

海通沪盈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》）、《海通沪盈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	海通沪盈集合资产管理计划
	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 5000 万份，存续期不设上限。本集合计划委托人数量为 2 人以上（含）200 人以下（含）。
	管理期限	本集合计划管理期限 2 年，管理人可在与委托人协商一致后提前终止本集合计划，或展期本合同期限。
	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，具体时间以本集合计划推广公告为准。
	封闭期	本集合计划不设封闭期。
	开放期	本集合计划自成立日起进入开放期。开放期内的每个工作日为开放日，管理人在开放日为委托人办理参与/退出业务。
	份额面值	人民币 1.00 元。
	分级结构	本集合计划不进行分级。
	本集合计	本集合计划的单个委托人首次参与金额不得低于 100 万元人民币，追加参

划组合单 元的最低 金额	与的最低金额为人民币 10,000 元, 超过最低参与金额的部分不设金额级差。
相关费率	1、认购/申购费: 0% 2、退出费: 0% 3、管理费: 0.10%/年 4、托管费: 0.02%/年 5、业绩报酬 本集合计划不收取业绩报酬。 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。
投资范围	本集合计划主要投资于 (1) 流动性资产: 现金、银行存款、大额可转让存单、协议存款、银行间市场/交易所市场债券质押式回购/交易所债券质押式协议回购(买断式逆回购除外)、交易所债券质押式协议回购、货币基金等; (2) 固定收益类资产: 包括但不限于在银行间/交易所市场流通的国债、地方政府债、政策性金融债、中央银行票据、企业债(含项目收益债)、超短期融资券、短期融资券、中期票据、非公开定向发行债务融资工具(PPN)、商业银行/证券公司次级债、证券公司短期债、混合资本债、资产支持证券(次级份额除外)、公司债(包含小公募债及非公开发行的公司债)、可转债、可交换债等; 分级基金优先级份额、债券型基金、国债期货等; (3) 其他: 新的标准化投资品种需经全体委托人书面同意可纳入投资范围。 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。
资产配置 比例	(1) 固定收益类资产: 占计划资产的 0—100%; 固定收益类资产包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、可转换债券、可分离债、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、分级基金优先级份额、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、债券逆回购; (2) 现金类资产: 占本计划资产总值的 0-100%, 主要包括现金、银行存款、货币市场基金、期限在 1 年内(含 1 年)的国债、期限在 1 年内(含 1 年)的央行票据、期限在 1 年内(含 1 年)的政府债券以及不超过 7 天的债券逆回购; (3) 债券正回购: 融入资金余额不超过计划资产净值的 40%。 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的证券或承销期内承销的证券。交易完成之日起 5 个工作日内, 管理人应书面通知托管人, 通过管理人指定网站告知委托人, 并向证券交易所报告, 同时采取切实有效的措施, 防范利益冲突, 保护客户合法权益。 管理人应当在本集合计划成立之日起 3 个月内使本集合计划的投资组合比例符合以上约定。 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 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内; 如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素, 造成集合计划投资比例超标, 管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。如遇限售期等原因导致交易条件不具备, 则上述期限自动顺延。
	风险收益特征	本计划属于债券型集合资产管理计划, 计划整体属于风险和期望收益水平中等的品种, 适合推广对象为管理人和推广机构现有的客户且为合格投资者。以上风险评级由管理人确定, 推广机构的风险评级可能与此不同。
	适合推广对象	本计划推广对象为推广机构现有的客户且为合格投资者。
	当事人	
当 事 人	管理人	上海海通证券资产管理有限公司
	托管人	招商银行股份有限公司上海分行
	代理推广机构	上海海通证券资产管理有限公司

集合计划的参与	办理时间	(1) 推广期参与 在推广期内，投资者在每个工作日可以参与本集合计划。推广时间等推广安排等由管理人公告确定。管理人有权根据实际募集情况，决定延长或提前结束推广期。 (2) 存续期参与 本集合计划参与的开放日为本集合计划存续期的每个工作日，管理人按照本合同约定拒绝委托人参与的工作日除外。
	办理场所	本集合计划参与将通过推广机构下属指定营业网点或推广机构指定网络系统办理集合计划的参与。
	办理方式、程序	(1) 在推广期和存续期，管理人有权仅接受管理人指定的投资者参与； (2) 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； (3) 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； (4) 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； (5) 委托人可多次参与本集合计划，参与申请一经确认不可更改或撤销； (6) 投资者在推广期内提交的参与申请可于推广期结束后的第 2 个工作日内在办理参与的网点查询参与确认情况；直销的投资者可以在 T+1 日查询确认； (7) 本集合计划采用电子签名合同或纸质合同的方式签署。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； (8) 委托人同意，参与申请的情况以管理人确认的结果为准。本集合计划管理人有权仅接受管理人认可的委托人的参与申请。

