

财通证券资管润富东北 1 号集合资产管理计划说明书

二零一六年

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《细则》）、《私募投资基金监督管理暂行办法》（以下简称“《暂行办法》”）、《财通证券资管润富东北 1 号集合资产管理计划管理合同》（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，不存在任何虚假内容、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，并符合《管理办法》、《细则》、《暂行办法》及本说明书中关于“合格投资者”的要求，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，但不保证集合计划资产本金不受损失，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》、《细则》、《暂行办法》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

集 合 计 划 基 本	名称	财通证券资管润富东北 1 号集合资产管理计划
	类型	集合资产管理计划
	目标规模	本集合计划推广期规模上限为 10 亿份(不含参与资金利息转增份额)，存续期规模上限为 50 亿份。管理人可公告调整本集合计划及本集合计划各类份额在推广期和存续期的规模上限。
	管理期限	本集合计划不设固定管理期限。

信息	推广期	指自本集合计划启动推广之日起不超过 60 个工作日的期限, 具体推广时间本集合计划管理人安排为准。
	封闭期	本集合计划存续期内除开放期 (含特别开放期) 以外的其他时间, 不办理参与、退出等业务。
	开放期	<p>本集合计划各类份额的推广时间或首个开放参与日由管理人公告确定。A1、A2、A3 类份额的开放期为对应份额的运作周期到期日, 接受对应份额委托人的参与和退出申请 (管理人公告暂停进入新的一期运作周期的情形除外)。若管理人公告暂停进入新的一期运作周期, 该类份额在当期运作周期结束后自动退出。其他份额的开放参与日和运作周期到期日由管理人公告确定。此外, 管理人有权增设各类份额的开放期, 接受对应份额委托人的参与或退出申请, 具体见管理人公告。</p> <p>若本合同发生变更, 且在合同变更公告日起至合同变更生效日内无开放期的, 则管理人将合同变更生效日前的 1 个工作日设置为特别开放期, 接受委托人的赎回申请。</p>
	份额面值	人民币 1.00 元。
	份额分类	<p>本集合计划的份额根据开放期、运作周期的不同进行分类, 分别为A1、A2、A3……An类份额。A1、A2、A3……An类份额不定期发售, 且均有各自的运作周期。本集合计划各类份额的推广时间或首个开放参与日由管理人公告确定。</p> <p>A1、A2、A3类份额的运作周期均为21天左右, 每期的运作周期起始日为对应份额上一运作周期到期日之后的首个工作日, 每期的运作周期到期日为对应份额上一运作周期到期日当周结束后第三周的周二, 若该周二为非工作日, 则顺延至下一个工作日; 对于在推广期推广的各类份额的首个运作周期, 其运作周期起始日为计划成立日, 到期日为计划成立日当周结束后第三周的周二, 若该周二为非工作日, 则顺延至下一个工作日; 对于未在推广期推广的各类份额的首个运作周期, 前述“上一运作周期到期日”指的是对应份额的首个参与日。A4、A5……An</p>

	<p>类份额的运作周期由管理人公告确定。</p> <p>管理人有权在各类份额每期运作周期开始前公告设定对应份额的参与日、运作周期到期日、开放规模上限、委托人数量上限、业绩报酬计提基准、参与安排及单个委托人参与规模上限等规则。对于A4、A5……An类份额，经过该类份额所有委托人及管理人的同意，该类份额的运作周期到期日可以提前或者延后，且管理人有权重新公告约定该类份额当期的业绩报酬计提基准。对于提前到期的份额，管理人重新公告的当期业绩报酬计提基准原则上不高于原基准的70%。</p> <p>各类份额的每期运作周期到期之前，管理人均有权公告暂停该类份额进入新的一期运作周期。若管理人暂停该类份额进入新的一期运作周期，则该类份额在当期运作周期结束后自动退出。若管理人未公告暂停，则该类份额默认将在当期运作周期结束后继续进入新的一期运作周期，该类份额持有人可在当期运作周期到期日选择退出；若未退出，则默认自动参与该类份额的下一个运作周期。此外，管理人有权在暂停某类份额进入新的一期运作周期后，择时重启新的运作周期，并在管理人网站公告新的参与日与运作周期起始日。</p> <p>各类份额的委托人可以以书面形式委托管理人对其份额在对应运作周期到期日进行自动退出，具体委托方式根据推广机构的要求办理。</p>
最低参与金额	<p>单个委托人首次参与本集合计划各类份额的最低参与金额为100万元，超过最低参与金额的部分不设金额级差；追加参与的最低参与金额为5万元，超过最低参与金额的部分不设金额级差。本计划各类份额的最低参与金额具体以管理人公告为准。管理人有权公告调整某类份额首次参与及追加参与时的最低参与金额与金额级差。</p> <p>首次参与指提出参与本集合计划各类份额申请的委托人在参与之前未持有本集合计划相应份额的情形。</p>

