



## 海通海汇系列一星石 1 号集合资产管理计划说明书

### 特别提示:

本说明书依据《证券公司客户资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（以下简称《实施细则》）、《海通海汇系列一星石 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》）及其他有关规定制作，管理人保证本说明书的内容真实、准确、完整，不存在任何虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

委托人承诺以真实身份参与集合计划，保证委托资产的来源及用途合法，并已阅知本说明书和《资产管理合同》全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。本说明书对集合计划未来的收益预测仅供委托人参考，不构成管理人、托管人和推广机构保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

投资者签订《资产管理合同》且合同生效后，投资者即为《资产管理合同》的委托人，其认购或申购集合计划份额的行为本身即表明其对《资产管理合同》及本说明书的承认和接受。委托人将按照《管理办法》、《资产管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。



集 合 计 划 基 本 信 息	名称	海通海汇系列一星石 1 号集合资产管理计划
	类型	非限定性集合资产管理计划
	目标规模	本集合计划推广期规模上限 10 亿份，存续期规模上限 20 亿份。 推广期利息转份额部分不受推广期募集规模上限的限制。
	管理期限	本集合计划管理期限为 10 年，可展期。
	推广期	指自本集合计划启动推广之日起不超过 60 个工作日的期间，具体推广时间以本集合计划推广公告为准。
	封闭期	封闭期为集合计划成立日起 3 个月的期间，封闭期内不办理参与、退出业务。
	开放期	封闭期结束后进入开放期，开放期内每个自然月度的 20 日（如遇节假日则为该日之后最近一个工作日）为开放日，为委托人办理参与、退出业务。
	份额面值	每份集合计划的面值为 1.00 元。
相关费率	1、参与费（包括认购/申购费）：0%。 2、退出费：持有期限少于等于 180 天的退出费率 3%；持有期限大于 180 天的退出费率 0%。	

		<p>3、管理费：1.85%。</p> <p>4、托管费：0.15%。</p> <p>5、业绩报酬：若某开放日计提业绩报酬前的单位净值高于业绩报酬计提基准净值的，业绩报酬为高出部分的 20%；若业绩报酬计提前的单位净值等于或低于业绩报酬计提基准净值的，不计提业绩报酬。</p> <p>业绩报酬计提基准净值：以往开放日的单位净值的最高值与 1.06 元之间的最大值。</p> <p>6、其他费用：除交易手续费、印花税、管理费、业绩报酬、托管费之外的集合计划费用，由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入当期费用，从集合计划资产中支付。</p>
	投资范围	<p>本计划投资范围主要为国内依法发行的股票、权证、国债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、可转换债券、可分离交易债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、证券投资基金、债券逆回购及银行存款。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>
	风险收益特征	本计划属于非限定性集合资产管理计划，计划整体为高风险品种。
	适合推广对象	适合推广对象为推广机构现有的客户，适合具有一定投资经验，对证券市场投资风险有充分认识的个人和机构投资者。
当事人	管理人	上海海通证券资产管理有限公司
	托管人	中国民生银行股份有限公司
	代理推广机构	中国民生银行股份有限公司
集合计划的参与	办理时间	<p>(1) 推广期参与</p> <p>在推广期内，投资者在工作日内可以参与本集合计划。</p> <p>推广时间等推广安排由管理人公告确定。若管理人决定提前结束推广期，应提前一个工作日通知推广机构和注册登记机构并在管理人指定网站进行公告。</p> <p>(2) 存续期参与</p>

