信息披露 Disclosure

(上接A13版)

947年8月出生,中国国籍。周先生于2010年11月起担任中国注册会计师协会资深会员、中国上市公司协会财务总监专业委员会委员、中国平估师协会咨询委员会委员、周先生兼 4上海复旦张江生物医结股份有限公司(香港联交所上市公司),中国太平洋保险(集 到1股份有限公司(上交所、香港联交所上市公司),顺中整股股份有限公司(深交所上市 公司),中运商运控股股份有限公司(上交所、香港联交所上市公司)的独立董事、高盛高 并证券有限责任公司的独立董事、黑先生是普华永道中天会计师事务所有限公司创始人 之一。首任总经规和主任会计师、曾任普华永道国际会计公司贷款合伙人、上海财经大学 会计学讲师、副教授、教授、香港鑫籍有限公司财务总监、2007年5月至2011年4月任中国证 益会首席会计师。2011年9月至2016年9月任中国证监会国际顾问委员会委员、2011年6月 至2014年5月任普华永道会计师事务所高级顾问。周先生于1983年、1993年分别获上海财 经学院会计学专业经济学硕士及经济学博士学位、于1995年获中国注册会计师资格 公公司营参奉员、胜事、监事会主席、海核西计平局行的有条人、如先生于2018年加、本公 本公司党委委员、监事、监事会主席、稽核审计部行政负责人。刘先生于2018年加人

引,并于2018年6月26日获委任为本公司监事。刘先生于1982年9月参加工作,曾任陕西省 高级人民法院书记员,最高人民检察院书记员,机关团委书记,中国国际信托投资公司法 非部四处主任科员、法律处副处长、中国海洋直升机专业公司襄理,中信集团监察部主任 功理,中信集团党委巡视工作领导小组办公室副主任、监察部副主任、中信集团纪委委员 直属机关纪委书记。 刘先生自2015年9月起任中信集团纪委委员,党委巡视工作领导小线 办公室主任、监察部副主任、直属机关纪委书记。 刘先生现兼任中信出版集团股份有限公 司监事。 刘先生于1991年6月获得中国政法大学法律学专业函授大学本科学历。

可益事。刘先生于1991年6月获得中国政法大学法律学专业的投入学术科学历 本公司监事。郭先生于1999年加入本公司,并于1999年9月26日获委任为本公司监事。郭先 生曾于1988年至1992年期间担任南京国际集装箱装卸有限公司副总会计师,负责公司财 务事务;于1992年至2002年期间担任南京新港高科技股份有限公司董事会秘书,负责董事 会事务及公司信息披露;于2001年1月至2013年1月担任南京新港高科技股份有限公司董 事;于2003年6月至2016年12月担任南京新港的有限公司副总裁,于2001年1月至2017 年1月担任南京臣功制药股份有限公司董事、总经理,现已退休。1993年9月,郭先生获中国 交通部学术资格评审委员会授予会计师证书。郭先生于1988年获得武汉河运专科学校办 运财务会计专业大学专科文凭。

运财务注计专业大学专科文凭。 本公司监事。饶先生于2016年1月19日获委任为本公司监事,于2016年3月23日,何佳先生 正式出任公司独立非执行董事后,正式出任公司监事。饶先生亦担任北京大学法学院教 授博士生导师,北京大学港獲研究中心主任,北京大学港灣合法律研究中心主任,饶先生 亦兼任第十二届全国政协委员、全国人大常委会香港基本法委员会委员、国务院发展研究 中心港獲研究研所长、全国高等教育自学考试法学类专业委员会主任委员及中国民航信 原网络股份有限公司独立监事。饶先生曾任中国生物技术股份有限公司。阳光新业地产股市 公司,独立非执行董事。饶先生于1982年获得北京大学法学硕士学位,曾为华盛顿大学、 组约大学及马克斯一普朗克国际法研究所访问学者。 本公司即任等事。北京总师还教堂师是公司,任于2002年5

本公司职工监事、北京总部证券营业部总经理。雷先生于1995年加入本公司,并于2002年 月30日获委任为本公司监事。雷先生曾担任本公司交易部副总经理、北京北三环中路营业 B总经理, 经纪业务发展与管理委员会董事总经理、财富管理部行政负责人, 合规部董事总经理。雷先生于1994年获得天津市管理干部学院工业企业管理专业大学专科文凭。 本公司邸工监事、北京分公司副总经理、杨先生于1997年加入本公司,并于2005年12日获委任为本公司监事、杨先生曾担任本公司综合管理部副总经理、资金运营部高级裁、综合管理部行政负责人。杨先生于1993年获得中国人民公安大学法律学士学位。

本公司执行委员会委员、投资银行管理委员会主任。马先生于1998年加人本公司,曾指 本公司风险控制部副总经理、债券销售交易部副总经理、交易部副总经理、资本市场部 政负责人、金融行业组负责人、投资银行管理委员会委员。马先生于1994年获得西安3 政负责人、金融行业组负责人、投资银行管理委员会委员。马先生于1994年获得西安交通 大学自办控制专业学士学位、1998年获得中国人民银行总行研究生部货币银行学专业硕 士学位、2012年获得中国人民银行总行研究生部国际金融专业博士学位。 本公司执行委员会委员、股权衍生品业务线行政负责人。薛先生于2000年加人本公司,曾 担任本公司金融产品开发小组经理、研究部研究员、交易与衍生产品业务线产品开发组负 责人、金融市场委员会委员、陈先生现据行中信即货与背岛金融信小城贷款公司董事 先人金融市场委员会委员、陈先生现据行中信即货与背岛金融信小城贷款公司董事 先生于1997年获中国人民大学统计系学士学位,于2000年获中国人民大学统计系硕士学 位、于2006年获中国人民大学统计系博士学位。

远,2000年8代已入下2017年8日, 本公司执行委员会委员、资产管理业务行政负责人。杨先生于1999年加入本公司,曾在 1993年到1996年期间担任韶关大学教师,曾担任本公司交易邢助理交易员、固定收益部交 易员、资产管理业务投资经理、资产管理业务投资主管。杨先生于1993年获南昌大学精组

易员、资产管理则务投资经理、资产管理业务投资主管。杨先生于1993年获南昌大学精雅化工专业学士学位,于1999年获南京大学国民经济学硕士学位。 本公司执行委员会委员、研究部及股票销售交易部负责人。李先生于2001年加入本公司 曾担任研究咨询部(后更名为研究部)分析师、研究部首席分析师、股票销售交易部B角 研究部B角(主持工件)兼股票销售交易部B角(主持工作)。李先生于1999年获清华大学 汽车工程专业学士学位,于2001年获清华大学管理科学与工程专业硕士学位。