相关费率	<p>1、参与费率： 0%</p> <p>2、退出费率： 0%</p> <p>3、管理费率： 0.30%/年</p> <p>4、托管费率： 0.05%/年</p> <p>5、业绩报酬：本计划有权对委托人持有的集合计划各类份额年化收益率超过对应份额当期业绩报酬计提基准的部分按 100% 的比例计提业绩报酬。</p>
投资范围	<p>1、投资范围</p> <p>本集合计划主要投资于国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、短期融资券、中期票据(含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具)、证券回购、资产支持证券、债券型基金、货币市场型基金、银行存款、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会认可的其他固定收益类投资品种。</p> <p>其中企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、中期票据、资产支持证券的债项或发行人主体或担保人主体信用等级不低于 AA；短期融资券发行人主体信用等级不低于 AA。</p> <p>2、投资比例</p> <p>(1) 固定收益类资产：占计划资产总值的 0-100%；包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、短期融资券、中期票据(含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具)、资产支持证券、债券型基金、债券逆回购等；本集合计划投资于单只债券的比例(按券面计算)不高于计划资产总值的 30%；</p> <p>(2) 现金类资产：占计划资产总值的 0-100%；现金类资产包括现金、银行存款(包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款)、同业存单、货币市场基金、期限为 7</p>

		<p>天内（含7天）的债券逆回购、期限在1年内（含1年）的国债、到期日在1年内（含1年）的央行票据、到期日在1年内（含1年）的政府债券等高流动性短期金融产品等；</p> <p>（3）证券正回购：融入资金余额不超过计划资产净值的40%，中国证监会另有规定的除外。</p>
	<p>风险收益特征及适合推广对象</p>	<p>本计划主要投资于固定收益类和现金类资产，属于中低风险证券投资产品，适合能承受中低风险的合格投资者。</p> <p>集合资产管理计划应当面向合格投资者推广，合格投资者累计不得超过200人。合格投资者是指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力且符合下列条件之一的单位和个人：（一）净资产不低于1000万元的单位；（二）金融资产不低于300万元或者最近三年个人年均收入不低于50万元的个人。社会保障基金、企业年金等养老基金、慈善基金等社会公益基金、依法设立并在基金业协会备案的投资计划、投资于所管理私募基金的私募基金管理人及其从业人员以及中国证监会规定的其他投资者视为合格投资者。金融资产包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货权益等。</p>
当 事 人	管理人	财通证券资产管理有限公司
	托管人	宁波银行股份有限公司
	推广机构	<p>东北证券股份有限公司。</p> <p>管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的推广机构代理销售本集合计划，管理人新增或变更本集合计划的代理推广机构时，将提前在管理人网站上公告。</p>
集 合 计 划 的	办理时间	<p>（1）推广期参与</p> <p>在推广期内，投资者在每个工作日内可以参与本集合计划。推广时间等推广安排由管理人公告确定。管理人可根据集合计划销售情况在募集期限内适当延长或缩短本集合计划的发售时间，并及时公告。</p>