与		<p>投资者在集合计划开放期内的开放日可以办理参与本集合计划的业务。投资者可以根据推广机构的业务安排办理预约参与退出业务。推广机构是否办理预约业务由推广机构确定。</p>
	办理场所	<p>委托人可以到推广机构的营业网点，或通过推广机构的指定系统提交参与申请。</p>
	办理方式、程序	<p>(1) 投资者按推广机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理；</p> <p>(2) 投资者应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔参与申请；</p> <p>(3) 投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分；</p> <p>(4) 委托人可多次参与本集合计划，参与申请仅可以在当日业务办理时间内撤销；投资者参与申请确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；</p> <p>(5) 投资者于 T 日提交参与申请后，可于 T+2 日后在办理参与的网点查询参与确认情况。</p> <p>(6) 当本集合计划接近或达到规模上限时，管理人有权停止接受委托人的参与申请；当本集合计划超过规模上限时，管理人有权发布停止接受参与指令，对当日参与按“时间优先、金额优先”原则确认有效参与，即首先按照参与时间，先参与先确认，对于同一参与时间按照参与金额顺序，金额高者先确认，超过规模上限后的所有参与无效。参与规模以管理人的确认结果为准。</p> <p>(7) 本集合计划采用电子签名合同的方式签署，电子签名合同在管理人、托管人、委托人三方完成签署，且委托人按合同约定将参与资金划入指定账户并经注册登记机构确认有效后生效。委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，管理人和其他推广机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。</p> <p>(8) 委托人同意，参与申请的情况以管理人确认的结果为准。</p>

参与费	<p>(1) 参与费率: 0%</p> <p>(2) 参与份额的计算方法:</p> <p>①推广期参与</p> <p>参与份额 = (参与金额 + 利息) / 计划单位面值</p> <p>推广期参与份额的计算保留到小数点后两位, 小数点两位以后的部分采用去尾法处理, 由此产生的差额部分计入计划资产损益。</p> <p>②开放日参与</p> <p>委托人在开放日参与本计划的, 管理人根据当日计划单位净值计算其参与份额。</p> <p>参与份额 = 参与金额 / T日计划单位净值</p> <p>存续期参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位, 由此产生的差额部分计入计划资产损益。</p>	
认购资金利息	<p>委托人的参与资金在推广期产生的活期利息将折算为计划份额归委托人所有。参与份额的计算保留到小数点后两位, 小数点两位以后的部分采用去尾法处理, 由此产生的差额部分计入计划资产损益。</p>	
集合计划的退出	办理时间	退出在开放日办理。
	办理方式、程序	<p>(1) 退出申请的提出</p> <p>委托人必须根据本集合计划推广机构网点规定的手续, 在开放日的业务办理时间内向推广机构网点提出退出申请。退出申请数量超过委托人持有份额数量时, 超出委托人持有份额的申请无效。</p> <p>(2) 退出申请的确认</p> <p>委托人可在 T+2 日 (包括该日) 之后到推广机构网点取得 T 日退出申请成交确认单, 若交易未成功或数据不符, 委托人可与为其办理手续的推广机构网点人员联系并进行核实。</p> <p>(3) 退出款项划付</p> <p>委托人的退出申请确认后, 退出款项将在 T+2 日内从托管账户划出。</p>
	退出费	<p>(1) 退出费用</p> <p>委托人申请退出本集合计划时须按退出份额的持有期限缴纳退出费, 具体退出费率如下:</p>

持有期限 (D)	退出费率 (%)
D ≤ 180 天	3
D > 180 天	0

(2) 退出金额的计算方法

本集合计划退出时以申请日计划单位净值作为计价基准,按扣除退出费、业绩报酬后的实际金额支付。退出费和退出金额的计算公式如下:

$$\text{退出总额} = \text{T 日计划单位净值} \times \text{退出份额}$$

$$\text{退出费} = \text{退出总额} \times \text{退出费率}$$

$$\text{退出金额} = \text{退出总额} - \text{退出费}$$

上述计算结果均以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。退出费由委托人承担,不列入集合计划资产。

退出费由委托人承担,不列入集合计划资产。

(3) 收取方式

委托人退出申请确认后,退出款项将在 T+2 日内从托管账户划出。如集合计划出现暂停估值的情形,管理人与托管人协商后,可以将划拨日期相应顺延。

单个委托人大额退出及预约申请

本集合计划不设大额退出限制条款,但因单个委托人大额退出导致出现巨额退出,则根据巨额退出的认定和处理方式办理。

巨额退出

(1) 巨额退出的认定

单个开放日,委托人当日累计净退出申请份额(退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额)超过上一工作日计划总份额数的 10%时,即为巨额退出。