汽车工程专业学士学位,于2001年获清华大学管理科学与工程专业级士学位。 本公司执行委员会委员、阔定收益部行政负责人、邹先生于2017年加入本公司、曾担任首都医科大学自武医院外科医师,清海华银国际信柱公司业务经理,年夏证券海淀南路营业郎机会户部经理,华夏证券海淀南路营业即组,中信建设证券周淀设造部行政负责,中信建设证券执行委员会委员兼固定收益符订政负责人,明信建设证券投入。2000年获得中央财发大学临床医学专业学士学位,2000年获得中央财发大学临床医学专业学士学位,2000年获得中央财发大学临床医学专业学生学位,2012年获得中欧国际工商学院EMBA学位。 本公司执行委员会委员、经纪业务发展与管理委员会主任、浙江分公司总经理。李先生于1994年加入本公司,曾担任中国农业银行大连市分行国际业务部村员、申银万国证券大连营业部经营处理,由高证券各处理即组、副总经理。李先生于1992年获允、财营大学经济学学士学位财务资格等业力。7200年获得农北财经大学金融学领出、等。

本公司总司库、财务负责人、资金运营部行政负责人。李先生于1996年加入本公司,曾担任中国国际信托投资公司(后更名为"中国中信集团公司")信息中心国际合作处经理、F 信国际合作公司开发部经理,本公司债券部经理、资金运营部副总经理。李先生现兼任" T证券海外投资有限公司董事,CITIC Securities International USA,LLC董事。李先生 - 1992年获对外经济贸易大学国际金融专业学士学位,于2000年获清华大学MBA硕士等

位。 本公司总工程师、信息技术中心行政负责人。宋先生于2016年加入本公司、曾担任北京 泰克电子技术有限责任公司软件科系长、华夏证券股份有限公司电脑中心总经理、中信 投证券经营决策会委员兼信息技术部分改责人、中国民族证券有限责任公司励总裁、 信建投证券后息技术部部事总经理、宋先生现粮任中信证券信息与量化聚分 (深圳)有 责任公司执行董事、证通股份有限公司董事。宋先生于1987年获北京联合大学电子工程 经日本的规划全部、"依然 本公司首席营销总监、中信期货有限公司党委书记、董事长。张先生于1997年加入本公

等但任上海城市建设学院助教,中国建设银行上海市信托投资公司B股业务部负责人,中 信证券上海B股业务部副总经理。上海复火中路营业۳总经理兼任上海管理总部副总经 理、上海准海中路营业۳总经理,上海管理边部副总经理,上海分公司总经班。张先生的 任中信盈时资产管理有限公司董事、中证期货国际(香港)有限公司董事。张先生于2001 、工程力学专业双学士学位,并于2001年获上海交通大学安泰管理学院工商管理硕士

本公司董事会秘书、公司秘书、董事会办公室行政负责人。郑女士于1997年加人本公司,

是任本公司所究部助理。综合管理部经理,本公司品股上市团队成员。本公司设立董事会为公公室上,郑女士加入董事会办公室,并于2003年至2011年期间担任本公司证券事务代表。郑女士于1996年获得北京大学国际政治专业法学学士学位,于2011年4月获深圳证监 引批准担任公司董事会秘书,并自2011年5月起成为香港特许秘书公会联席成员 本公司投资银行管理委员会委员兼质量控制组负责人、叶先生于2006年12月加入本公 曾任公司投资银行管理委员会委员兼质量控制组负责人、以域IS8组负责人、新三板业 负责人、叶先生于1986年7月获得新工大学(原浙江农业大学)改业经济专业学士学位 1990年7月获得浙江大学(原浙江农业大学)管理学专业硕士学位。

本公司高级管理层成员、金石投资党委书记及总经理。金先生于1997年5月加入本公司,管 任投资银行部副总是理《北京》、投资银行管理委员会委员、金融行业组负责人、装备制造 行业组负责人、并购业务线负责人。金先生于1993年7月获得西安交通大学工业外贸专业 学士学位、1996年7月获得西安交通大学技术经济专业硕士学位。

子工子心,1996年7月於特四女公ш,不足及充态价空业硕工子心。 本公司投资银行管理委员会委员兼金融扩出组负责人,为外先生于1998年4月加人本公 曾任公司投资银行部副总经理(深圳),中信证券国际(香港)董事总经理,公司投资银 管理委员会运营部负责人,资本市场部负责人,交通行业组负责人,华夏基金副总经理 生夏资本总经理,办先生于1996年6 获得厦门大学企业管理专业硕士学位。

本公司高级管理层成员、投资银行管理委员会委员兼基础设施与房地产行业组负责人。高 本生于2004年11月加入本公司,曾任投资银行管理委员会房地产与建筑建材行业组B角 交通行业组B角,基础设施与房地产行业组B角。高先生于1990年7月获得青岛广播电视大 学财务会计专业大专学历,1996年7月获得北京大学国民经济管理专业学士学位,2001年7 月获得首都经济贸易大学企业管理专业学历,2004年7月获得北京交通大学产业经济学专

集合计划投资经理

本集合计划的投资经理为邱丹女士。 本集合计划的投资经理为邱丹女士。 邱丹,女,北京大学经济学硕士,2007年加入中信证券资产管理部,曾从事行业研究、债券研究等工作,现担任多个债券产品的投资主办人,具有较丰富的研究经验,擅长绝对收益理念 的投资 3、投资决策委员会成员 本集合计划采取集体投资决策制度,中信证券股份有限公司资产管理业务公募业务投资

决策委员会的成员包括:主任委员杨冰先生、委员张晓亮先生、刘琦先生、张燕珍女士、郭羽女

)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 (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

和运作集合计观测产; (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 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 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

(9)进行集合计划会计核算并编制集合计划财务会计报告;

(9) 建行集台订划云厅核原开编制集台订划则为云厅核告; (10)编制参度,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)保宁集合计划商业秘密,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

(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

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 (17) 明珠丽安回渠台以初汉以有症民的台项文件以及特任规定的同效面,并且球证汉员者能够按照《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

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 r刀; (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;

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

(26)法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他义务。 四、集合计划管理人承诺

四、集合计划管理人承诺 1、集合计划管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为,并承诺建立健全内 部控制制度,采取有效措施,防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生; 2、集合计划管理人承诺不从事违反《基金法》的行为,并承诺建立健全内部风险控制制度,采取有效措施,防止下列行为的发生; (1) 将集合计划管理人固有财产或者他人财产混同于集合计划财产从事证券投资; (2) 不公平地对待管理的不同集合计划财产; (3) 利用集合计划财产或者职务之便为集合计划份额持有人以外的第三人牟取利益; (4) 向集合计划财产或者职务之使为集合计划份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4)向集合计划份额持有人违规承诺收益或者承担损失:

