) 报告期末本集合计划投资的国债期货持仓和损益明细

注：本集合计划本报告期末未持有国债期货。

(3) 本期国债期货投资评价

略。

10、投资组合报告附注

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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，广发银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局、税务局、工商局的处罚；中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、中国证监会、国家外汇管理局、税务局、工商局的处罚；国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、税务局的处罚；上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行、国家外汇管理局、中国银行间市场交易商协会、税务局、安监局、住建部的处罚；长沙麓山投资控股集团有限公司在报告编制日前一年内曾受到税务局的处



罚。

本集合计划对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及产品合同的要求。

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

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	52,342.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	34,240.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	86,582.20

(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	127005	长证转债	6,325,615.07	0.57
2	110075	南航转债	5,935,958.36	0.53
3	127038	国微转债	5,456,747.96	0.49
4	132018	G 三峡 EB1	5,437,204.89	0.49
5	127064	杭氧转债	4,950,330.14	0.45
6	123107	温氏转债	3,973,746.85	0.36
7	113044	大秦转债	3,178,906.03	0.29
8	110084	贵燃转债	2,964,488.90	0.27
9	127058	科伦转债	2,945,694.25	0.26
10	113066	平煤转债	2,804,910.81	0.25
11	113062	常银转债	1,883,160.55	0.17
12	110091	合力转债	1,817,070.00	0.16
13	110061	川投转债	1,795,815.07	0.16
14	127027	能化转债	1,767,055.07	0.16
15	110093	神马转债	1,763,385.62	0.16
16	127017	万青转债	1,694,597.26	0.15
17	113061	拓普转债	1,455,482.33	0.13
18	110073	国投转债	1,367,025.04	0.12
19	127018	本钢转债	978,294.79	0.09
20	113049	长汽转债	904,286.03	0.08
21	110087	天业转债	774,267.12	0.07
22	110045	海澜转债	383,413.56	0.03

23	113639	华正转债	370,691.92	0.03
24	110079	杭银转债	116,397.67	0.01
25	127040	国泰转债	113,951.37	0.01
26	127016	鲁泰转债	113,059.18	0.01
27	127056	中特转债	109,698.90	0.01
28	127071	天箭转债	24,112.58	0.00
29	127063	贵轮转债	16,010.19	0.00
30	128132	交建转债	12,999.58	0.00
31	113631	皖天转债	12,584.84	0.00
32	113047	旗滨转债	11,979.77	0.00
33	128136	立讯转债	11,120.29	0.00

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本集合计划本报告期末未持有股票。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## 十、集合计划的业绩

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

本集合计划合同变更生效日为 2021 年 1 月 14 日，集合计划业绩截止日为 2023 年 9 月 30 日。

### 一、集合计划份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 海通海升六个月持有 A

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
合同变更生效日至 2021 年 12 月 31 日	3.35%	0.09%	4.32%	0.04%	-0.97%	0.05%
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	0.40%	0.08%	3.12%	0.05%	-2.72%	0.03%
2023 年 1 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	3.43%	0.05%	3.11%	0.04%	0.32%	0.01%
合同变更生效日至 2023 年 9 月 30 日	7.32%	0.08%	10.92%	0.04%	-3.60%	0.04%