(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时,管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出或暂停退出:

全额退出:当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时,按正常退出程序办理。

部分顺延退出:当管理人认为支付委托人的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时,管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额

		<p>10%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，委托人可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以该工作日的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。</p> <p>(3) 告知客户的方式</p> <p>发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。</p>
	连续巨额退出	<p>(1) 连续巨额退出的认定</p> <p>如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。</p> <p>(2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按本合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在管理人指定网站上进行公告。</p>
管理人自有资金参与情况		管理人不以自有资金参与本集合计划。
集合计划成立的条件、时间		<p>集合计划的参与资金总额不低于 1 亿元且其委托人的人数为 2 人（含）以上，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本集合计划成立。</p> <p>集合计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入集合计划份额登记机构指定的专门账户，不得动用。</p>
集合计划设立失败		集合计划推广期结束，在集合计划规模低于 1 亿元或委托人的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部推广费用，并将已认购资金及同期利息在推广期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人。
费用	费用种类	<p>(一) 费用种类</p> <p>1、管理人的管理费和业绩报酬；</p>

、 报 酬	<p>2、托管人的托管费；</p> <p>3、证券交易费用；</p> <p>4、清算费用；</p> <p>5、本集合计划成立后的注册登记费用；</p> <p>6、本集合计划成立后的信息披露费用、审计费和律师费；</p> <p>7、按照国家有关规定可以列入的其他费用。</p> <p>(二) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、管理费：</p> <p>本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为1.85%。计算方法如下：</p> $H = E \times 1.85\% \div \text{当年天数}$ <p>H为每日应计提的集合计划管理费</p> <p>E为前一日集合计划资产净值</p> <p>管理费每日计提，逐日累计，按季支付，由管理人向托管人发送管理费划付指令，托管人复核后于次季首月首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性扣除后按照相关服务协议支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。管理费应划入以下管理人指定银行账户：</p> <p>    账户名称（接收管理费）：</p> <p>    账    号：</p> <p>    开户银行：</p> <p>2、托管费：</p> <p>本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的 0.15% 年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应支付的托管费；</p> <p>E 为前一日集合计划资产净值。</p> <p>托管费每日计提，逐日累计，按季支付，由管理人向托管人发送托管费划付指令，托管人复核后于次季首月首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性扣除支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。托管费应划入以下托管人指定银行账户：</p>
-------------	---

	<p>账户名称（接收托管费）：中国民生银行托管业务专户          账 号：0001017200000743          开户银行：中国民生银行总行清算中心</p> <p>3、管理费和托管费的调整</p> <p>管理人和托管人可协商调减管理费和托管费，并在新的费率开始实施前3个工作日在管理人指定网站公告。</p> <p>4、证券交易费用：本集合计划投资运作期间所发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，作为交易费用在交易过程中直接扣除。</p> <p>本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已扣除风险金），其费率由管理人根据有关政策法规确定。在每季度首日起 10 个工作日内支付给提供交易单元的券商。</p> <p>5、与本集合计划相关的审计费</p> <p>在存续期间发生的集合计划审计费用，在合理期间内摊销计入集合计划。本集合计划的年度审计费，按与会计师事务所签订协议所约定的金额，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。</p> <p>6、清算费用</p> <p>本集合计划终止清算时所发生费用，按实际支出额从集合计划资产总值中扣除。</p> <p>7、税收</p> <p>集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。</p> <p>8、其他费用：</p> <p>上述（一）中第 5、6、7 项费用由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律、行政法规另有规定时从其规定，并由托管人根据法律、法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。</p>
<p>不由集合计划承担</p>	<p>集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导</p>



