中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书

集合计划管理人:中信证券股份有限公司
集合计划托管人:中信银行股份有限公司

【重要提示】

中信证券假日理财集合资产管理计划于2013年2月5日开始募集,2013年2月7日成立,2013年3月14日取得《关于中信证券股份有限公司发起设立中信证券假日理财集合资产管理计划的备案确认函》(中证协函【2013】210号)。根据《证券公司大集合资产管理业务适用(关于规范金融机构资产管理业务的指导意见)操作指引》,本集合计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更,并将集合计划名称变更为“中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”,变更后的《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》自集合计划管理人公告的生效之日起生效。

中信证券股份有限公司保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会备案,但中国证监会对本集合计划的备案,并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本集合计划没有风险。投资者应当认真阅读集合计划招募说明书、资产管理合同等信息披露文件,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。

集合计划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财产,但不保证投资于本集合计划一定盈利,也不保证最低收益。当投资人赎回时,所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。如对本招募说明书有任何疑问,应寻求独立及专业的财务意见。

本集合计划投资于证券市场,集合计划净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本集合计划前,应全面了解本集合计划的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,并承担集合计划投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于集合计划投资人连续大量赎回集合计划产生的流动性风险,投资者申购、赎回失败的风险,集合计划管理人在集合计划管理实施过程中产生的集合计划管理风险,本集合计划的特定风险等等。

本集合计划投资资产支持证券,资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。本公司将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资,请集合计划份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的集合计划净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。

本集合计划为债券型集合计划,其风险收益水平低于股票型集合计划和混合型集合计划,高于货币市场型集合计划。

集合计划的过往业绩并不预示其未来表现。集合计划管理人所管理的其它集合计划的业绩并不构成对本集合计划业绩表现的保证。投资人在认购(或申购)本集合计划时应认真阅读本集合计划的招募说明书和资产管理合同。

集合计划招募说明书自资产管理合同生效日起,每六个月更新一次,并于每六个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每六个月的最后一日。

第一部分 绪言

《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《证券公司大集合资产管理业务适用(关于规范金融机构资产管理业务的指导意见)操作指引》和其他有关法律法规与《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“资产管理合同”或“《资产管理合同》”)编写。

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

本招募说明书根据本集合计划的资产管理合同编写,并经中国证监会备案。资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利、义务的法律文件。集合计划投资人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其对资产管理合同的承认和接受,并按照《基金法》、资产管理合同及其他有关规定享有权利、承担义务。集合计划投资人欲了解集合计划份额持有人的权利和义务,应详细查阅资产管理合同。