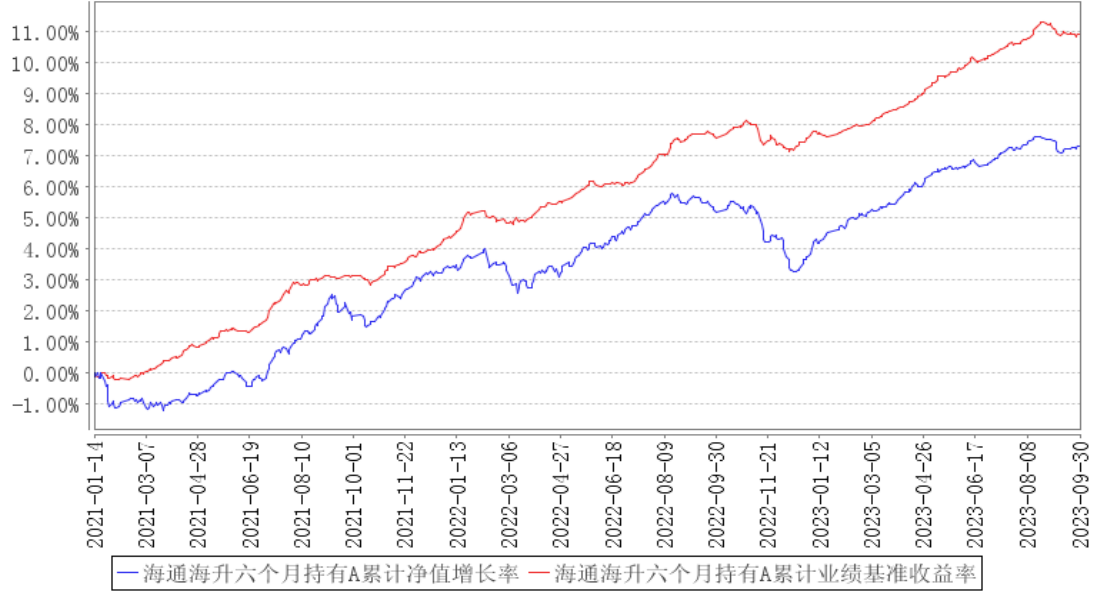
#### 海通海升六个月持有 C

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
合同变更生效日至 2021 年 12 月 31 日	3.06%	0.09%	4.32%	0.04%	-1.26%	0.05%
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	0.11%	0.08%	3.12%	0.05%	-3.01%	0.03%
2023 年 1 月 1 日至 2023 年 9 月 30 日	3.20%	0.05%	3.11%	0.04%	0.09%	0.01%
合同变更生效日至	6.47%	0.08%	10.92%	0.04%	-4.45%	0.04%

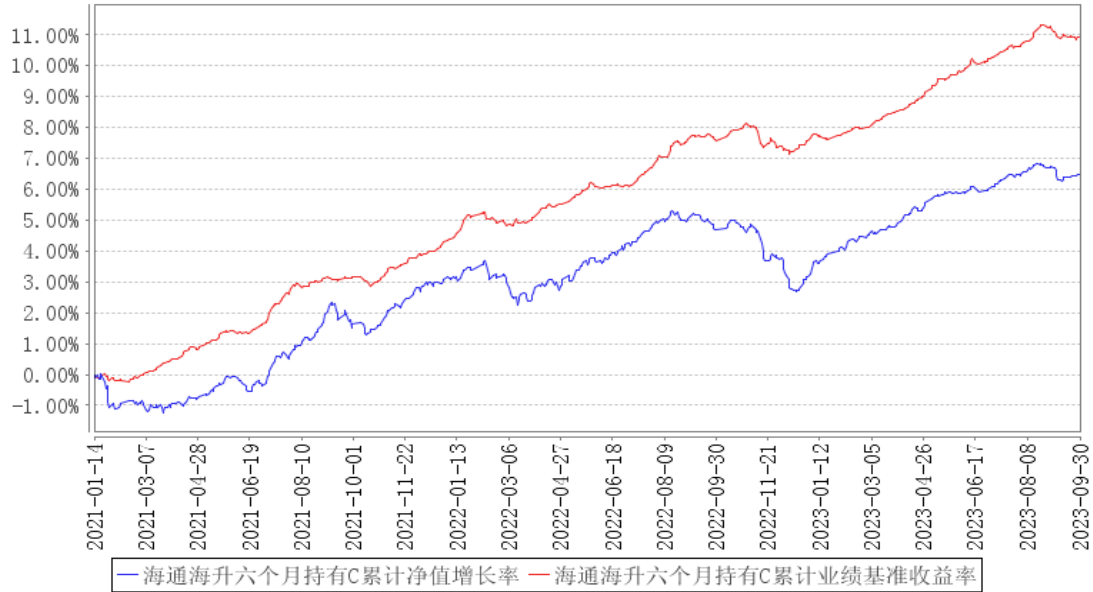
2023年9月30日

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

海通海升六个月持有A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



海通海升六个月持有C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



---

---

## 十一、集合计划的财产

### 一、集合计划资产总值

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

### 二、集合计划资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去集合计划负债后的价值。

### 三、集合计划财产的账户

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

### 四、集合计划财产的保管和处分

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

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

## 十二、集合计划资产的估值

### 一、估值日

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

### 二、估值对象

集合计划所拥有的各类证券、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

### 三、估值原则

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

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

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

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

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

#### 四、估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

##### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

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

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

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

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

6、中国金融期货交易所上市的国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

7、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。

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

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

每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

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

## 六、估值错误的处理

管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当任一类集合计划份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生估值错误时，视为集合计划份额净值错误。

资产管理合同的当事人应以下约定处理：

### 1、估值错误类型

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

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

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

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他错

误等，因不可抗力原因出现估值错误的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该估值错误取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、估值错误处理原则

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

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

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

(4) 估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式。

(5) 按法律法规规定的其他原则处理估值错误。

## 3、估值错误处理程序

估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

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

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

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

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

4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下：

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

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

(3) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## 七、暂停估值的情形

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

2、因不可抗力致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

3、当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各类集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对各类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 7 项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。

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

## 十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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

## 十三、集合计划的收益与分配

### 一、集合计划利润的构成

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

### 二、集合计划可供分配利润

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

### 三、集合计划收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为 12 次，每份集合计划份额每次集合计划收益分配比例不得低于集合计划收益分配基准日每份集合计划份额可供分配利润的 10%，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；因红利再投资转换的份额类别，与集合计划份额持有人在收益分配基准日持有的份额同属一个类别；如集合计划份额持有人持有多个类别份额的，则根据不同类别收益分配方案分别计算该类别红利再投资份额；