(5)侵占、挪用集合计划财产

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

 3、果百斤刈10年八字4月、江東子)20日 1日年1日
 4 指施,防止违五反资产管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律 法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责;

5、集合计划管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。 五 集合计划投资经理承诺 衣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、受雇人或任何第三者牟取利益; 公、不利用研究之便公司亡、支配人以仁司第二百年取利皿; 3、不泄露在任职期间知悉的有关证券、集合计划的商业秘密,尚未依法公开的集合计划投资内容、集合计划投资计划等信息,或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活

4. 不以任何形式为其他组织或个人讲行证券交易。 六、集合计划管理人的内部控制制度 1、内部控制和风险管理制度综述

1、內部於前科內學自理的度原於 为加强公司內部於制和风险管理,防范和化解风险,促进公司诚信、合法,有效经营,保障产 品投资者的合法权益,公司已经建立健全内部控制体系和内部控制制度。 公司内部控制制度有公司基本管理制度,部门业务规章组成,其中公司基本管理制度包括 公司的风险管理制度,公司合规管理制度,稽核审计制度,从公司层面全面建立、健全风险管理 制度体系和风险管理要求;部门业务规章包括部门专门针对资产管理业务的风险管理制度、流动性风险管理、合规管理制度、集合计划会计制度、信息披露制度、关联交易制度等,针对资产管 理业务讲行具体规范。

2、风险管理原则)全面性原则:公司风险管理必须覆盖公司的所有部门和岗位,贯穿决策、执行、监督、反

位程; (2)制衡性原则:公司建立不同部门/业务线、不同岗位之间的制衡体系,各级部门/业务线

(2) 制閉性原则:公司建立中间周月2年2月2日 (2) 不可聞的 2年2月2日 (2) 不可聞的设置应当权责分明,相互制衡和相互监督。
(3) 重要性原则:风险管理应当在对风险进行全面掌握的基础上,对重要业务、重大事项、主要操作环节和高风险领域实施重点管理。
(4) 适当性原则:风险管理工作应当与公司业务范围、经营规模、组织架构和风险状况等

(47) 归当注咏则:风险旨建工作应当与公司业务记制、总昌观晚、组织采构和风险代况等相适应,并随着市场,技术、监管及法律环境的变化及时加以调整和完善。 (5) 成本效益原则:风险管理应当权衡实施成本与预期收益,以适当的成本实现有效的风险控制。

公司全面风险管理银外条包括董事会及下设的风险管理委员会,经营管理层及下设的专业委员会,相关内部控制部门与业务部门/业务线。具体而言,包括如下组成部分:

公司风险管理的最高决策机构 对公司风险管理制度及休系的有效性承担最终责任

公司风险百里印度耐灾水的利力公司从股百里印度从外诉门外从已有电极全员任。 董事会风险管理委员会在董事会授权下,负责对公司风险管理的总处信息、基本政策进行 审议和决策;监督和评价公司的风险管理机制;监督和评价风险管理政策的执行情况;对需董 事会审议的重大决策的风险和重大风险的解决方案进行评估并提出意见;对需董事会审议的 合规报告和风险评估报告进行审议并提出意见。 (2)监事会

承担全面风险管理的监督责任,负责监督检查董事会和经营管理层在风险管理方面的履 职尽责情况并督促整改。

(3) 经营售性层 对从司的风险管理的右边性承扣主要害任 对公司印刷經目理的有效任单但主要页단。 经营管理层下设风险管理委员会,在经营管理层授权的范围内负责全面风险管理工作。 育席风险官,负责协调全面风险管理工作。 (4)合规部:组织机订;实施公司合规管理的基本制度,为公司经营管理层及各部门小业务 线提供合规建议及咨询,并对其经营管理活动的合法合规性进行监督;督导公司各部门小业务线

根据法律法规和准则的变化,评估、制定、修改、完善内部管理制度和业务流程等;依据公司反洗 钱有关制度,组织开展洗钱风险防控工作。

钱有关制度,组织开展洗钱风险防控工作。(5)风险管理那、负责对公司面临的金融风险进行识别、测量、分析、监控、报告和管理。分析、评价公司总体及业务部门7业务线的金融风险,对优化公司的风险资源配置提出建议、协助公司风管委制定公司的风险限额等风险管理指标、监控、报告风险限额等风险管理指标的执行情况;建立和完善金融风险在业务部门7业务线、内部控制部门、经营管理层间的快速报告、反馈机制、定期间静音管理层全面揭示公司的整体风险状况,为公司风险管理提供建议;建立金面压力测试机制,为公司重大决策和日常经营调整提供依据,并满足监管要求,对新产品、新业务进行事前的风险评估和控制设计;协助,指导和检查各部门分支机构及子公司的风险管理工作。(6)法律部、负责控制公司及相关业务的法律风险等。(7)稽核审计部、全面负责内部稽核审计工作,计划并实施稽核审计项目,根据国家法律法规和公司内政管理组度的组定,对公司及际虚单位经营管理活动的合法性、内部控制的储金法律、批和公司几户原管理组度的组定

法规和公司内部管理制度的规定,对公司及所属单位经营管理活动的合法性,内部控制的键全性及有效性进行客观独立的检查、评价、报告及建议,协助公司对突发事件进行核查。

性及有效性进行客观独立的检查、评价、报告及建议,协助公司对突发事件进行核查。 (8)业务部门业务线 风险管理的第一道防线,承担风险管理的第一线责任,负责建立各项业务的业务管理制度 与风险管理制度,对业务风险进行监控,评估,报告,并将业务风险控制在授权范围内。 4.风险管理和内观险控制的措施 (1)建立,维全内控体系,完善内控制度。公司建立,维全了内控结构,高管人员关于内控 有明确的分工,确保各项业务活动有恰当的组织和授权,确保风险管理工作是; (2)建立相互分离,相互制衡的内控机制。公司建立,健全了各项制度,做到大集合与小集 合投资经理分开,投资决策分开、交易集中,形成不同岗位之间的制衡机制,从制度上减少和防 形风险;

音校資金建分升、及风吹水刀升、×∞水,从∞。 范风险; (3)建立、健全岗位责任制。公司建立、健全了岗位责任制,使每个员工都明确自己的任务、职责,并及时将各自工作领域中的风险隐患上报,以防范和减少风险; (4)建立风险分类,识别、评估、报告、提示程序。公司建立了自下而上的风险报告程序,对风险隐患进行层层汇报,使各个层次的人员及时掌握风险状况,从而以最快速度做出决策; (5)建立内部监控系统。公司建立了有效的内部监控系统,能对可能出现的各种风险进行