第二部分 释义

1、集合计划或本集合计划:指中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划
2、集合计划管理人:指中信证券股份有限公司
3、集合计划托管人:指中信银行股份有限公司
4、资产管理合同或《资产管理合同》:指《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》及对资产管理合同的任何有效修订和补充
5、托管协议:指集合计划管理人与集合计划托管人就本集合计划签订之《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6、招募说明书或本招募说明书:指《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及其定期的更新
7、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
8、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施,并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改(中华人民共和国港口法)等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
9、《销售办法》:指中国证监会2013年3月15日颁布、同年6月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
10、《信息披露办法》:指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《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
11、《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
12、《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
13、中国证监会:指中国证券监督管理委员会
14、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
15、资产管理合同当事人:指受资产管理合同约束,根据资产管理合同享有权利并承担义务的法律主体,包括集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划份额持有人
16、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于基金的自然人
17、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
18、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
19、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
20、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者的合称
21、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者
22、集合计划销售业务:指集合计划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
23、销售机构:指中信证券股份有限公司以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与集合计划管理人签订了销售服务协议,办理销售业务的机构
24、登记业务:指集合计划登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资者集合计划账户的建立和管理、集合计划份额登记、销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管集合计划份额持有人名册和办理非交易过户等
25、登记机构:指办理登记业务的机构。集合计划的登记机构为中信证券股份有限公司或接受中信证券股份有限公司委托代为办理登记业务的机构
26、集合计划账户:指登记机构为投资者开立的、记录其持有的、集合计划管理人所管理的集合计划份额余额及其变动情况的账户
27、集合计划交易账户:指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资等业务而引起的集合计划份额变动及结余情况的账户
28、资产管理合同生效日:指根据《证券公司大集合资产管理业务适用(关于规范金融机构资产管理业务的指导意见)操作指引》变更后的《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效日
29、资产管理合同终止日:指资产管理合同规定的资产管理合同终止事由出现后,集合计划财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
30、存续期:指资产管理合同生效至终止之间的期间
31、运作期起始日:对于资产管理合同生效前相应计划份额而言,第一个运作期起始日指资产管理合同生效日;对于每份申购份额而言,第一个运作期起始日指该计划份额申购确认日;对于上一运作期到期日未赎回的每份计划份额的下一运作期起始日,指该计划份额上一运作期到期日后的下一工作日
32、运作期到期日:对于每份计划份额,第一个运作期到期日指资产管理合同生效日(对资产管理合同生效前相应计划份额而言,下同)或计划份额申购申请日(对申购份额而言,下同)满6个月对应的月度对日,第二个运作期到期日为资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满12个月对应的月度对日,第三个运作期到期日为资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满18个月对应的月度对日,以此类推
33、月度对日:指资产管理合同生效日(对资产管理合同生效前相应计划份额而言,下同)或计划份额申购申请日(对申购份额而言,下同)在后续日历月中的对应日期,如没有对应日期或该日为非工作日的,则顺延至下一工作日
34、工作日:指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
35、T日:指销售机构在规定时间受理投资者申购、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),n为自然数
37、开放日:指为投资者办理集合计划份额申购、赎回或其他业务的工作日
38、开放时间:指开放日集合计划接受申购、赎回或其他交易的时间段
39、《业务规则》:指本集合计划登记机构办理登记业务的相应规则
40、申购:指资产管理合同生效后,投资者根据资产管理合同和招募说明书的规定申请购买集合计划份额的行为
41、赎回:指资产管理合同生效后,集合计划份额持有人按资产管理合同和招募说明书规定的条件要求将集合计划份额兑换为现金的行为
42、集合计划转换:指集合计划份额持有人按照资产管理合同和集合计划管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有集合计划管理人管理的、某一集合计划的集合计划份额转换为集合计划管理人管理的其他集合计划份额的行为
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:指投资者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者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、集合计划应收款项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、指定媒介:指中国证监会指定的用以进行信息披露的媒介
53、集合计划份额的类别:本集合计划分设两类计划份额:A类计划份额和C类计划份额。两类计划份额分设不同的代码,收取不同的销售服务费并分别计算公布集合计划份额净值
54、A类计划份额:指按照【0.3%】年费率计提销售服务费的集合计划份额
55、C类计划份额:指按照【0.01%】年费率计提销售服务费的集合计划份额
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)、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:指当本集合计划份额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,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待
59、不可抗力:指资产管理合同当事人不能预见、不能避免且不能克服、使《资产管理合同》当事人无法全部或部分履行《资产管理合同》的任何事件,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、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易
60、大集合计划:指《证券公司大集合资产管理业务适用(关于规范金融机构资产管理业务的指导意见)操作指引》规范的大集合产品

第三部分 集合计划管理人

一、集合计划管理人概况
名称:中信证券股份有限公司
住所:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:张佑君
设立日期:1995年10月25日
批准设立机关及批准设立文号:中国人民银行银复【1995】313号
组织形式:股份有限公司
注册资本:1211690.840000万人民币
存续期限:持续经营
联系电话:95548
联系人:黄晓龙
股权结构:中信证券股份有限公司为A+H股上市公司。截至2018年12月31日,公司股权结构如下表所示:

股东名称	股份种类	股份数量(股)	占股份总数的比例
A股公众股东	A股	9,838,580,700	81.20%
其中:			
中国中信有限公司	A股	1,999,695,746	16.50%
其他A股股东	A股	7,838,884,954	64.70%
H股公众股东	H股	2,278,327,700	18.80%
合计	–	12,116,908,400	100.00%