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

4、由于本集合计划 A 类份额和 C 类份额的费用收取方式存在不同，各类集合计划份额对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 四、收益分配方案

集合计划收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、集

合计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

#### 五、收益分配方案的确定、公告与实施

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

#### 六、集合计划收益分配中发生的费用

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

#### 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。

## 十四、集合计划的费用与税收

### 一、集合计划费用的种类

- 1、管理人的管理费；
- 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、诉讼费和仲裁费；
- 6、集合计划份额持有人大会费用；
- 7、集合计划的证券、期货交易费用；
- 8、集合计划的银行汇划费用；
- 9、集合计划的开户费用、账户维护费用；
- 10、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 0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月末，按月支付，托管人与管理人核对一致后，由托管人根据管理人划款指令或者双方约定方式，在月初第 3 个工作日按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。集合计划终止后，依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。

#### 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 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，托管人与管理人核对一致后，由托管人根据管理人划款指令或者双方约定方式，在月初第 3 个工作日按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。集合计划终止后，依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。

### 3、销售服务费

本集合计划 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.3%。

C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值的 0.3%年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，托管人与管理人核对一致后，由托管人根据管理人划款指令或者双方约定方式，在月初第 3 个工作日按照指定的账户路径从计划资产划出。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。销售服务费由管理人代收，管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。

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、《海通季季红集合资产管理计划资产管理合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入集合计划费用的项目。

#### 四、实施侧袋机制期间的集合计划费用

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

#### 五、集合计划税收

本集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。本集合计划在投资、管理和运作过程中涉及的增值税及与增值税相关的附加税费（包括但不限于，城建税、教育费附加及地方教育费附加等）等由集合计划财产及集合计划份额持有人承担，管理人可通过向托管人发送划款指令划付至管理人指定账户并由管理人依据税务部门要求完成相关纳税申报义务。集合计划份额持有人实际获得的产品收益金额将可能会因此减少。

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

---

---

## 十五、集合计划份额的折算

### 一、集合计划份额折算基准日

在资产管理合同生效日或管理人决定的其他日期，管理人可根据市场情况确定折算基准日。

### 二、集合计划份额折算对象

份额折算基准日登记在册的本集合计划份额。

### 三、份额折算频率

不定期。

### 四、集合计划份额折算方式

管理人对本集合计划份额的折算方式，具体见管理人届时发布的相关公告。

### 五、集合计划份额折算期间的集合计划业务办理

为保证集合计划份额折算期间本集合计划的平稳运作，管理人可暂停本集合计划份额的申购或赎回等相关业务，具体见管理人届时发布的相关公告。

### 六、份额折算的公告

管理人应按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告，并报中国证监会备案。

---

---

## 十六、集合计划的会计与审计

### 一、集合计划会计政策

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

### 二、集合计划的年度审计

- 1、管理人聘请与管理人、托管人相互独立的符合《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。

## 十七、集合计划的信息披露

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

### 二、信息披露义务人

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

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

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

三、本集合计划信息披露义务人承诺公开披露的集合计划信息，不得有下列行为：

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

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

本集合计划公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

## 五、公开披露的集合计划信息

公开披露的集合计划信息包括：

（一）集合计划招募说明书、《资产管理合同》、集合计划托管协议、产品资料概要

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

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

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

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

《海通季季红集合资产管理计划资产管理合同》变更为《海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》的申请经中国证监会批准后，管理人应将集合计划招募说明书提示性公告《资产管理合同》提示性公告登载在规定报刊上，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各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。

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

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

遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### （四）集合计划份额申购、赎回价格

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

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

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

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

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

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

管理人应当在集合计划年度报告和中期报告中披露集合计划组合资产情况

及其流动性风险分析等。

#### （六）临时报告

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

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

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

提方式和费率发生变更；

15、任一类集合计划份额净值估值错误达该类集合计划份额净值百分之零点五；

16、本集合计划开始办理申购、赎回；

17、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；

18、本集合计划连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

19、本集合计划暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

20、发生涉及集合计划申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

21、管理人采用摆动定价机制进行估值；

22、调整集合计划份额类别设置；

23、集合计划信息披露义务人认为可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定和资产管理合同约定的其他事项。

#### （七）澄清公告

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

#### （八）集合计划份额持有人大会决议

集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。

#### （九）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）投资资产支持证券的信息披露

管理人在集合计划年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资



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

#### （十一）投资国债期货的信息披露

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

#### （十二）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

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

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

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

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

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

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

### 七、信息披露文件的存放与查阅

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

### 八、暂停或延迟信息披露的情形

当出现下述情况时，管理人和托管人可暂停或延迟披露集合计划相关信息：

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

## 十八、侧袋机制

### 一、侧袋机制的实施条件

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

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

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

### 三、实施侧袋机制期间的集合计划投资

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

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

管理人不得在侧袋账户中进行除特定资产处置变现以外的其他投资操作。

#### 四、实施侧袋机制期间的集合计划估值

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

#### 五、实施侧袋账户期间的集合计划费用

1、本集合计划实施侧袋机制的，主袋账户的管理费、托管费按主袋账户集合计划资产净值作为基数计提；侧袋账户的托管费根据法律法规按侧袋账户集合计划资产净值为基数计提，法律法规对侧袋账户的计提基数等另有规定的，从其规定。