ī和实时的监控; 5.集合计划管理人关于内部合规控制声明书 本公司特别声明以上关于内部控制的披露真实、准确,并承诺将根据市场变化和公司业务 发展不断完善内部控制制度。 第四部分 集合计划托管人

、集合计划托管人基本情况 (一)基本情况 名称:中信银行股份有限公司(简称"中信银行")

住所:北京市东城区朝阳门北大街9号 办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号 注完代表 L. 本庄范 成立时间:1987年4月20日

成立时间: 1987年4月20日 组织形式:股份有限公司 注册资本: 489.35亿元人民币 存续期间: 持续经营 批准设立文号: 中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号 基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字[2004]125号 联系人: 中信银行资产托管部

联系电话:4006800000 供責·∩10_65550832 客服由话,95558

网址:bankecitic.com 经营范围:保险兼业代理业务(有效期至2020年09月09日);吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;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,从事银行卡业务;提 供信用证服务及担保。代理收付款项;提供保管箱服务;结汇、售汇业务;代理开放式基金业务; 办理奠金业务;资金进出口;开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格额外机构投资者 托管业务,资知网务院银行业监督管理机构批准的其他业务。企业依法自主选择经营项目,开展

托管业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。(企业依法自主选择经营项目,开展经营活动;依法须经批准的项目,经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。)中信银行(601998.5H、0998.HK)成立于1987年,原名中信实业银行,是中国改革开放中境早成立的新兴商业银行之一,是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行,并以屡创中国现代金融史上多个第一而遗声海内外。伴随中国经济的快速发展,中信实业银行往中国金融市场改革的大闹中逐渐成长壮大,于2005年8月,正式更名"中信银行"。2006年12月,以中国国境国的大闹中逐渐成长壮大,于2005年8月,正式更名"中信银行"。2006年12月,以中国中境明和中信国际金融控股有限公司为股东,正式成立中信银行股份有限公司。同年成功引进战略投资者,与欧洲领先的西班牙对外银行(BBVA)建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日,中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009年,中信银行企业分量,中信银行企工为企业的企业,但是是一个企业的企业,但是是一个企业的企业,但是是一个企业的企业,但是是一个企业的企业,但是是一个企业的企业,但是是一个企业的企业,但是是一个企业的企业,但是是一个企业的企业,是一家快速增长升具有强大综合竞争力的全国性股份制商业银行。2009年,中信银行进行之产展区系700平区,并仅约全区,是一家快速增长升具有强大综合竞争力的全国性股份制商业银行。2009年,中信银行进行之产展国系第70时间接受,是明显的企业,是一家快速增长升具有强大综合竞争力的全国性股份制商业银行。2009年,中信银行进行之产展国系700年的企业企业,是一家快速增长升具有强大综合竞争力的全国性股份制商业银行。2009年,中信银行进行之产量服务第700年的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业的企业,是一个企业,是一个企业的企业,是一个企业,是 二)主要人员情况 方合英先生,中信银行执行董事、行长兼财务总监。方先生于2018年9月加入本行董事会

方合英先生,中信银行执行重单,行长兼财务总监。方先生于2018年9月加入本行重单会。 方先生自2014年8月起任本行党委委员。2014年11月起任在行副行长,2017年1月起兼任本行 财务总监。2019年2月起任本行党委副书记。方先生现同时担任信银(香港)投资有限公司,中 信银行(国际)有限公司及中信国际金融控股有限公司董事。此前,方先生于2013年5月至2015 年1月任本行金融市场业务总监。2014年5月至2014年9月兼任本行杭州分行党委书记、行长; 2007年3月至2013年5月任本行苏州分行党委书记、行长;2003年9月至2007年3月历任本行杭 州分行行长助理、党委委员、副行长;1996年12月至2003年9月在本行杭州分行工作,历任信贷 部科长,副总经理。富阳支行行长、党组书记、国际结算部副总经理、零售业务部副总经理,营业 强党经理、1996年7月至7996年12月至广始全发展组行标制推在办事状期主任。1992年12月至 部科长、副总经理、富阳支行行长、党组书记、国际结算部副总经理、零售业务部副总经理、营业 部总经理、1996年1月至1996年12月任浦东发展银行杭州城东办事处剧主任;1992年12月至 1996年7月在浙江银行学校实验城市信用社信贷部工作,历任信贷员、经理、总经理助理;1991 年7月至1992年12月在浙江银行学校任教师。方先生为高级经济师、毕业于北京大学,获高级管理人员工商管理硕士学位、拥有二十余年中国银行中业从业经验。 杨毓先生,中信银行副行长、分管托管业务。杨先生自2015年7月起任本行党委委员,2015 年12月起任本行副行长、此前、杨先生2011年3月至2015年6月任中国建设银行江苏省分行党委 书记、行长、2006年7月至2011年2月任中国建设银行河北省分行党委书记、行长、1982年8月至 2006年6月在中国建设银行河南省分行工作、历任计财处副处长、信阳分行副行长、党委委员, 计财处处长、郑州市铁道分行党委书记、行长、郑州分行党委书记、行长、河南省分行党委副书 记、副行长(卡替工作)、杨先生为高级经济顺、所农生学历、管理学博士。

记、副行长(主持工作)。杨先生为高级经济师,研究生学历,管理学博士。 陈珞珈女士,中信银行资产托管部副总经理,代为履行部门负责人职责,硕士研究生学历。

陈台加及工,中语银行政广托首部副总经理,几为履行副门贝页人联页,则工研究主学历。 陈女士2014年5月至今0月任本行资产托管部总经理助理,副总经理,2002年6月至2014年5月在 中國光大银行上海分行工作,历任公司业务二部副总经理,长兴岛支行行长,公司业务管理部 总经理,投行业务部总经理;2002年12月至2007年6月在HSBC Bank PLC工作。 总总理,这行业劳师总总理;2002年12月至24007年5月任日5BC Balik FLC工作。 (三)集合计划托管业务经营情况 2004年8月18日,中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准,积基基先托管人资格。中信银行私者"诚实信用,勤勉尽责"的原则,切实履行托管人职责。截至2019年一季度末,中信银行托管138只公开募集证券投资基金,以及基金公司、证券公

司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、ODII等其他托管资产、托管总规模达到8.62万 集合计划托管人的内部控制制度

1、内部控制目标。强化内部管理,确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面严 贯彻执行;建立完善的规章制度和操作规程,保证基金托管业务持续。新触发展,加强跨接 格的页例执行;建立完善的规章制度和操作规程,保证基金化管业务疗颈、稳健及废;加强稽核 监察,建立高效的风险监控体系,及时有效地发现、分析,控制和避免风险,确保基金财产安全, 维护基金份额持有人利益。 2、内部控制组织结构。中信银行总行建立了风险管理及员会,负责全行的风险控制和风 工作;托管部内设内控合规岗,专门负责托管部内部风险控制,对基金托管业务的各个 工作环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核监察。