	参与费	(1) 参与费率: 0%; (2) 参与份额的计算方法: ①推广期参与份额 = 参与金额 / 计划单位面值 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。 ②存续期参与份额 = 参与金额 / T 日集合计划的单位净值 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。
	认购资金利息	委托人的参与资金在推广期产生的利息将在推广期结束后划入集合计划托管账户, 不折算为委托人份额, 利息金额以注册登记机构为准。
	办理时间	本集合计划存续期内的每个工作日均为开放退出日, 管理人按照合同约定拒绝委托人退出的工作日除外。
集合计划的退出	办理场所	本集合计划的办理场所为推广机构网点。
	办理方式、程序	1) 退出申请的提出 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。份额退出申请数量超过委托人持有份额数量时, 申请无效。 (2) 退出申请的确认 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。 T 日指委托人提出申请日, 如为管理人自动发起业务则指业务发起日。 直销的投资者可以在 T+1 日向管理人查询确认。 (3) 退出款项划付 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。对于通过直销方式参与份额, 退出款项可以在 T+1 日内从托管账户划出, 但具体划款时间由管理人确定, 最晚不超过 T+2 日。 由于交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程, 则退出款

	顺延至管理人及托管人无法控制的因素消除后划往委托人账户。
退出费	(1) 退出费用: 0%。 (2) 退出金额的计算方法 本集合计划退出时以申请日集合计划单位净值作为计价基准, 退出金额的计算公式如下: $\text{退出金额} = \text{退出份额} \times T \text{ 日集合计划的单位净值}$ 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计划资产损益。
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 (认定标准、退出顺序、退出价格确定、退出款项支付、告知委托人的方式)	(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)超过上一工作日集合计划总份额数的 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 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。

	(3) 告知客户的方式 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。
连续巨额退出(认定标准、退出顺序、退出价格确定、退出款项支付、告知委托人的方式)	(1) 连续巨额退出的认定 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。 (2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付 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。
管理人自有资金参与情况	管理人可以以自有资金参与本集合计划。 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》、《细则》、《规范》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。 2、自有资金的参与方式: (1) 推广期间与存续期间,管理人可以参与集合计划份额; (2) 存续期间,管理人可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台以受让方式持有集合计划份额。 3、自有资金参与的金额和比例: 管理人以自有资金参与本集合计划,参与份额不超过本集合计划份额总数的 1%。 4、自有资金的收益分配:管理人自有资金参与的份额按照本合同的规定享有收益分配,并承担相应责任。 5、自有资金责任承担方式 管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他委托人持有的份额享有同等权利和义务。

	6、自有资金退出的条件： （1）管理人自有资金参与本集合计划持有的份额在符合法律、行政法规等关于自有资金退出规定的情况下，可以与其他委托人同样办理退出业务。 （2）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过法律、法规规定比例； （3）已经提前 5 个工作日告知委托人和托管人，告知方式包括在管理人指定网站公告或书面告知等方式。 管理人自有资金持有的集合计划份额均可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让给其他投资者。 7、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，参与、退出时应当提前 5 个工作日通过管理人指定网站告知委托人和托管人；但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过法律、法规规定比例，而导致管理人自有资金退出的可以不受本条前述约定限制。 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，但需事后及时通过管理人指定网站告知委托人和托管人，并向管理人所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。 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过法律、法规规定的比例时的处理原则及处理措施：管理人可以临时开放本集合计划，退出超限部分的集合计划份额。同时，管理人应及时在管理人指定网站公告自有资金参与集合计划被动超限情况，包括超限比例、超限原因、处理方案等。 10、风险揭示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注计划规模变动情况，控制流动性风险。 11、信息披露：管理人及时在管理人指定网站公告自有资金参与和退出情况。
集合计划成立的条件、时间	在本集合计划推广期内，若集合计划的参与资金总额不低于 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。
集合计划设立失败（本金及利息返还方式）		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，并将已认购资金及同期活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。利息具体金额以管理人的确认结果为准。
集合计划份额的 转让、非交易过 户、冻结和转换		（一）集合计划份额的转让 集合计划存续期间，委托人可以通过证券交易所或柜台交易市场等中国证 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。管理人有权决定是否开放计划份额 的转让业务。 （二）集合计划份额的非交易过户 非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份 额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账 户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其 他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易 过户申请按登记结算机构的有关规定办理。 （三）集合计划份额的冻结 集合计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻 结与解冻事项。 （四）集合计划份额的转换 管理人可以根据相关法律、行政法规以及集合资产管理合同的规定，视实 际情况决定办理本集合计划与管理人管理的其他集合计划之间的转换业务之 间的份额转换业务，集合计划之间的转换可以收取一定的转换费用，相关业 务规则由管理人提前在管理人指定网站上披露。原则上，管理人可以通过强 增/强减等合理的业务路径办理相关转换业务。 本集合计划是否可办理份额转换业务以管理人确认为准，管理人有权仅为 指定的委托人办理份额转换业务。
费	费用种类	1、管理费：