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各类集合计划份额净值和各类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各类侧袋账户份额

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。

## 十九、 风险揭示

### 一、投资本集合计划的风险

#### 1、市场风险

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 2、管理风险

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

管理人和托管人的管理手段和管理技术等因素的变化也会影响集合计划收益水平。

### 3、流动性风险

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

#### (1) 锁定持有期运作模式的流动性风险

投资者可申购A类份额/C类份额，且每份A类份额/C类份额均设置6个月锁定持有期，每份A类份额/C类份额在锁定持有期内不办理赎回及转换转出业务（由红利再投资而来的A类份额/C类份额不受锁定期的限制）。锁定持有期到期后进入开放持有期，每份A类份额/C类份额自其开放持有期首日起（含）才能办理赎回及转换转出业务。因此A类份额/C类份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回集合计划份额的风险。

#### (2) 集合计划申购、赎回安排

本集合计划的申购、赎回安排详见本招募说明书“八、集合计划份额的申购与赎回”章节。

根据法规，当极端情况下需要暂停集合计划资产估值等情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请。所以投资者可能面临集合计划暂停申购及赎回的风险。此外，在本集合计划发生巨额赎回情形时，集合计划份额持有人还可能面临延期赎回或暂停赎回的风险。

#### (3) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

集合计划出现巨额赎回情形下，管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况或巨额赎回份额占比情况决定全部赎回或部分延期赎回。集合计划出现连续巨额赎回情形的，管理人可以暂停赎回，对于已经接受的赎回申请，可以延

缓支付赎回款项。同时，如本集合计划单个集合计划份额持有人在单个开放日申请赎回集合计划份额超过前一开放日集合计划总份额一定比例以上的，管理人有权对其赎回申请实施部分延期办理。

(4) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响  
在市场大幅波动、流动性枯竭等极端情况下发生无法应对投资者巨额赎回的情形时，管理人将以保障投资者合法权益为前提，严格按照法律法规及资产管理合同的规定，谨慎选取延期办理巨额赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停集合计划估值、摆动定价、实施侧袋机制等流动性风险管理工具作为辅助措施。对于各类流动性风险管理工具的使用，管理人将依照严格审批、审慎决策的原则，及时有效地对风险进行监测和评估，使用前经过内部审批程序并与托管人协商一致。在实际运用各类流动性风险管理工具时，投资者的赎回申请、赎回款项支付等可能受到相应影响，管理人将严格依照法律法规及资产管理合同的约定进行操作，全面保障投资者的合法权益。

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

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

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



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

#### 4、本集合计划特定风险

(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%。因此，本集合计划需要承担由于市场利率波动造成的利率风险以及如企业债、公司债等信用品种的发债主体信用恶化造成的信用风险；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险；

##### (2) 国债期货投资风险

本集合计划可投资国债期货，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。

##### (3) 资产支持证券的投资风险

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

##### (4) 流通受限证券的风险

本集合计划可投流通受限证券，因此本集合计划可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

#### 5、操作或技术风险

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

在开放式集合计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的

故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致集合计划份额持有人的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人公司、登记机构、销售机构、证券/期货交易所、证券登记结算机构等等。

#### 6、合规性风险

指集合计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者集合计划投资违反法规及资产管理合同有关规定的风险。

#### 7、其他风险

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

#### 8、资产管理合同到期的风险

本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期至 2024 年 12 月 31 日。本集合计划到期后，按照中国证监会相关规定执行。如本集合计划到期后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合计划份额持有人大会。本集合计划份额持有人将面临在 2024 年 12 月 31 日资产管理合同到期的风险。

## 二、声明

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

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

## 二十、资产管理合同的变更、终止与集合计划财产的清算

### 一、《资产管理合同》的变更

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

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

### 二、《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

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

### 三、集合计划财产的清算

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

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

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

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

#### 四、清算费用

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

#### 五、集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### 六、集合计划财产清算的公告

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

#### 七、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 15 年以上。

## 二十一、 资产管理合同的内容摘要

### 一、 集合计划份额持有人、管理人及托管人的权利义务

#### （一） 集合计划份额持有人的权利义务

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

同一类别每份集合计划份额具有同等的合法权益。

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

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

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

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

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

## (二) 管理人的权利义务

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投资者的利益；

(6) 在托管人更换时，提名新的托管人；

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

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

(9) 依据《资产管理合同》及有关法律的规定决定集合计划收益的分配方案；

(10) 在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；

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

(12) 在法律法规允许的前提下，为集合计划的利益依法为集合计划进行融资；

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

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

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

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

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

(2) 办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金手续；

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

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

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

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

(7) 依法接受托管人的监督；

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

净值信息，确定集合计划份额申购、赎回的价格；

(9) 进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告；

(10) 编制季度报告、中期报告和年度报告；

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

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

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

(14) 按规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

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

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

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

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

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

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

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

(22) 当管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关集合



计划事务的行为承担责任；

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

(24) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(25) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

