

中信建投量化策略 2 号集合资产管理计划说明书

2015 年 3 月

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》）、《证券公司客户资产管理业务规范》（以下简称《业务规范》）、《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引》（以下简称《交易指引》）、《中信建投量化策略 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称《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《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《管理合同》且合同生效后，投资者即为《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《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》、《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	中信建投量化策略 2 号集合资产管理计划
	类型	集合资产管理计划
	目标规模	本集合计划推广期与存续期规模上限为 5 亿份。单个客户参与金额不低于 100 万元，委托人数量不少于 2 人且不超过 200 人。
	管理期限	本集合计划不设固定管理期限。
	推广期	具体推广期以管理人的发行公告为准，但最长不超过 60 个工作日。在本集合计划满足成立条件的前提下，管理人有权提前结束推广期，并及时向投资者披露。
	封闭期	集合计划开放期外的时间为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。
	开放期	本集合计划成立满六个月后开放一次，此后每满三个月开放一次，每次开放三个工作日。例如，若集合计划成立日为 2015 年 3 月 10 日，则首个开放日为 2015 年 9 月 10 日、11 日、14 日（12 日为非工作日，自动向后顺延）。在开放期内，管理人为委托人办理参与和退出申请业务。具体业务办理时间以推广机构公布时间为准。以上开放日遇节假日均自动顺延至工作日。
	份额面值	人民币 1.00 元。
	分级结构	集合计划不分级
	最低金额	首次参与的单个客户参与金额不低于人民币 100 万元人民币，追加参与的最低金额为 10000 元人民币或 10000 元人民币的整数倍。
相关费率	1、托管费：0.12 %； 2、管理费：1.5 %；	
投资范围	<p>本集合计划的投资范围为：权益类资产，固定收益类资产，股指期货，现金类资产，金融监管部门批准或备案发行的金融产品，以及中国证监会认可的其他投资品种。</p> <p>权益类金融产品包括：股票（包括一级市场新股申购、参与股票增发）、证券投资基金（ETF 基金场内申购与赎回、分级型股票基金优先级、债券型和货币型证券投资基金除外）及中国证监会允许投资的其他权益类金融产品。</p> <p>固定收益类金融产品包括：国债、各类金融债（含次级债、混合资本债）、央行票据、企业债、公司债、中小企业私募债、资产支持证券、债券型基金、分级基金优先级、经银行间市场交易商协会批准在网发行的各类债务融资工具（如短期融资券、证券公司短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持票据等）以及其他债券等交易所和银行间市场交易的投资品种。</p>	

		<p>股指期货：中国金融期货交易所挂牌交易的股指期货合约</p> <p>现金类资产包括：现金、银行存款、债券逆回购、货币市场基金。</p> <p>金融监管部门批准或备案发行的金融产品包括：集合资金信托计划、商业银行理财计划、证券投资基金、证券公司专项资产管理计划、基金公司发行的特定多个客户资产管理计划、基金子公司多个客户专项资产管理计划等金融监管部门批准或备案发行的金融产品。</p>
投资比例		<p>权益类金融产品占集合计划资产净值的比例为 0-95%；</p> <p>固定收益类金融产品占集合计划资产净值的比例为 0-95%；</p> <p>现金类资产占集合计划资产净值的比例不低于 5%；</p> <p>在任何交易日日终，在扣除股指期货合约占用的交易保证金后，保持不低于集合资产管理计划资产净值 5%的现金及到期日在 1 年以内的政府债券；</p> <p>在任何时点，持有股指期货的风险敞口的绝对值不超过集合计划资产净值的 20%；</p> <p>任何交易日日终，若上述股指期货的风险敞口比例超标，应自满足交易条件始 5 个工作日内将风险敞口比例降至许可范围内。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行以及承销期内承销的证券，交易完成 10 个工作日内，管理人应书面通知托管人，并通过管理人的网站告知委托人，同时向证券交易所报告；</p> <p>如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 20 个工作日内将投资比例降至许可范围内；因证券期货市场波动、资产管理计划规模变动等证券公司之外的原因致使股指期货投资比例不符合规定的，证券公司应当在 10 个工作日内调整完毕，同时在该情形发生之日起 2 个工作日内向公司住所地证监局报告。</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，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		本集合计划属于集合资产管理计划，以绝对收益为目标，主要投资于权益类资产，属于中高风险收益特征的投资品种。
适合推广对象		认同本集合产品计划的投资理念，追求较高的绝对收益，资产流动性需求相对不高的个人高端投资者或具有资产配置需求的机构投资者。
当事人	管理人	中信建投证券股份有限公司
	托管人	兴业银行股份有限公司
	代理推广机构	中信建投证券股份有限公司及管理人公告的符合《管理办法》要求的推广机构
集合计划的参与	办理时间	在推广期内，投资者在工作日内可以参与本集合计划。具体推广期以管理人的发行公告为准，但最长不超过 60 个工作日。在本集合计划满足成立条件的前提下，管理人有权提前结束推广期，并及时向投资者披露。
	办理场所	投资者在本集合计划各推广机构可以参与本集合计划
	办理方式、程序	<ol style="list-style-type: none"> 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； 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； 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； 4、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； 5、投资者于 T 日提交参与申请后，最迟可于 T+2 日后在办理参与的网点查询参与确认情况。
	参与费	本集合计划不设置参与费