3、内部控制制度。中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定,以控制 和防范基金托管业务风险为主线,制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业务内控检查实施细则》等一整套规章制度, **盖证券投资基金托管业务的各个环节,保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发**

4、内部控制措施。建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规范等,从制度上、人员 上保证基金托管业务稳健发展;建立了安全保管基金财产的物质条件,对业务运行场所实行封闭管理,在要害部门和岗位设立了安全保管区、安装了录像、录音监控系统,保证基金信息的安全;建立严密的内部控制防线和业务授权管理等制度,确保所托管的基金财产独立运行;营造 内部控制环境,开展多种形式的持续培训,加强职业道德教育。 、集合计划托管人对集合计划管理人运作集合计划进行监督的方法和程序

二、集合计划批官人对集合计划管理人工作集合计划进行监督的方法和程序 集合计划批管负人根据《基金法》(运作办法》、《信息披露办法》。资产管理合同、托管协议 和有关法律法规及规章的规定,对集合计划的投资运作、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、 集合计划进行管人发现集合计划业绩开致数据等进行监督和核查。相关信息披露、 集合计划进行管人发现集合计划管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息按照》, "本等报告记录在关于经验规程和安全公法,这个是当代工程的工程的一种分别。

资产管理合同和有关法律法规及规章的行为,将及时以书面形式通知集合计划管理人限期纠正。在限期内,集合计划托管人有权随时对通知事项进行复查,督促集合计划管理人改正。集合 。住時時, 划托管人发现集合计划管理人 管人将以书面形式报告中国证监会。 第五部分 相关服务机构 划托管人发现集合计划管理人有重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的,集合计划

、集合计划份额销售机构 一、集合计划份额销售机构 1.中信证券股份有限公司: 注册地址: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 客户咨询申话:95548

佐直·010_60836029

传真: 010-60836029 联系人:王一通 2.中信证券(山东)股份有限公司: 注册地址:青岛市崂山区深圳路222 号1 号楼2001 办公地址:青岛市市南区东海西路28 号龙翔广场东座5 层 法定代表人,姜晓林 客户咨询由话:95548

传真:0532-85022605 集合计划管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构销售本集合计划 、登记机构

中国证券登记结算有限责任公司 北京市西城区太平桥大街175 法定代表人 (010)50938617 三、出具法律意见书的律师事务所 を新 上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼 住所、办公地均

廖海、刘佳 、审计集合计划 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)北京分界 カル抽む 北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座26楼

法定代表人 经办注册会计师 第六部分 集合计划的基本情况 、集合计划名称 中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划 二、集合计划的类别

债券型集合资产管理计划 、集合计划的运作方式 東台F72017)2017月20日 5型开放式)每个运作期到期日前,集合计划份额持有人不能提出赎回申请

(1)每行运行规封则与训,聚合目划的破损有人不能定面吸出中间 对于每份计划份额,第一个运作期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)或计划份额申购确认日(对申购份额而言,下同)起(即第一个运作期起始 目),至资产管理合同生效日或计划份额申购审请日满6个月对应的月度对日(即第一个运作 期到期日)止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一工作日起、至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止,第三个运作期指第二个运作期到期日的次一工作日起,至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止。以

(2)每个运作期到期日,集合计划份额持有人可提出赎回申请 每个运作期到期日,集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在 期运作期到期日未申请赎回,则自该运作期到期日下一工作日起该计划份额进人下一个运

集合计划份额持有人在运作期到期日申请赎回的,集合计划管理人按照资产管理合同和 招募说明书的约定为集合计划份额持有人办理赎回事宜。 四.集合计划份额而值

四、集合计划份额面值 本集合计划份额面值为人民币1.00元。

本集合计划份额面值为人长而1000。 五、集合计划存续期限 本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年。本集合计划自资产管理 合同变更生效日起3年后,按照中国证监会有关规定执行。 第七部分集合计划份额的分类

本集合计划根据销售方式或投资者申购本集合计划金额的不同,对投资者持有的计划份

额按照不同的费率计提销售服务费、因此形成不同的集合计划份额类别。 本集合计划设A类计 分额、C类计划份额两类计划份额,两类计划份额单独设置代码,并分别计算公布集合计划份 额净值。 根据集合计划实际运作情况,在履行适当程序后,集合计划管理人可对集合计划份额分类

班河水 出 进行调整并公告。 二、集合计划份额类别的限制 投资者可自行选择申购的集合计划份额类别。

C类计划份额 1000万元 (何已持有本集合计划 首次申购单笔最低限额人民 追加申购品任全知 1 000元 单笔赎回最低份额 不进行限制 不进行限制 不进行限制 不进行限制 销售服务费(年费率)

本集合计划暂不开通份额类别之间的升降级业务。今后若开通升降级的有关业务,业务规 中果台口划程小开盟以下交流。 则详见届时发布的有关公告及招募说明书(更新)。 四、集合计划份额分类及规则的调整

四、集合计划份额分类及规则的调整 集合计划管理人可以与集合计划托管人协商一致并在履行相关程序后,调整申购各类计划份额的最低金额限制、集合计划份额分类规则等、集合计划管理人必须在开始调整之日前依照《信息披露办法》的规定在指定媒介上刊登公告。 第八部分集合计划的历史沿革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各案确认函》(中证协略【2013】210号)。 根据《证券公司大集合资产管理业务运用(关于规范金融和资产管理业务的指导意见)

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《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",变更后的资产管理合同自集合计划管理人公告的生效之日起生效。 第九部分集合计划的存续 《资产管理合同》生效后,连续20个工作日出现集合计划份额持有人数量不满200人或者 集合计划资产净值低于5000万元情形的,集合计划管理人应当在定期报告中予以披露;连续60 个工作日出现前还情形的,集合计划管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运 作方式、与其他集合计划的生动者然中必需要,并又正集合计划的经额挂有人本会进行

作方式,与其他集合计划合并或者终止资产管理合同等,并召开集合计划份额持有人大会进行 本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年。本集合计划自资产管理

法律法规或中国证监会另有规定时,从其规定。 第十部分 集合计划份额的申购、赎回

一、中峽和赎回场所 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集合计划管理人在 招募说明书或其他相关公告中列明。集合计划管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以 公告。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 的其份支生力。现在公共的经验的由购员。 公台。集市时则投資和公司在销售的特別建築市口划销售业为自营业场的总域销售的均等疾的 財 (地方式)办理集合计划份额的申购与规同。 二、申购和规同的开放日及时间 1.开放日及开放时间 集合计划管理人在开放日办理集合计划份额的申购,在每个运作期到期日办理集合计划