(三) 托管人的权利义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

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

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

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

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

(5) 提议召开或召集集合计划份额持有人大会；

(6) 在管理人更换时，提名新的管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管集合计划财产；

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

(3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保集合计划财产的安全，保证其托管的集合计划财产与托管人自有财产以及不同的集合计划财产相互独立；对所托管的不同的集合计划分别设置账户，独

立核算，分账管理，保证不同集合计划之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

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

(5) 保管由管理人代表集合计划签订的与集合计划有关的重大合同及有关凭证；

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

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

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

(9) 办理与集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；

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

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

(12) 建立并保存集合计划份额持有人名册；

(13) 按规定制作相关账册并与管理人核对；

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

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

(16) 按照法律法规和《资产管理合同》的规定监督管理人的投资运作；

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

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

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

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

(21) 执行生效的集合计划份额持有人大会的决议；

(22) 法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

## 二、集合计划份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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

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

### (一) 召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开集合计划份额持有人大会：

(1) 终止《资产管理合同》（因不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的除外）；

(2) 更换管理人；

(3) 更换托管人；

(4) 转换集合计划运作方式；

(5) 调整管理人、托管人的报酬标准或提高销售服务费；

(6) 变更集合计划类别；

(7) 本集合计划与其他集合计划的合并；

(8) 变更集合计划投资目标、范围或策略；

(9) 变更集合计划份额持有人大会程序；

(10) 管理人或托管人要求召开集合计划份额持有人大会；

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

(12) 对集合计划当事人权利和义务产生重大影响的其他事项；

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

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

(1) 法律法规要求增加的集合计划费用的收取；

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

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《资产管理合同》进行修改；

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

(5) 在法律法规允许的情况下，且在对现有集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，集合计划推出新业务或服务；

(6) 在符合法律法规规定及本资产管理合同约定、并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，调整本集合计划份额类别的设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整；

(7) 在不违反法律法规及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，管理人、登记机构、销售机构调整有关集合计划申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则；

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

(二) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或《资产管理合同》另有约定外，集合计划份额持有人

大会由管理人召集；

2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集；

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

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

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

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

（三）召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

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

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人的权益登记

日；

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

(5) 会务常设联系人姓名及联系电话；

(6) 出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；

(7) 召集人需要通知的其他事项。

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

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

(四) 集合计划份额持有人出席会议的方式

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

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

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

(2) 经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有集合计划份额的凭证显示，有效的集合计划份额不少于本集合计划在权益登记日集合计划总份额的二分之一（含二分之一）。若到会者在权益登记日代表的有效的集合计划份额少于本集合计划在权益登记日集合计划总份额的二分之一，召集人可以在原公告

的集合计划份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集集合计划份额持有人大会。重新召集的集合计划份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的集合计划份额应不少于本集合计划在权益登记日集合计划总份额的三分之一（含三分之一）。

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

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

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

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

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

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

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

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

#### （五）议事内容与程序

##### 1、议事内容及提案权

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

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

集合计划份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

##### 2、议事程序

###### （1）现场开会

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

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



委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

## （2）通讯开会

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

## （六）表决

集合计划份额持有人所持每份集合计划份额有一票表决权。

集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

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

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

集合计划份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

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

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

## （七）计票

### 1、现场开会

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

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

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

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

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

## 2、通讯开会

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

### (八) 生效与公告

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

集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

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

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

(九) 本部分关于集合计划份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规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、资产管理合同的终止事由、程序与集合计划资产的清算