	认购资金利息	委托人的参与资金在推广期产生的利息将折算为计划份额归委托人所有。
集合计划的退出	办理时间	退出在开放期内办理。 本集合计划存续期间，由于委托人自身的原因，致使其所拥有的本集合计划份额被司法机关强制退出，责任完全由委托人自己承担。
	办理场所	委托人在原参与本集合计划的推广机构营业网点或按推广机构提供的其他方式办理本集合计划的退出。
	退出费	本集合计划不设置推出费
	单个委托人大额退出及预约申请	单个委托人从本集合计划一次退出份额达到或超过 1000 万份（含）时，认定为大额退出。 委托人须提前 2 个工作日向管理人预约申请，未预约的大额退出申请管理人有权拒绝。
	巨额退出	<p>(1) 巨额退出的认定</p> <p>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。</p> <p>(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>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： 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 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，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，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>当本集合计划发生连续巨额退出时，如管理人认为有必要，本集合计划可以暂停接受退出申请，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期支付退出金额，但延期支付期限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	<p>管理人可以以自有资金参与量化策略 2 号集合计划。</p> <p>1、自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《管理办法》、《实施细则》、《业务规范》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。</p> <p>2、自有资金的参与方式和金额：管理人可在每个开放申购期、集合计划推广期，选择参与本集合计划。</p> <p>3、自有资金参与的比例：管理人自有资金参与本集合计划的份额不超过集合计划总份额的 20%。</p> <p>4、自有资金的收益分配：管理人自有资金参与份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利。</p> <p>5、自有资金责任承担方式和金额：管理人自有资金参与份额与其他委托人持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任，不承担附加责任。</p> <p>6、自有资金退出的条件：每个开放日，管理人可以在开放期退出集合计划份额。</p> <p>7、集合计划存续期间，管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月，管理人可以根</p>	

	<p>据合同约定，参与集合计划。</p> <p>8、为应对巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，但需事后及时告知委托人和托管人。</p> <p>9、因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限时，管理人有权将超额部分退出，该部分退出份额不受管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于6个月的限制；</p> <p>10、风险揭示：管理人以自有资金参与本集合计划并不代表管理人对本集合计划的风险和收益水平作出任何形式的判断。管理人自有资金参与份额与其他委托人持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任，并不对同类份额本金或收益提供任何形式的保障。</p> <p>11、信息披露：自有资金参与份额变动情况，应当在参与和退出发生后5个工作日内在管理人网站发布公告，向委托人和资产托管机构进行披露。</p>
集合计划成立的条件、时间	<p>1、集合计划成立的条件：本集合计划的推广过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定，在推广期结束时委托人参与资金总额达到人民币3000万元（含）以上，且委托人不少于2人且不超过200人，符合集合资产管理合同和本说明书的相关规定，并满足中国证监会规定的其他条件。</p> <p>本集合计划在推广期间募集规模接近或者达到5亿份（含参与资金利息转增份额），或者委托人数达到200人时，管理人可以提前终止参与。对于已提交的参与申请将由管理人按委托人参与申请确认时间的先后顺序予以确认，超出最高募集规模的部分由推广机构退还给委托人。</p> <p>2、集合计划成立的日期</p> <p>推广结束后，管理人将聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划进行验资，并出具验资报告。验资报告出具后，管理人宣布本集合计划成立并开始运作。集合计划成立的时间以成立公告为准。</p>
集合计划设立失败	<p>集合计划推广期结束，在集合计划规模低于人民币3000万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，并将已募集资金加计中国人民银行公布的银行同期活期存款基准利率计算的利息在推广期结束后30个工作日内退还委托人。</p>
集合计划份额转让	<p>集合计划存续期间，如果监管允许，且各方面条件成熟的情况下，管理人将参照相关规定制定发布集合计划份额转让公告。客户可以按照该公告建议的流程和方式，通过证券交易所、柜台交易平台等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。</p>
费用、报酬	<p>费用种类（计提标准、方法、支付方式）</p> <p>（一）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>本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的1.5%年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 1.5\% \div 365$，其中： H为每日应计提的集合计划管理费 E为前一日集合计划资产净值</p> <p>集合计划管理费每日计提，逐日累计至每季度末，按季支付。由管理人于每季度结束后的次月首日起（含）10个工作日内向托管人发送集合计划管理费划付指令，托管人复核后于5个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期自动顺延。</p> <p>2、托管费</p> <p>本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.12%年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.12\% \div \text{当年天数}$，其中： H为每日应计提的集合计划托管费 E为前一日集合计划资产净值</p> <p>集合计划托管费每日计提，逐日累计至每季度末，按季支付。由管理人于每季度结束后的次月首日起（含）10个工作日内向托管人发送集合计划托管费划付指令，托管人复核后于5个工作日内从集</p>