用、报、酬	(计提标准、方法、支付方式)	1、管理费： 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 0.1%。计算方法如下： $H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$ 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 管理费在运作期间每日计提，逐日累计，每运作满一年以及本合同终止日（含提前终止日）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管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。 2、托管费： 本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的 0.02% 年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.02\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的托管费； E 为前一日集合计划资产净值。 托管费每日计提，逐日累计，每运作满一年以及本合同终止日（含提前终止日）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。 3、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。 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。 4、与本集合计划相关的审计费 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。 5、其他费用： 上述（一）中第3、4、5项费及集合计划的开户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。 6、管理费和托管费的调整 管理人可调减管理费，也可经与托管人协商一致后调减托管费，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。
	不列入集合计划费用的项目	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。 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。
	业绩报酬	本集合计划不收取业绩报酬。
收益分配	收益构成	收益包括：集合计划投资所得债券利息、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。
	分配原则	（三）收益分配原则 1、收益分配后的计划单位净值不得低于集合计划单位面值； 2、本集合计划发生现金收益分配、本金归还等现金支付时，银行收取的与此有关的任何费用均由委托人承担； 3、本集合计划进行收益分配、本金归还时所涉及的相关税负由委托人自行承担，管理人、托管人均不承担代扣代缴等纳税义务； 4、若本集合计划在存续期间不进行收益分配，则本集合计划也可在终止清算后将货币资金分派给委托人，由此产生的相关的税负由委托人自行承担，管理人、托管人均不承担代扣代缴等纳税义务； 5、收益分配金额由管理人负责计算，托管人负责资金汇划； 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。
	分配方式	
	分配方案	

		(四) 收益分配方式 本集合计划默认的收益分配方式为现金分红, 委托人可以选择现金分红或者红利再投资分红方式。委托人选择红利再投资分红方式的, 分红资金按分红除权日当日的单位净值自动转为本集合计划的份额, 免收参与费(红利再投资不受本计划份额上限的限制); 委托人选择现金分红方式的, 管理人将现金红利款划往推广机构账户, 再由推广机构划入委托人账户, 现金红利款自款项从集合计划资金账户划出之日起 7 个工作日内到达委托人账户。 红利再投资形成的集合计划份额计算保留到小数点后两位, 小数点后两位以后的部分采用去尾法, 由此产生的差额部分计入集合计划资产。 自本集合计划成立之日起, 管理人应于收益分配基准日起 10 个工作日内向托管人发送当期收益分配指令, 托管人在复核后 5 个工作日内划入委托人指定收取收益的账户。 (五) 收益分配方案的确定与披露 1、收益分配方案载明集合计划收益分配对象、可供分配利润、收益分配对象、分配原则、分配时间、分配金额及比例、分配方式等内容; 2、收益分配方案由管理人拟定, 经托管人复核后确定, 并由管理人至少在 T-2 日(T 为权益登记日)之前将收益分配方案以至少一种指定方式进行信息披露。 (六) 集合计划收益分配程序 1、管理人将集合计划收益分配方案通知托管人, 并向委托人公告经托管人复核后的收益分配方案; 2、在分配方案公布后, 管理人制定具体分配事宜, 并就现金分红的金额(如有)向集合计划托管人下达付款指令, 托管人按照管理人的指令及时进行分红资金清算; 3、管理人和托管人分别进行收益分配的账务处理。
集合计划	是否可以展期	本集合计划期限为两年, 可提前终止, 可展期
	展期条件	
	展期安排	

展 期	展期实现	
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、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； 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； 4、管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责； 5、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责； 6、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； 7、管理人认为可以提前终止的情况； 8、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，对于由计划交纳、注册登记机构收取的最低结算备付金和交易席位保证金，在注册登记机构对其进行调整交收日才能收回，托管账户、结算备付金及交易保证金账户利息于实际结息时才能收回，届时，集合计划清算小组将及时按照委托人拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分配给委托人，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指定网站向委托人披露清算结果； 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，并通过管理人指定网站进行披露。

	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	本说明书作为《资产管理合同》的重要组成部分，与《资产管理合同》具有同等法律效力。 但若本说明书内容与《资产管理合同》不一致的，以《资产管理合同》为准。