#### （一）《资产管理合同》的变更

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

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

#### （二）《资产管理合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《资产管理合同》应当终止：

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

#### （三）集合计划财产的清算

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

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

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

#### 4、集合计划财产清算程序：

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

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

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

#### (四) 清算费用

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

#### (五) 集合计划财产清算剩余资产的分配

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

#### (六) 集合计划财产清算的公告

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

#### (七) 集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 15 年以上。

### 四、争议解决方式

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

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

《资产管理合同》受中国法律管辖。

#### 五、资产管理合同的存放地及投资者取得方式

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

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

## 二十二、 托管协议的内容摘要

### 一、 托管协议当事人

#### 1、 管理人：上海海通证券资产管理有限公司

名称：上海海通证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

办公地址：上海市黄浦区广东路 689 号第 32 层 01-12 室单元

法定代表人：裴长江

成立时间：2012 年 6 月 26 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]418 号

经营范围：证券资产管理业务。

注册资本：22 亿元

组织形式：有限责任公司（非自然人投资或控股的法人独资）

存续期间：持续经营

经营范围：证券资产管理业务、发起设立集合资产管理计划及中国证券监督管理委员会批准的其他业务。

#### 2、 托管人：中国农业银行股份有限公司

名称：中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座九层

邮政编码：100031

法定代表人：谷澍

成立时间：2009年1月15日

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]23号

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13号

注册资本：34,998,303.4万元人民币

存续期间：持续经营

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；

办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；结汇、售汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；代理资金清算；各类汇兑业务；代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务；贷款承诺；组织或参加银团贷款；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外汇借款；发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券；外汇票据承兑和贴现；自营、代客外汇买卖；外币兑换；外汇担保；资信调查、咨询、见证业务；企业、个人财务顾问服务；证券公司客户交易结算资金存管业务；证券投资基金托管业务；企业年金托管业务；产业投资基金托管业务；合格境外机构投资者境内证券投资托管业务；代理开放式基金业务；电话银行、手机银行、网上银行业务；金融衍生产品交易业务；经国务院银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

## 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。《资产管理合同》明确约定集合计划投资风格或证券选择标准的，管理人应按照托管人要求的格式提供投资品种池和交易对手库，以便托管人运用相关技术系统，对集合计划实际投资是否符合《资产管理合同》关于证券选择标准的约定进行监督，对存在疑义的事项进行核查。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（国债、金融债券、中央银行票据、地方政府债券、企业债券、公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或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，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类资产。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。

本集合计划各类资产的投资比例范围为：投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，集合计划保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如果法律法规或中国证监会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。

（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，对集合计划的投资组合比例进行监督。托管人按下述比例和调整期限进行监督：

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%；

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

1）本集合计划投资于 AAA 信用评级的信用债的比例占资产总值的 30%-100%；

2）本集合计划投资于 AA+信用评级的信用债的比例占资产总值的 0%-70%；

3）本集合计划投资于 AA 信用评级的信用债的比例占资产总值的 0%-30%，且本集合计划投资的 AA 评级信用债仅为国企信用债；且本集合计划主动投资于单一 AA 评级信用债，其市值不得超过集合计划资产净值的 3%；

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

本集合计划所指信用债包括金融债券（不包括政策性金融债）、公司债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、次级债券等。

本集合计划投资于可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券的比例占资产总值的 0%-20%。本集合计划主动投资于单一可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券，其市值不得超过集合计划资产净值的 3%。

（2）每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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，其市值不得超过集合计划资产



净值的 10%;

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

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

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

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

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

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

(10) 本集合计划进行债券正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;

(11) 本集合计划的资产总值不得超过资产净值的 140%;

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

(13) 本集合计划投资国债期货,遵循以下投资比例限制:

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,持有的买入国债期货合约价值与有价证券

市值之和不得超过集合计划资产净值的 95%；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%；本集合计划所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于债券投资比例的有关约定；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%；

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

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

（16）法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。

除上述第（2）、（9）、（14）、（15）项外，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或资产管理合同另有约定的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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

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

托管人对集合计划投资的监督和检查自《资产管理合同》生效之日起开始。

（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，对本协议投资禁止行为进行监督：

- (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。

根据法律法规有关集合计划从事的关联交易的规定，管理人和托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东或与本机构有其他重大利害关系的公司名单及其更新，并以双方约定的方式提交，确保所提供的关联交易名单的真实性、完整性、全面性。管理人有责任保管真实、完整、全面的关联交易名单，并负责及时更新该名单。名单变更后管理人应及时发送托管人，托管人应及时确认已知名单的变更。如果托管人在运作中严格遵循了监督流程，管理人仍违规进行关联交易，并造成集合计划资产损失的，由管理人承担责任，托管人有权向中国证监会报告。

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承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交管理人董事会审议。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

(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。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。管理人可以每半年对银行间债券市场交易对手名单进行更新，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，应向托管人说明理由，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。管理人收到托管人书面确认后，被确认调整的名单开始生效，新名单生效前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。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，托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督，但不承担交易对手不履行合同造成的损失。如托管人事后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，托管人应及时提醒管理人，托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）托管人根据有关法律法规的规定及《资产管理合同》的约定，对管理人投资银行存款进行监督。

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，建立投资制度、审慎选择存款银行，做好风险控制；并按照托管人的要求配合托管人完成相关业务办理。

（六）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。

如果管理人未经托管人的审核擅自将不实的业绩表现数据印制在宣传推介材料上，则托管人对此不承担任何责任，并将在发现后立即报告中国证监会。

（七）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中违反法律法规和《资产管理合同》的规定，应及时以书面形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。托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反《资产管理合同》约定的，应当立即通知管理人，并报告中国证监会。