份额的赎回,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 集合计划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。 资产管理合同生效后,若出现新的证券交易市场,证券交易所交易时间变更或其他特殊情 资产管理合同生效后,若出现新的证券交易市场,证券交易所交易时间变更或其他特殊情 况,集合计划管理人将视情况对前途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》的有关规定在指定螺介上公告。 2.申购,账回开始日及业务办理时间 集合计划管理人自资产管理合同生效之日起不超过3个月开始办理申购,具体业务办理时间

黑百月及日本人上公司 同在申购开始公告中规定。 集合计划份额每个运作期到期日,集合计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。 集合计划份额每个运作期到期日,集合计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。

"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;

2、金额甲购,价额赎回 原则,即甲则以金额甲南,聚归以份额甲审; 3、当日的申购与赎回申请可以占在集合计划管理人规定的时间以内撤销,集合计划销售机 构另有规定的,以集合计划销售机构的规定为准; 4、赎回遵循"先进先出"原则,即对该集合计划份额持有人在该销售机构持有的且赎回申 请日为运作期到期日的操合计划份额,按照投资者认购,申购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 注取3年系基础提出,据以及可结炼

5.分/里中村/次配压运行计算。 法权益不受损害并得到公平对待。 集合计划管理人可在法律法规允许的情况下,对上述原则进行调整。集合计划管理人必须 在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告

受资者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

投资者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
投资者申购集合计划份额时,必须全额交付申购款项,投资者交付申购款项,申购成立;集合计划登记机构确认集合计划份额符有人递交赎回申请,赎回成立;集合计划登记机构确认赎回时,赎回生效。
集合计划创额符有人递交赎回申请,赎回成立;集合计划登记机构确认赎回时,赎回生效。投资者赎回(T日)申请生效后,集合计划管理人将在汪+7日(包括该日)内支付赎回款项。正常情况下,投资者赎回(T日)申请生效后,集合计划管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项,如遇证券交易所或支易市场数据传输延迟,通讯系统敌策。银行交换系统故障或其他非集合计划管理人及集合计划托管人所能控制的因素影响了业务流程,则赎回款项划付时间相应顺延至上述情形消除后的下一个工作日划往集合计划的额符有人银行账户。
在发生巨额赎回或资产管理合同有关条款处理。
集合计划管理人可以在法律法规和资产管理合同允许的范围内,对上述业务办理时间进行调整、集合计划管理人可以在法律法规和资产管理合同允许的范围内,对上述业务办理时间进行调整、集合计划管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公

行调整,集合计划管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公 3、申购和赎回申请的确认

3. 申购和赎回申请的确认 集合计划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(1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,投资者应在T+2日后(包括该日)及时到销售网点拒合或以销售机构规定的其他方式查询申请的部场认情况。若申购不成功或无效,则申购验项(无利息)退还给投资者。销售机构对申购和赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购和赎回的确认以登记机构的确认结果为相。对于申请的确认情况、投资者应及时查询并妥善行使合法权利。因投资者愈于行使权利,被使其相关权益受损的,集合计划管理人、营价计划管理人、基金计划销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

果台丁划北宫人,果台丁划到曾界,PA不承担由此造成的损失或不利后果。 集合计划管理人可在法律法规允许的范围内、在不对集合计划份额持有人利益造成损害的前提下,对上述业务的办理时间,方式等规则进行调整。集合计划管理人应在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介公告。 五、中期和赎回的数量限制

1、申请申购集合计划的金额 投资者通过代销机构或中信证券股份有限公司网上直销首次申购A类计划份额的单笔最 低限额为人民币100元。追加申购单笔最低限额为100元:首次申购C类计划份额的单笔最低限 额为人民币10,000,000元,追加申购单笔最低限额为1,000元 投资者通过直销中心柜台首次由购各笔最低限额为1,000元。 投资者通过直销中心柜台首次由购A类计划份额的单笔最低限额为人民币100元。追加由

投资者通过直销中心柜台首次中购A类计划份额的甲笔最低限额为人民市100元,追加申单笔最低限额为人民市00元,首次中购0类计划份额的单笔最低限额为人民市0000,000.000.1 但已持有本集合计划C类计划份额的投资者可以适用首次申购单笔最低限额为人民市1,000元。追加申购单笔最低限额为人民市1,000元。 2.申请赎回集合计划的份额投资者可将其全部或部分集合计划份额赎回。本集合计划不对单笔最低赎回及最低持有

在符合法律法规规定的前提下,各销售机构对赎回份额限制有其他规定的,需同时遵循该 3、集合计划管理人可以规定投资者每个集合计划交易帐户的最低集合计划份额金额。且

3、集合计划管理人可以规定设置有等。集合计划交易账户的废帐集合计划的额求额,具 体规定请参见招募统明书或相关公告。 4、集合计划管理人可以规定单个投资者单笔或单日申购集合计划份额上限、累计持有的 集合计划份额上限,具体规定请参见招募说明书或相关公告。 5、集合计划管理人可以规定本集合计划单日的申购金额上限或单日净申购比例上限,具

体规定请参见招募说明书或相关公告。 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,集合计划 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 面 新信集会计划由购等措施 切实保护左导集会计划份额挂有人的会法权益 集会计划管理 人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对集合计划规模予以控制。具体规定请参

7、集合计划管理人可以对集合计划的总规模进行限制,并在招募说明书或相关公告中列 明。 8.集合计划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的数 量限制。集合计划管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公

六。中學發用与赎回费用 本集合计划一般情况下不收取申购费用与赎回费用,但对持续持有期少于7日的投资者收取1.5%的赎回费,并全额计入集合计划财产。投资人需至少持有本集合计划份额满6个月,在6个月持有期内不能提出赎回申请,持有满6个月后赎回不收取赎回费用。 七、中學份额与赎回金额的计算方式

5集合计划申购的有效份额为申购金额除以当日的集合计划份额净值,有效份额单位为 份,上述计算结果均按四舍五入,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由集合计划财产 。 由购各米集会计划份额的计管公式为

甲购各类集合计划份额的计算公式为: 申购份额=申购金额+申购当日淡类集合计划份额净值 例:假定 T 日某投资者投资 10,000 元申购本集合计划 A 类计划份额,当日 A 类计划 β净值为 1,1000元,则其可得到的申购份额计算如下: 申购份额=10,000÷1,1000 = 9090.91份 即投资人投资 10,000.00 元申购本集合计划 A 类计划份额,则可得到 9090.91 份 A 类计划份额。 2、赎回金额的计算