参与		<p>管理人有权根据集合计划资金募集情况，决定是否提前结束推广期，并采用“时间优先、金额优先”的原则避免出现募集份额超过集合计划目标规模上限的情况。</p> <p>管理人在 T+1 日对委托人参与申请的有效性进行确认，委托人可在集合计划正式成立后到其办理参与的推广机构查询成交确认结果。</p> <p>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。</p> <p>(2) 存续期参与</p> <p>投资者在本集合计划存续期内的各类份额开放期内可以办理对应份额的参与业务。本集合计划 A1、A2、A3 类份额的开放期为对应份额的运作周期到期日，接受对应份额委托人的参与和退出申请（管理人公告暂停进入新的一期运作周期的情形除外）。若管理人公告暂停进入新的一期运作周期，该类份额在当期运作周期结束后自动退出。其他份额的开放参与日和运作周期到期日由管理人公告确定。此外，管理人有权增设各类份额的开放期，接受对应份额委托人的参与或退出申请，具体见管理人公告。</p>
	办理场所	<p>委托人根据推广机构的程序，到推广机构指定网点或管理人直销柜台申请参与集合计划，或登录推广机构指定网络系统以自主下单方式申请参与集合计划。</p>
	办理方式、程序	<p>(1) 本集合计划的参与申请根据不同推广机构的程序，采用电子签名或纸质签名的方式提交。采用电子签名方式的委托人应当根据推广机构的要求签署纸质的电子签名约定书或如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，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。采用纸质签名方式的委托人需签署纸质的风险揭示书、签订纸质的合同。委托人根据推广机构的程</p>

	<p>序,到推广机构指定网点或管理人直销柜台申请参与集合计划,或登录推广机构指定网络系统以自主下单方式申请参与集合计划。</p> <p>(2) 委托人按推广机构的具体安排,在规定的交易时间段内提交参与申请;</p> <p>(3) 通过管理人直销方式参与集合计划的,委托人开设管理人认可的集合资产管理计划/基金账户,并在有效时间内将足额资金划入管理人指定的直销账户中,并保证汇款人名称与开立集合资产管理计划/基金账户的持有人名称一致。委托人指定关联的银行卡作为办理红利款项、退出款项、清算款项的收款账户。委托人应承诺在《管理合同》有效期内,不得撤销该账户,并妥善保管账户资料;通过其他推广机构参与集合计划的,委托人应按照推广机构的相关规定和程序提交参与申请。</p> <p>(4) 委托人签署《管理合同》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《管理合同》的有效组成部分;委托人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) 委托人推广期参与的,可于计划成立后到办理参与的推广机构查询参与确认情况。委托人存续期参与的,于T日提交参与申请后,可于T+3日后在办理参与的推广机构查询参与确认情况。确认无效的申请,推广机构将退还委托人已交付的参与款项本金。</p>
参与费	<p>(1) 参与费率:本集合计划免收参与费,即参与费率为0%;</p> <p>(2) 参与份额的计算方法:</p> <p>①推广期参与</p> <p>净参与金额=参与金额/(1+参与费率);</p> <p>参与份额=(净参与金额+推广期内产生的利息)/计划单位面值。</p> <p>②存续期参与</p>