二、主要人员情况
1、集合计划管理人董事会、监事会成员、高级管理人员

姓名	主要工作经历
张佑君	本公司董事长、执行董事,公司党委副书记,执行委员会委员。张先生曾于本公司1995年成立时加入本公司,并于2016年1月19日获委任为本公司董事,同期获选担任公司董事长。张先生亦兼任中信集团总经理助理、中信股份总经理助理、中信有限总经理助理、中信证券国际董事长。张先生曾于1996年起任本公司交易部总经理、本公司襄理、副总经理,并于1999年9月至2012年6月获委任本公司董事,2002年5月至2005年10月任本公司总经理;1998年至2001年期间任长盛基金管理有限公司总经理;2005年至2011年期间先后任中信建投证券总经理、董事长;2011年12月至2015年12月任中国中信集团有限公司董事会办公室主任。张先生于1987年获得中国人民大学货币银行学专业经济学学士学位,并于1990年获中央财经大学货币银行学专业经济学硕士学位。
杨明辉	本公司执行董事、总经理,公司党委副书记,执行委员会委员。杨先生于本公司1995年成立时加入本公司,并于2016年1月19日获委任为本公司董事。杨先生亦担任华夏基金董事长、华夏基金(香港)有限公司董事长。杨先生曾任本公司董事、襄理、副总经理;2002年至2005年期间担任中信控股董事、常务副总裁,中信信托董事;于2005年至2007年期间任信诚基金管理有限公司董事长;于2005年至2011年期间任中国建银投资证券有限责任公司执行董事、总裁。1996年10月,杨先生获中国国际信托投资公司(中信集团前身)授予高级经济师职称。杨先生于1982年获华东纺织工学院机械工程系机械制造工艺与设备专业工学学士学位,1985年获华东纺织工学院机械工程系纺织机械专业工学硕士学位。
匡涛	本公司非执行董事。匡先生于2018年加入本公司,并于2018年3月22日获委任为本公司董事,于2018年9月6日正式任职(董事任职资格获监管机构核准)。匡先生亦担任中国人寿保险(集团)公司投资管理部副总经理;匡先生亦兼任中国人寿保险(海外)股份有限公司、国寿投资控股有限公司、上海陆家嘴金融贸易区联合发展有限公司、渤海产业投资基金管理有限公司及汇贤控股有限公司董事。匡先生曾先后在中国计算机软件与技术服务总公司、二十一世纪不动产中国总部、美银美林集团、美国彭博集团工作;2009年6月进入中国人寿保险股份有限公司,曾先后任投资管理部总经理助理、副总经理。匡先生于1995年毕业于哈尔滨工程大学获得学士学位,于1998年毕业于哈尔滨工程大学获得硕士学位,于2005年毕业于美国坦普尔大学获得工商管理硕士学位。
刘克	本公司独立非执行董事。刘先生于2016年加入本公司,并于2016年1月19日获委任为本公司董事。刘先生亦任北京语言大学商学院教授。刘先生于1984年7月至1997年10月在兰州商学院从事教学、科研与管理工作;1997年10月至2001年5月任北京物资学院教授,从事教学、科研与管理工作,任《中国流通经济》杂志社常务副主编。刘先生于1999年4月被评为国务院政府特殊津贴专家,于2000年4月被评为北京市跨世纪优秀人才。刘先生于1984年获西北师范大学外语系文学学士学位,1993年获美国佐治亚大学商学院工商管理硕士学位,2000年获中国人民大学财政金融学院经济学博士学位。
何佳	本公司独立非执行董事。何先生于2016年加入本公司,并于2016年1月19日获委任为本公司董事,于2016年3月23日正式任职(独立董事任职资格获监管机构核准)。何先生亦任南方科技大学领军教授、教育部长江学者讲座教授、中国金融学会常务理事兼学术委员,兼任同方股份有限公司(上交所上市公司)、深圳市新国都技术股份有限公司(深交所创业板上市公司)、中国城通发展集团有限公司(香港联交所上市公司)、东英金融投资有限公司(香港联交所上市公司)、中国中投证券有限责任公司及西藏华钰矿业股份有限公司独立董事。何先生于1991年8月至1999年8月任美国休斯顿大学助理教授、副教授(终身教职),1996年8月至2015年7月任香港中文大学财务学系教授,2001年6月至2002年7月任中国证监会规划发展委员会委员,2001年6月至2002年10月任深交所综合研究所所长,2015年8月至2016年11月任深圳市索菱实业股份有限公司(深交所中小企业板上市公司)独立董事。何先生于1978年毕业于黑龙江大学数学专业(工农兵学员),1983年获上海交通大学计算机科学和决策科学工程专业双硕士学位,1988年获美国宾悉法尼亚大学沃顿商学院金融财务专业博士学位。