		<p>合计划资产中一次性支付给托管人。遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期自动顺延。</p> <p>3、证券交易费用</p> <p>本集合计划投资运作期间，所发生的经手费、证管费、过户费、印花税、交易单元费、证券结算风险基金和期货交易交割手续费等，直接计入投资成本或者作为当期费用；其费率由管理人根据有关政策法规确定。</p> <p>本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已经扣除风险金），并在发生投资交易时按每笔成交金额计提，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>4、其他费用</p> <p>银行结算费用、银行账户维护费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>开户费、银行间交易相关维护费用、转托管费用、注册登记相关费用（包括但不限于服务月费、登记结算费、年度电子合同服务费等）等集合计划运营过程中发生的相关费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>在本集合计划存续期间发生的、与集合计划相关的审计费（按与会计师事务所签定协议所规定的金额）、律师费、信息披露费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，在相应的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。</p> <p>在本集合计划清算过程中因处置未变现集合计划资产而产生的全部费用（包括但不限于诉讼费、仲裁费、律师费、公证费、拍卖费及其他形式的资产处置费等费用），在发生时可计入本集合计划费用。</p> <p>与本集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次计入本集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应该在该会计期间内按直线法摊销。</p>
	不由集合计划承担的费用	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，不得在计划资产中列支。
	业绩报酬	<p>1、集合计划的业绩报酬计提日</p> <p>集合计划的业绩报酬计提日为存续期间每个封闭期结束后的首个开放日和集合计划终止日。</p> <p>2、业绩报酬的计提条件</p> <p>业绩报酬的计提以本次业绩报酬计提日期间（简称“业绩报酬计提期间”）的期间年化收益率为基准。业绩报酬计提期间的期间年化收益率超过业绩报酬计提基准时，管理人可以计提业绩报酬。所谓业绩报酬计提期间是指业绩报酬计提日所在的封闭期第一个自然日至封闭期最后一个自然日。</p> <p>期间年化收益率计算如下：</p> $R = (P_t - P_0) / P \times (365 \div t)$ <p>R 为本次业绩报酬计提期间的期间年化收益率；</p> <p>P_t 为本次封闭期最后一个自然日的集合计划每份额累计净值；</p> <p>P_0 为份额的面值（即人民币 1.00 元）或本次封闭期首日前一个自然日的集合计划每份额累计净值；</p> <p>P 为份额的面值（即人民币 1.00 元）或本次封闭期首日前一个自然日的集合计划每份额净值；</p> <p>t 为集合计划业绩报酬计提期间的实际天数。管理人于每个业绩报酬计提日对该日全部登记在册的集合计划份额计提业绩报酬。</p> <p>3、业绩报酬的计提和处理方法</p> <p>若集合计划份额业绩报酬计提期间的期间年化收益率高于业绩报酬计提基准，管理人计提业绩报酬。管理人根据集合计划业绩报酬计提期间的期间年化收益率超过业绩报酬计提基准的部分按照 20% 的比例计提业绩报酬。</p>