		<p>净参与金额=参与金额/（1+参与费率）；</p> <p>各类份额参与份额=净参与金额/T日对应份额的单位净值。</p> <p>委托人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	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	<p>投资者在本集合计划存续期内的各类份额开放期内可以办理对应份额的退出业务。本集合计划 A1、A2、A3 类份额的开放期为对应份额的运作周期到期日，接受对应份额委托人的参与和退出申请（管理人公告暂停进入新的一期运作周期的情形除外）。若管理人公告暂停进入新的一期运作周期，该类份额在当期运作周期结束后自动退出。其他份额的运作周期到期日由管理人公告确定。此外，管理人有权增设各类份额的开放期，接受对应份额委托人的参与或退出申请，具体见管理人公告。</p> <p>若《管理合同》发生变更，且在合同变更公告日起至合同变更生效日内无开放期的，则管理人将合同变更生效日前的 1 个工作日设置为特别开放期，接受委托人的赎回申请。</p>
	办理场所	委托人可以到推广机构网点、管理人直销柜台或通过推广机构的指定系统提出退出申请。
	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规定的手续，在退出业务的办理时间内向推广机构网点、管理人直销柜台或通过推广机构的指定系统提出退出申请。委托人申请的退出申请份额数量超过委托人持有的份额数量时，申请无效。</p> <p>（2）退出申请的确认</p> <p>当日（T 日）在交易时间内提交给管理人的赎回申请，委托人通常可在 T+2 日之后到其办理退出的推广机构查询退出的确认情况。</p> <p>（3）退出款项划付</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。
退出费	本集合计划免收退出费。
单个委托人大额退出	本集合计划不设单个委托人大额退出限制条款，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	<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、部分顺延退出或暂停退出。</p> <p>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。</p> <p>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，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。</p> <p>暂停退出：集合计划连续两个开放日（含两个开放日）发生巨额退出的，如集合计划支付委托人的退出申请可能会对集合计划的资产净值造成较大波动，管理人可以暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项。暂停和延缓期限不得超过 20 个工作日。</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网站公告，并说明有关处理方法。</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本集合计划，自有资金参与比例最高不超过计划总份额的 20%。</p> <p>自有资金的收益分配按照《管理合同》“十四、集合计划的收益分配”对收益分配约定进行。自有资金认购的集合计划份额所取得的现金分红收益归管理人所有。</p> <p>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的，管理人应当在超限之日起的 10 个工作日内将部分自有资金参与份额退出或提高集合计划规模，以符合法规要求。</p> <p>本集合计划存续期间，管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得少于 6 个月（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的，管理人退出部分自有资金的情形除外）。参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知客户（告知方式包括但不限于通过管理人网站公告）和资产托管机构。</p> <p>为应对集合计划流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人以自有资金参与或退出集合计划可不受前款规定限制，但需事后及时告知客户和资产托管机构。</p>
集合计划成立的条件、时间	<p>集合计划的参与资金总额（含参与费）不低于 3000 万元人民币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注册登记机构指定的募集账户、管理人指定的直销账户或集合计划托管账户，不得动用。</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，并将已认购资金及按照中国人民</p>

	<p>银行发布的同期人民币活期存款利率计算的利息在推广期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人。</p>
<p>费用、 报酬、 风险 准备金</p>	<p>费用种类</p> <p>(一) 费用种类</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人的管理费； 2、托管人的托管费； 3、证券交易费用； 4、证券账户开户费； 5、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用； 6、本集合计划成立后的会计师费和律师费； 7、按照国家有关规定可以列入的其他费用。 <p>本合同下所涉的所有费率均为含税费率。</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资产净值计提，管理费的年费率为 0.30%，具体计算方法如下：</p> $H = E \times 0.30\% \div 365$ <p>H 为每日应计提的管理费 E 为前一日集合计划资产净值</p> <p>管理费按日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人出具的划款指令于次季首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。</p> <p>2、托管费</p> <p>托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05%年费率计提，具体计算方法如下：</p> $H = E \times 0.05\% \div 365$ <p>H 为每日应计提的托管费 E 为前一日集合计划资产净值</p> <p>托管费按日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人出具的划款指令于次季首日起 5 个工</p>

		<p>作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。</p> <p>3、证券交易费用</p> <p>本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资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，作为交易成本直接扣除。</p> <p>4、证券账户开户费用：证券账户开户费由托管人在开户时先行垫付，集合计划在证券账户开户后一个月内成立的，自证券账户开户后一个月内由托管人从集合计划中扣划；如证券账户开户后一个月内集合计划未能成立，由管理人在收到托管人缴费通知后的5个工作日内支付给托管人，托管人不承担垫付开户费用义务。</p> <p>5、其他费用：包括集合计划成立后的电子合同服务费、中债数据服务费、信息披露费用、注册登记费用、会计师费和律师费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，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>不由集合计划承担的费用</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。本集合计划注册登记费用不列入集合计划费用项目。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>
	<p>业绩报酬</p>	<p>1、管理人提取业绩报酬的原则</p> <p>（1）本计划有权对委托人持有的集合计划各类份额年化收益率超过对应份额当期业绩报酬计提基准的部分按100%的比例计提业绩报酬；</p>

(2) 同一委托人不同时间多次参与本计划的,对委托人每笔参与与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬;

(3) 业绩报酬计提日为:各类份额的现金分红日、委托人退出日及计划终止日。

2、业绩报酬的计提方法

在各类份额的业绩报酬计提日,若对应份额在业绩报酬计提期间所获得的年化收益率(r)小于或等于对应份额当期业绩报酬计提基准(k),则管理人不提取业绩报酬;若年化收益率(r)大于对应份额当期业绩报酬计提基准(k),则管理人可以对超出部分按 100%的比例提取业绩报酬。