（八）管理人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；对托管人按照法规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。

（九）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。

### 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和证券账户等投资所需账户、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。

（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，并将纠正结果报告中国证监会。托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本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、托管人应安全保管集合计划财产。未经管理人依据合法程序作出的合法合规指令，托管人不得自行运用、处分、分配集合计划的任何财产。
- 3、托管人按照规定开设集合计划财产的资金账户和证券账户等投资所需账户。
- 4、托管人对所托管的不同集合计划财产分别设置账户，确保集合计划财产的完整与独立。
- 5、托管人根据管理人的指令，按照《资产管理合同》和本协议的约定保管集合计划财产，如有特殊情况双方可另行协商解决。
- 6、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，托管人对此不承担任何责任。
- 7、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托管集合计划财产。

(二) 集合计划资金账户的开立和管理

- 1、托管人应负责本集合计划的资金账户的开设和管理。
- 2、托管人可以本集合计划的名义在其营业机构开设本集合计划的资金账户，并根据管理人合法合规的指令办理资金收付。本集合计划的银行预留印鉴由托管人保管和使用。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付集合计划收益、收取申购款，均需通过本集合计划的资金账户进行。
- 3、集合计划托管资金账户的开立和使用，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。
- 4、集合计划托管资金账户的开立和管理应符合相关法律法规的有关规定。
- 5、在符合法律法规规定的条件下，托管人可以通过托管人专用账户办理集合计划资产的支付。

### （三）集合计划证券账户的开立和管理

1、托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司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，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、托管人以自身法人名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的集合计划完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，管理人应予以积极协助。结算备付金的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

4、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。

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

### （四）债券托管账户的开设和管理

《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、银行间市场清算所股份有限公司的有关规定，以集合计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司、银行间市场清算所股份有限公司开立债券托管与结算账户，并代表集合计划进行银行间市场债券的结算。管理人和托管人同时代表集合计划签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

### （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，在管理人和托管人商议后开立。新账户按有关规则使用并管理。

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、银行定期存款存单等有价凭证由托管人负责妥善保管，保管凭证由托管人持有。实物证券的购买和转让，由托管人

根据管理人的指令办理。属于托管人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。重大合同的保管期限为《资产管理合同》终止后15年。

### 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及复核程序

##### 1、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，各类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额后得到的集合计划份额净值。集合计划份额净值的计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。

每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。如遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

##### 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，将各类集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人依据《资产管理合同》和相关法律法规的规定对外公布。

#### （二）集合计划资产估值方法和特殊情形的处理

##### 1、估值对象

集合计划所拥有的各类证券、国债期货合约和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

##### 2、估值方法



(1) 证券交易所上市的有价证券的估值

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

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

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

4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

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

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

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

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

3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、

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

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

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

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

(6) 中国金融期货交易所上市的国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

(7) 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。

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

(9) 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見，按照管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布。

### （三）集合计划份额净值错误的处理方式

（1）当集合计划份额净值小数点后4位以内（含第4位）发生差错时，视为集合计划份额净值错误；集合计划份额净值出现错误时，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；错误偏差达到或超过集合计划资产净值的0.25%时，集合计划管理公司应当通报托管人并报中国证监会；错误偏差达到集合计划份额净值的0.50%时，管理人应当公告并报中国证监会备案；当发生净值计算错误时，由管理人负责处理，由此给集合计划份额持有人和集合计划造成损失的，应由管理人先行赔付，管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

（2）当集合计划份额净值计算差错给集合计划和集合计划份额持有人造成损失需要进行赔偿时，管理人和托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本集合计划的集合计划会计责任方由管理人担任。与本集合计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按集合计划会计责任方的建议执行，由此给集合计划份额持有人和集合计划造成的损失，由管理人负责赔付。

②若管理人计算的集合计划份额净值已由托管人复核确认后公告，而且托管人未对计算过程提出疑义或要求管理人书面说明，集合计划份额净值出错且造成集合计划份额持有人损失的，应根据法律法规的规定对集合计划份额持有人或集合计划支付赔偿金，就实际向集合计划份额持有人或集合计划支付的赔偿金额，其中管理人承担50%，托管人承担50%。

③如管理人和托管人对集合计划份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布集合计划份额净值的情形，以管理人的计算结果对外公布，由此给集合计划份额持有人和集合计划造成的损失，由管理人负责赔付。

④由于管理人提供的信息错误（包括但不限于集合计划申购或赎回金额等），托管人在履行正常复核程序后仍不能发现该错误，进而导致集合计划份

额净值计算错误而引起的集合计划份额持有人和集合计划财产的损失，由管理人负责赔付。

(3) 由于证券交易所、登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划份额净值计算错误，管理人、托管人可以免除赔偿责任。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。

(4) 管理人和托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护集合计划份额持有人利益的原则进行协商。

#### (四) 暂停估值的情形

(1) 集合计划投资所涉及的证券/期货交易所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》认定的其他情形。