		<p>超额比例的业绩报酬计提方式如下：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>期间年化收益率</th> <th>收取比例</th> <th>管理人业绩报酬计算公式</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R \leq$ 业绩报酬计提基准</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td>$R >$ 业绩报酬计提基准</td> <td>20%</td> <td>$N \times P \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 20\% \times (t \div 365)$</td> </tr> </tbody> </table> <p>其中： N 为业绩报酬计提日集合计划的份额数； P 为为本次封闭期首日前一个自然日的集合计划每份额净值； 业绩报酬计提基准为 9%，集合计划存续期内管理人有权以公告的形式调整业绩报酬计提基准，调整业绩报酬计提基准无须征得委托人同意，新的业绩报酬计提基准自公告后的下一个封闭期开始生效。</p> <p>4、管理人业绩报酬若有计提，由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于收到指令之后的 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期自动顺延。</p> <p>管理人业绩报酬的计算、计提和复核工作由管理人完成，托管人不承担复核业绩报酬的责任。</p>	期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式	$R \leq$ 业绩报酬计提基准	0	0	$R >$ 业绩报酬计提基准	20%	$N \times P \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 20\% \times (t \div 365)$
期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式									
$R \leq$ 业绩报酬计提基准	0	0									
$R >$ 业绩报酬计提基准	20%	$N \times P \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 20\% \times (t \div 365)$									
收益分配	收益构成	<ol style="list-style-type: none"> 1、银行存款利息； 2、集合计划投资所得债券利息、基金红利； 3、买卖证券价差； 4、金融产品收益； 5、已实现的其他合法收入。 <p>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及本合同、集合计划说明书规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。</p>									
	分配方式	<ol style="list-style-type: none"> 1、委托人可以选择现金分红或红利再投资分红方式。根据现有规则，委托人在同一推广机构处多次参与本集合计划且选择不同分红方式的，其所持有的在该推广机构处认购和申购的且未赎回的全部份额的分红方式以其最后选择的分红方式为准。委托人同意遵守注册登记机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订以及以后新制订的规则）。管理人分红时以注册登记机构登记的分红方式为准。 2、委托人可以选择将所获红利再投资于本集合计划，选择采取红利再投资形式的，分红资金按分红除权日的本集合计划每份额净值（免收参与费用）转成本集合计划份额。集合计划份额计算要保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入本集合计划资产的损益。 3、委托人采取分红再投资形式增加的集合计划份额不受存续期规模上限限制。 4、对于选择现金分红的委托人，委托人自行承担在收益分配时发生的银行转账等手续费。 <p>管理人在履行合同变更程序后可以更改本集合计划的分红方式并事先在管理人网站通告本集合计划委托人。</p>									
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	<ol style="list-style-type: none"> 1、在存续期间，集合计划运营规范，管理人、托管人未违反集合计划合同、说明书的约定； 2、集合计划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。 									
	展期安排	<ol style="list-style-type: none"> 1、通知展期的时间 <p>管理人在获得托管人同意继续托管展期后的集合计划资产的意见后的五个工作日内在管理人网站进行公告，对集合计划展期事宜进行说明。</p>									

		<p>2、通知展期的方式</p> <p>管理人决定展期的，将在管理人网站进行公告，管理人须在公告后十个工作日内以书面或电子等方式向委托人发送展期征询意见。</p> <p>3、委托人回复的方式</p> <p>委托人如同意参与集合计划展期，应在公告规定期限内按照管理人公告规定的形式作出答复；未在规定时间内作出答复的，视为同意本集合计划展期。</p>
	展期实现	<p>1、如果展期后的集合资产管理合同、计划说明书与原集合资产管理合同、计划说明书有变更之处，管理人将在其指定网站上对新的集合资产管理合同、计划说明书进行公告。</p> <p>2、同意本集合计划展期的委托人的人数不少于2人，且原存续期届满日符合展期条件的，本集合计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本集合计划不能展期。</p> <p>3、本集合计划可以连续展期，且展期次数不限。</p>
终止和清算		<p>(一) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、集合计划存续期间，委托人少于2人； 2、集合计划存续期满且不展期； 3、集合计划管理人因重大违法违规，被中国证监会依法取消相关业务资格，责令停业整顿； 4、集合计划管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责； 5、集合计划托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格，且原托管人不能履行相应职责后的3个月（含）内无其他适当的托管人承接其原有的权利和义务； 6、集合计划托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，且原托管人不能履行相应职责后的3个月（含）内无其他适当的托管人承接其原有的权利和义务； 7、当出现不能预见，不能避免，不能克服的客观情况，包括但不限于自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化、或其他突发事件、注册登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等不可抗力，将会严重影响证券市场的运行，可能导致集合计划不能存续； 8、其他终止的情形。 <p>(二) 有下列情形之一的，管理人有权终止本集合计划：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、本集合计划连续20个交易日日均资产净值低于3000万人民币； 2、因市场变化或其他因素，管理人无法找到合适的投资标的； 3、管理人认定的其他应当终止的情形，在征得托管人同意后，可以终止本集合计划。 <p>(三) 集合计划的清算</p> <ol style="list-style-type: none"> 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3个工作日内，管理人申请注销股指期货交易编码，并在5个工作日内向公司住所地证监局报告。 4、清算结束后7个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、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； 5、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； 6、若本集合计划在终止之日有未能变现的证券或资产，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，对前述未能变现的证券或资产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，以货币形式全部分配给委托人。

特别说明

本说明书作为《管理合同》的重要组成部分，与《管理合同》具有同等法律效力。