公與巴亞·爾切可异 赎回金额功按实际确认的有效赎回份额乘以当日集合计划份额净值,赎回金额单位为元。 上述计算结果均按四舍五入,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由集合计划财产承 時同冬米集会计划份麵的计算公式为 膜回各类集合计划价额的计算公式为: 赎回金额=赎回份额。赎回当日该类集合计划份额净值 例:渠投资人 T 日赎回 10,000 份 A 类计划份额,假设赎回当日 A 类计划份额净值是 1.1000元,则其可得到的赎回金额为: 赎回金额=10,000×1,1000=11,000.00元 即:投资人赎回本集合计划10,000份A类计划份额,假设赎回当日A类计划份额净值是

3.集合计划份额净值的计算 本集合计划各类集合计划份额净值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍开 · 米·宾·日》的"台关梁·百日》的"颜德伊迪印)"并,陈国到小数是后"电池",小数是后身的巴特吉克人,由此产生的收益或贵华由集合计划财产承担。丁日的各类集合计划财务净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经履行适当程序,可以适当延迟计算或公告。 八、拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时,集合计划管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请。

1、因不可抗力导致集合计划无法正常运作。 2、发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时。 3、证券交易所交易时间非正常停市,导致集合计划管理人无法计算当日集合计划资产净 3、ML·尔·スの加文の印制中止吊停印, 守蚁集台计划官埋入无法计算当日集合计值或者无法办理中购业务。 4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有集合计划份额持有人利益时

,则其可得到的赎回金额为11,000.00元。

计划管理人应及时恢复由购业条的办理

4.依文朱毛以朱空中两十明·日底云影响以顶方弧片得最后入刻而侧行有入利面时。 5.集合计划资产规模过大,使集合计划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多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,经与集合计划托管人协商确认后,集合计划管

理人应当暂停接受集合计划申购申请。 7、集合计划管理人、集合计划托管人、销售机构或登记机构的异常情况导致集合计划销售

7、集合计划管理人、集合计划托管人、销售机构或登记机构的异常情况导致集合计划销售系统、集合计划登记系统或集合计划会计系统无法正常运行。 8、集合计划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。 9、为了保障集合计划份额持有人的利益、集合计划管理人可在集合计划到期前6个月内视情况暂停本集合计划的目常申购和转换转入业务。 10、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、7、9、10项暂停申购情形之一旦集合计划管理人决定暂停接受申购申请时,集合计划管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资者的申购申请被拒绝、被拒绝的申购款项(无利息)将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时,集合计组管理人以应用标户申购的协助。

新停陸同或延缓支付陸同款項的情形 及生下列情形时,集合计划管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项: 1、因不可抗力导致集合计划管理人不能支付赎回款项。 发生资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况时。
 证券交易所交易时间非正常停市,导致集合计划管理人无法计算当日集合计划资产净

值或者无法办理赎回业务。 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

"从定39/79 「34/97 「AL JT XX 口 X 至 已 經際回 5、集合计划管理人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。 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,经与集合计划托管人协商确认后,集合计划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 法律法期间公司书目显证依全计2004年444565

理人应当延缴之付赎回新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。 发生上述第1,2公,3、5,6、7项情形之一而集合计划管理人决定暂停接受集合计划份额持有 人的赎回申请或者延缓支付赎回款项时,集合计划管理人应按规定根中国证监会备案,已确认 的赎回申请,集合计划管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户 申请量占申请应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的出 7次代表述第2000年12月提供证据与1000年12月提供证据的。

可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,集合计划管理人应及时恢复赎回业务 的办理并公告。 十、巨额赎回的情形及处理方式

十、巨额赎回的认定 主,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,集合计划管理人可以根据集合计划当时的资产组合状况决

丁。)部分延期赎回:当集合计划管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付 (2) 能分延期原担: ヨ集百日初自生人队 / 以 以 以 日 10 次 日 10 次 日 10 次 日 20 次

集合计划总份额10%以上部分的赎回申请,各自动进行定期办理。对于具宗当日非自动延期办理的赎回申请,应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请 占非自动延期办理的赎回申请 总量的比例,确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分,投资者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,直身全部赎回为止:选择或消赎回的,当日未获受理り部分赎回申请将被被销。延期的赎回申请与一干开放日晚间申请一并处理,无优先权并以下一开放日的集合计划份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择,投资者未能赎回部分 化自己的抵销帐间处理 作自动延期赎回处里。 (3) 新停赎回:连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回,如集合计划管理人认为有必要,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

之,可且它按文集市环划的赎回申请;已经接受过20个工作日,并应当在指定媒介上进行公告。 3、巨额赎回的公告 3、巨额赎回的公告 身发生上还自缴赎回并延期办理时,集合计划管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书 的其他方式在3个交易日内通知集合计划份额持有人,说明有关处理方法,同时在指定嫁

介上刊登公告。 十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 1、发生上述暂停申购或赎回情况的,集合计划管理人应按规定向中国证监会备案,并在规 定期限内在指定媒介上刊登暂停公告。 2、集合计划管理人可以根据暂停申购或赎回的时间,依照《信息披露办法》的有关规定 最迟于重新开放日在指定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告;也可以根据实际情况在暂

多公告中明确重新开放申购或赎回的时间,届时不再另行发布重新开放的公告。 上一 集合让#ids# 等公言中奶頓量刺升放中购或族回的时间,庙的小书为打及印量刺开放的公言。 十二、集合计划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 集合计划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 集合计划管理人留时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, 相关规则由集合计划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 前告知集合计划托管人与相关机构。 十三、集合计划的非交易过户

十三、集合计划的非交易过户是指集合计划登记机构受理继承、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、符合法律法规的其他非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本集合计划份额的投资者。继承是指集合计划份额持有人称工。其持有的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调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集合计划登记机构实求提供的相关资料,对于符合条件的非交易过户必须是要求是依据的规定办理,并按集合计划

登记机构规定的标准收费。 4加 集会计划的转托管 十四、集合计划的转托管 集合计划份额持有人可办理已持有集合计划份额在不同销售机构之间的转托管,集合计划销售机构可以按照规定的标准收取转托管费。 十五、定期定额投资计划 集合计划管理人可以为投资者办理定期定额投资计划,具体规则由集合计划管理人另行 规定。投资者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 集合计划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

十六、集合计划的冻结和解冻

十七、集合计划份额的转让 在法律法规允许且条件具备的情况下,集合计划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。集合计划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 持有人应根据集合计划管理人公告的业务规则办理集合计划份额转让业务。 八. 其他业务 法律法规允许的条件下,集合计划登记机构可依据其业务规则,受理集合计划份额 质押等业务,并收取一定的手续费用。 第十一部分 集合计划的投资