	的费用	<p>致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。</p> <p>其他不列入集合计划费用的具体项目依据中国证监会有关规定执行。</p>
	业绩报酬	<p>1、管理人收取业绩报酬的原则：</p> <p>（1）在每个开放日和计划终止日计提业绩报酬；</p> <p>（2）业绩报酬从集合计划资产中扣除。</p> <p>2、业绩报酬计提基准净值：以往开放日的单位净值的最高值与【1.06】元之间的最大值</p> <p>3、业绩报酬计提方法：若开放日\计划终止日提取业绩报酬前的单位净值高于业绩报酬计提基准净值，在该开放日\计划终止日以二者差额的 20% 计算提取业绩报酬；若开放日\计划终止日提取报酬前的单位净值等于或低于业绩报酬计提基准净值，则不计提业绩报酬。</p> <p>计算方法如下：</p> <p>某开放日\计划终止日计提的业绩报酬=（该开放日\计划终止日计提业绩报酬前的净值 - 业绩报酬计提基准净值）×【20】%×该开放日\计划终止日总份额数</p> <p>开放日\计划终止日总份额数指该日因参与、退出而导致单位份额变动前的单位总份数。</p> <p>如果上一公式计算结果为负或者为零，则该开放日\计划终止日提取的业绩报酬为零。</p> <p>4、业绩报酬支付：</p> <p>在开放日和计划终止日，业绩报酬从集合计划资产中一次性扣除，由管理人向托管人发送划付指令，托管人根据管理人的指令将业绩报酬划入管理人账户。</p>
收益分配	收益构成	<p>收益包括：集合计划投资所得股息、债券利息、红利、买卖证券/基金价差、银行存款利息及其他合法收入。集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。</p>
	分配原则	<p>本集合计划不进行收益分配。</p>
	分配方式	

	分配方案	
集 合 计 划 展 期	是否可以展期	本集合计划可以展期。
	展期条件	(一) 展期的条件 1、在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反本合同、《说明书》的约定；
	展期安排	2、展期没有损害委托人利益的情形； 3、托管人同意继续托管展期后的集合计划资产； 4、中国证监会规定的其他条件。
	展期实现	(二) 展期的安排 1、通知展期的时间 在集合计划到期前 3 个月且不超过 1 个月期间内。 2、通知展期的方式 管理人将通过管理人指定网站通知委托人。 3、委托人回复的方式 委托人应当在管理人指定网站公告之日起 20 个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确回复意见。 (三) 委托人不同意展期的处理办法 若委托人明确回复不同意展期，委托人有权在存续期届满日前（含届满日）到推广机构办理退出手续（管理人可以在公告中约定开放日，为委托人办理退出手续）；若委托人未在存续期届满日前（含届满日）到推广机构办理退出手续，则管理人有权决定强制将其份额退出或视为委托人同意管理人的展期安排。 若委托人未回复意见或回复意见不明确的，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。 (四) 展期的实现 如果同意集合计划展期的委托人人数不少于 2 人，则集合计划存续期将依法展期； 如果同意本集合计划展期的委托人人数低于 2 人则集合计划到期终止，将按照本合同等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。

## 终止和清算

(一) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：

- 1、计划存续期间，客户少于 2 人；
- 2、计划存续期满且不展期；
- 3、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消相关业务资格；
- 4、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消相关业务资格，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的；
- 5、管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，且没有产生新的管理人；
- 6、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，且没有产生新的托管人；
- 7、因战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；
- 8、当计划资产单位净值触及或低于 0.75 元时，本计划提前终止；
- 10、法律、行政法规及中国证监会规定的其他终止情形。

(二) 集合计划的清算

- 1、自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；
- 2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；
- 3、清算结束后 15 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定或其他合理方式以货币资金的形式全部分派给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户；
- 4、清算结束后 15 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果，并将清算结果报中国证券业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构；
- 5、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定或其他合理方式，以货币形式全部分配给委托人。

特别说明	<p>本说明书作为《海通海汇系列一星石 1 号集合资产管理计划资产管理合同》的重要组成部分，与《海通海汇系列一星石 1 号集合资产管理计划资产管理合同》具有同等法律效力，但若本说明书与资产管理合同不一致的，以资产管理合同为准。</p>
------	---