#### (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

管理人应当及时编制并对外提供真实、完整的集合计划财务会计报告。招

募说明书的信息发生重大变更的，管理人应当在三个工作日内，更新招募说明书并登载在规定网站上；招募说明书其他信息发生变更的，管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的，管理人不再更新招募说明书。季度报告应在季度结束之日起15个工作日内编制完毕并予以公告；中期报告在会计年度半年终了后两个月内编制完毕并予以公告；年度报告在会计年度结束后三个月内编制完毕并予以公告。

## 2、报表复核

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，并将复核结果书面通知管理人。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7个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知管理人。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30日内完成复核，并将复核结果书面通知管理人。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45日内完成复核，并将复核结果书面通知管理人。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。

托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，管理人和托管人应共同查明原因，进行调整，调整以双方认可的账务处理方式为准；若双方无法达成一致，以管理人的账务处理为准。核对无误后，托管人在管理人提供的报告上加盖托管业务专用章或者出具加盖托管业务专用章的复核意见书，双方各自留存一份。如果管理人与托管人不能于应当发布公告之日之前就相关报表达成一致，管理人有权按照其编制的报表对外发布公告，托管人有权就相关情况报中国证监会备案。

（八）管理人应每季向托管人提供集合计划业绩比较基准的基础数据和编制结果。

## 六、集合计划份额持有人名册的登记与保管

本集合计划的管理人和托管人须分别妥善保管的集合计划份额持有人名册，包括《资产管理合同》生效日、《资产管理合同》终止日、集合计划权益登记日、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至少应包括持有人的名称和

持有的集合计划份额。

集合计划份额持有人名册由注册登记机构编制，由管理人审核并提交托管人保管。托管人有权要求管理人提供任意一个交易日或全部交易日的集合计划份额持有人名册，管理人应及时提供，不得拖延或拒绝提供。

管理人应及时向托管人提交集合计划份额持有人名册。每年6月30日和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。

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

#### 七、争议解决方式

双方当事人同意，因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，应提交托管人所在地有管辖权的人民法院起诉。

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。

本协议适用中华人民共和国法律并从其解释。

#### 八、集合计划托管协议的变更、终止与集合计划财产的清算

##### （一）托管协议的变更程序

本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后生效。

##### （二）托管协议终止的情形

- 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》规定的终止事项。

(三) 集合计划财产的清算

1、集合计划财产清算小组

(1) 自出现《资产管理合同》终止事由之日起30个工作日内，成立集合计划财产清算小组，管理人组织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) 在集合计划财产清算过程中，管理人和托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《资产管理合同》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。集合计划财产清算小组负责集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、集合计划财产清算程序

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

(2) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；

(3) 对集合计划财产进行估值和变现；

(4) 制作清算报告；

(5) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计；

(6) 聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；

(7) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(8) 对集合计划剩余财产进行分配。

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

4、清算费用

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

5、集合计划财产按下列顺序清偿：

- (1) 支付清算费用；
- (2) 交纳所欠税款；
- (3) 清偿集合计划债务；
- (4) 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。

集合计划财产未按前款（1）—（3）项规定清偿前，不分配给集合计划份额持有人。

6、集合计划财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经符合《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。

7、集合计划财产清算账册及文件的保存

集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存 15 年以上。



## 二十三、对集合计划份额持有人的服务

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

### （一）资料寄送

#### 1、集合计划投资者对账单：

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

#### 2、其他相关的信息资料。

### （二）多种收费方式选择

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

### （三）集合计划电子交易服务

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

### （四）联系方式

上海海通证券资产管理有限公司

咨询电话：021-23219000

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

## 二十四、其他披露事项

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

以下信息披露事项已通过规定信息披露媒介进行公开披露：

序号	公告事项	披露日期
1	海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划更新招募说明书（2023年第1号）	2023/10/20
2	海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划（A类份额）产品资料概要（更新）	2023/10/20
3	海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划（C类份额）产品资料概要（更新）	2023/10/20
4	上海海通证券资产管理有限公司关于增加东方财富证券股份有限公司为旗下部分集合资产管理计划代理销售机构的公告	2023/10/20
5	海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告	2023/10/25
6	上海海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	2023/11/3
7	上海海通证券资产管理有限公司关于投资经理肖彦女士结束休产假恢复履行职务的公告	2023/12/1
8	上海海通证券资产管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	2023/12/26

## 二十五、 招募说明书的存放及查阅方式

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

---

---

## 二十六、备查文件

- （一）中国证监会批准海通季季红集合资产管理计划资产管理合同变更的文件
- （二）海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同
- （三）海通海升六个月持有期债券型集合资产管理计划托管协议
- （四）法律意见书
- （五）管理人业务资格批件、营业执照
- （六）托管人业务资格批件、营业执照
- （七）业务规则
- （八）中国证监会要求的其他文件

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

上海海通证券资产管理有限公司

年 月 日