需求。 、投资范围

在追求资产安全性的基础上,力争满足客户对于短期固定周期的资金配置和保值增值的

※旧伝派に及び記載日かります。 序后、可以将其纳入投资范围。 集合计划的投资组合比例为: 本集合计划投资于债券资产比例不低于集合计划资产的

略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上,力争实现组合的稳健增值。 (1) 平均久期配置 大集会计划通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析 预测未求的利率趋势 判断债 券市场对上述变量和政策的反应,并据此对债券组合的平均久期进行调整,提高债券组合的总

预期投资收益最大化的目的。 (3) 突陽配宣 本集合计划对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析、研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化

趋势,制定债券类属配置策略,以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

3.信用品种的投资策略与信用风险管理

配的更优品种进行配置。 4、资产支持证券投资策略

5.产品进行更为精准的定价,在控制风险的前摄 四、投资限制 (一)组合限制 本集合计划的投资组合将遵循以下比例限制:

(1)本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%; (2)本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%; (2)本集合计划保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等; (3)本集合計划持有一家公司发行的证券,其市值不超过集合计划资产净值的10%; (4)本集合计划管理人管理的全部大集合计划持有一家公司发行的证券,不超过该证券 , 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

净值的10%; (6)本集合计划持有的全部资产支持证券,其市值不得超过集合计划资产净值的20%; (7)本集合计划持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持 证券规模的10%; (8)本集合计划管理人管理的全部大集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证

月内,又尽虚为。 月内予以全部实出; (10)本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划 资产净值的40%;进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后

(11) 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本集合计划资产净值 (11) 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本集合计划资产净值的15%;因证券市场波动、证券停阱、集合计划规模变动等集合计划管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;(12) 本集合计划与私募美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;(13)本集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的140%;(14)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)、(11)、(12)项情形之外,因证券市场波动,证券发行人合并、集合计划规模变动等集合计划管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例

集合计划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、投资等略应当符合资产 合同的约定。集合计划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目 起开始。 如果法律法规或监管部门对上述投资比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法

规或监管部门取消上述限制,如适用于本集合计划,则本集合计划投资不再受相关限制 、二/聚正门/。 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;

实际总制人或者与具有重大利害关系的公司及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股资目标和股资策略、遵循集合计划份部特有人利 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集合计划托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应 提交集合计划管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。集合计划管理人董事 会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

款利率(稅后)*20% 】 本集合计划选择上述业绩比较基准的原因为:中债综合财富(1年以下)指数是中债金融

够较好地反映本集合计划的风险收益特征 學教好型反映學集合计划的/過歐位為行促。如果今 如果今后法律法规发生变化,或者相关数据编制单位停止计算编制该指数或更改指数名 称,或者有其他代表性更强,更科学客观的业绩比较基准适用于本集合计划时,本集合计划管 理人可依据维护投资者合法权益的原则,在与集合计划托管人协商一致并按照监管部门要求 履行适当程序后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。

(下转A15版)

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(含国债、金融债、企业 债、公司债、次级债、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票 据,也方政府债等)。资产支持证券、债券回购、债券逆回购、同业存单、银行存款、以及法律法规 或中国证监会允许集合计划投资的集准金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。 本集合计划不投资于股票等资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分 如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种,集合计划管理人在履行适当程

果合计划的投资组合比例对:本集合计划投资于债券资产比例不似于集合计划资产的80%。本集合计划保持不低于集合计划资产净低%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、存出保证金和应收申购款等。三、投资策略本集合计划将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征,分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势,自上而下决定类属资产配置发组合久期,并依据内部信用评级系统和定价模型,深入挖掘价值被低估的标的券种。本集合计划采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、和零额级、使用等额数。 在港梯ນ设置基地。上海公司现金的验验地域

(2) 財政紀刊和巴里本集合计划对债券市场收益率期限结构进行分析,运用统计和数量分析技术,预测收益率期限结构的变化方式,选择确定期限结构配置策略,配置各期限固定收益品种的比例,以达到

趋势,制定债券类属配置策略、以获取不同债券类属之间利差变化内积米的投资收益。 2、利率品种的投资策略 本集合计划对国债,央行票据等利率品种的投资,是在对国内、国外经济趋势进行分析和 预测基础上,运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预 测,深入分析利率品种的收益和风险,并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期 后、本集合计划对债券的期限结构进行分析,运用统计和数量分析技术、选择合适的期限结构 的配置策略、在合理控制风险的前提下、综合考虑组合的流动性,决定投资品种。

3.信用品种的投资策略与信用风险管理 本集合计划对金融债、企业债、公司债和短期融资券等信用品种采取自上而下和自下而上 相结合的投资策略。自上而下投资策略指本集合计划在平均久期配置策略与期限结构配置策 略基础上,运用数量化分析方法对信用产品的信用风险溢价,添动性风险溢价,转效益价等权 素进行分析,对利差走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本集合计划运用行业 研究方法和公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹

4、於广交持证券投資東岭 本集合计划投资资产支持证券以一级市场申购为主,二级市场交易为辅。通过对标的资产 的质量和构成,利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析,根据估值模型对 ABS产品进行更为精准的定价,在控制风险的前提下尽可能的增厚本集合计划的收益。

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BBB以上(含BBB)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,应在评级报告发布之日起3个

的,集合计划管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

承销证券

1.承宵业券; 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。但是中国证监会另有规定的除外; 5.向其集合计划管理人、集合计划托管人出资; 6.从事内幕交易。操纵证券交易价格及其他书还当的证券交易活动; 7.注册《开发处理》和证券及条件

7、法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。 集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划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

本に上ンマナナ・ハスポスショッル比「甲草。 如法律、行政法規或监管部「取消或変更上述禁止性規定、集合计划管理人在履行适当程 序后、本集合计划可不受上法规定的限制或以変更后的规定为准。 五、业绩比较基准 本集合计划的业绩比较基准为:【中债综合财富(1年以下)指数收益率*80%+一年期定期存

本集百斤划远律上处业现正收益值的原因为;于顶综石则值(1 开以下)捐致是于顶壶廊值中心有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的短期债券指数,自在反映短期债券的整体价格和投资回报情况,本集合计划资产配置以一年内到期的信用债力主,与该指数的期限相配配。银行一年期定期存款税后和率为中国人民银行公开发行,具有较强的权威性和市场影响力。基于本集合计划的投资范围和投资比例限制,该业绩比较基准能

版1) 這一在F7月又受到此及整個开及的公司,即允問百开采日以初即895年八人宏。 六、风险收益转距 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。 七、集合计划管理人代表集合计划行使债权人权利的处理原则及方法