管理人业绩报酬计提方法如下:

年化收益率(r)	计提比例	业绩报酬(H)计算方法
$r \leq k$	0	0
$r > k$	100%	$H = (r - k) \times 100\% \times S \times D$

其中, S 为集合计划该类份额中委托人单笔参与的份额数; D 为上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限(1年按 365 天计算)。如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提日,则推广期参与的为集合计划成立日,存续期参与的为参与日。

3、业绩报酬的支付

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成,由管理人向托管人发送划付指令,托管人于收到指令后 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。

风险准备金

在每个业绩报酬计提日,管理人按照 100%的比例从每笔业绩报酬中计提管理人风险准备金。

在各类份额进行现金分红、退出和计划终止时,若对应份额当期实际年化收益率低于当期对应份额的业绩报酬计提基准,管理人将以风险准备金余额为上限,弥补对应份额持有人的收益

		<p>至其业绩报酬计提基准。若不同类的份额同时发生需要弥补收益的情形，管理人将以风险准备金余额为上限，按照同时发生需要弥补收益情形的各类份额的份额数占所有需要弥补的份额数的比例，弥补对应份额持有人的收益至其业绩报酬计提基准。</p> <p>若在每个自然季度（不包含第四季度）的最后一个工作日，本计划风险准备金余额大于零，管理人可以以不超过 50%的比例提取风险准备金归管理人所有；若在每个会计年度的最后一个工作日，本计划风险准备金余额大于零，管理人可以部分或全部提取风险准备金归管理人所有。集合计划终止清算时，所有剩余风险准备金归管理人所有。</p>
收益分配	收益构成	<p>本集合计划收益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收益减去公允价值变动收益后的余额。</p>
	分配原则	<ol style="list-style-type: none"> 1、不同类别的每份份额享有同等收益，每一份额每日享有同等分配权。 2、收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值。 3、本集合计划收益分配时，只采用现金红利方式。 4、本集合计划各类份额每日结转收益，并在运作周期到期日将该运作周期的累计收益扣除业绩报酬和风险准备金(如有)等之后进行集中支付。对于除了 A1、A2、A3 类以外的其他份额，管理人可以在运作周期到期日之前按照一定频率对累计收益扣除业绩报酬和风险准备金(如有)等之后进行集中支付，具体见管理人公告。 5、当日参与的集合计划份额自下一工作日起享有收益分配权益；当日退出的集合计划份额自下一工作日起，不享有收益分配权益。 6、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担，与收益分配的相关税赋由委托人自行承担。

		<p>7、在收益分配基准日，若管理人使用风险准备金弥补收益后累计收益仍为负值，管理人应相应缩减投资者所持有的份额；</p> <p>8、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>
集合计划份额的转让		集合计划存续期间，在条件允许的情况下，委托人可以通过柜台交易市场等中国证监会认可的交易平台向合格投资者转让集合计划份额。受让方首次参与集合计划，应满足合格投资者的条件，并先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。
集合计划展期		本集合计划不设置展期条款。
终止和清算		<p>(一) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <p>1、计划存续期间客户少于 2 人；</p> <p>2、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；</p> <p>3、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；</p> <p>4、管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>5、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>6、因战争、自然灾害等不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；</p> <p>7、根据《管理合同》约定需要提前终止计划的情形；</p> <p>8、法律、行政法规、《管理合同》及中国证监会规定的其他终</p>

01020057129

	<p>止情形；</p> <p>9、管理人认为必要时可以终止本计划。</p> <p>（二）集合计划的清算</p> <p>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；</p> <p>2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</p> <p>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托管账户；</p> <p>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；</p> <p>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《管理合同》的约定或其他合理方式，以货币形式全部分配给委托人；</p> <p>6、管理费、托管费计提规则是以当日资产净值为基数在下一日计提，对于合同最后一日管理费、托管费则以当日资产净值为基数在当日计提；</p> <p>7、管理人应匡算合同终止日下一个月的最低备付金及交易保证金，并保证有足够的资金进行场内清算。</p>
<p>特别说明</p>	<p>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。</p>