(下转A14版)

中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同摘要

【一】资产管理合同当事人及其权利义务

(一) 集合计划管理人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,集合计划管理人的权利包括但不限于:

(1)依法募集资金;

(2)自资产管理合同生效日起,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;

(3)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;

(4)销售集合计划份额;

(5)按照规定召集集合计划份额持有人大会;

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

(7)在集合计划托管人更换时,提名新的集合计划托管人;

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

(9)担任或委托其他符合条件的机构担任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;

(10)依据《资产管理合同》及有关法律规定决定集合计划收益的分配方案;

(11)在《资产管理合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请;

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

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

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

(15)在符合有关法律、法规的前提下,制订和调整有关集合计划申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和定期定额投资等业务规则;

(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,集合计划管理人的义务包括但不限于:

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

(2)办理集合计划备案手续;

(3)自资产管理合同生效日起,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集合计划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)依法接受集合计划托管人的监督;

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

(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集合计划托管人、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集合计划托管人;

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

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

(24)执行生效的集合计划份额持有人大会的决议;

(25)建立并保存集合计划份额持有人名册;

(26)法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

(二) 集合计划托管人的权利与义务

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

(1)自资产管理合同生效日起,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》约定获得集合计划托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;

(3)监督集合计划管理人对本集合计划的投资运作,如发现集合计划管理人有违反《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集合计划投资者的利益;

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

(5)提议召开或召集集合计划份额持有人大会;

(6)在集合计划管理人更换时,提名新的集合计划管理人;

(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,集合计划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集合计划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) 保管由集合计划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,根据集合计划管理人的投资指令,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、审查集合计划管理人计算的集合计划资产净值、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、半年度和年度集合计划报告出具意见,说明集合计划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;如果集合计划管理人有未执行《资产管理合同》规定的行为,还应当说明集合计划托管人是否采取了适当的措施;

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

(12)从集合计划管理人或其委托的登记机构处接收集合计划份额持有人名册;

(13)按规定制作相关账册并与集合计划管理人核对;

(14) 依据集合计划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集合计划托管人、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)按照法律法规和《资产管理合同》的规定监督集合计划管理人的投资运作;

(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管机构,并通知集合计划管理人;

(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)按规定监督集合计划管理人按法律法规和《资产管理合同》规定履行自己的义务,集合计划管理人因违反《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集合计划管理人追偿;

(21)执行生效的集合计划份额持有人大会的决议;

(22)法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。

(三)集合计划份额持有人

集合计划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,集合计划投资者自依据《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)监督集合计划管理人的投资运作;

(8)对集合计划管理人、集合计划托管人、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,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】集合计划份额持有人大会

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,但应当计入出具表决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。

在上述规则的前提下,具体规则以召集人发布的集合计划份额持有人大会通知为准。

(七)计票

1、现场开会

(1)如大会由集合计划管理人或集合计划托管人召集,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集合计划管理人或集合计划托管人召集,但是集合计划管理人或集合计划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。集合计划管理人或集合计划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,集合计划管理人或集合计划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集合计划托管人授权代表(若由集合计划托管人召集,则为集合计划管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。集合计划管理人或集合计划托管人拒派代表对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日之起依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决,在公告集合计划份额持有人大会决议时,必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

集合计划管理人、集合计划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、集合计划管理人、集合计划托管人均有约束力。

(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,如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的,集合计划管理人与集合计划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】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损益后的余额。

(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)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。

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、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。

在不影响投资者利益的情况下,集合计划管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计划收益分配原则,此项调整不需要召开集合计划份额持有人大会,但应于变更实施日前在指定媒介和集合计划管理人网站公告。

(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集合计划管理人拟定,并由集合计划托管人复核,依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告并报中国证监会备案。

(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集合计划份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。

【四】集合计划费用与税收

(一)集合计划费用的种类

1、集合计划管理人的管理费;

2、集合计划托管人的托管费;

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、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、集合计划的证券交易费用;

8、集合计划的银行汇划费用;

9、集合计划的相关账户开户及维护费用;

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、集合计划管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.3%÷当年天数
H为