

## 长江资管长旭1号集合资产管理计划说明书

\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日

### 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》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》(以下简称《暂行规定》)、《长江资管长旭1号集合资产管理计划资产管理合同》(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,所披露或提供的信息和资料真实、准确、完整,并已阅知管理合同和集合计划说明书全文,了解相关权利、义务和风险,独立承担投资风险。委托人承诺不得通过拆分转让资产管理计划份额或其收益权。

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。

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	长江资管长旭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见管理人发行公告。存续期规模上限见开放期前管理人公告。集合计划总参与人数不超过200人。
	管理期限	本集合计划不设固定管理期限。
	推广期	见推广机构公告
	封闭期	本集合计划除开放期外均封闭运行。
	开放期	本集合计划开放期为自集合计划成立日之日起每3个月开放一次,如果开放日为非交易日,则顺延至该日后最近的一个交易日。具体日期以管理人公告为准。管理人有权调整上述开放期,具体见届时管理人公告。
	份额面值	人民币1.00元。
	最低金额	首次参与的最低金额为人民币100万元,追加参与的金额为人民币1万元整数倍。
	相关费率	1、认购/申购费率:0。 2、退出费率:0。 3、管理费率:0.5%/年。 4、托管费率:0.02%/年。 5、业绩报酬:超过业绩比较基准部分的100%,详见管理合同第十四章。 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费用,从集合计划资产中支付。
投资范围及投资比例	本集合计划的投资范围为: ①固定收益类资产,包括国债、地方政府债、央行票据、政策性银行债券、商业银行债券(含普通债、次级债、混合资本债)资本工具(含二级资本工具)、证券公司短期融资券、保险公司债、证券公司债(含证券公司次级债、证券公司短	



		<p>期公司债)、其他金融机构债、券商收益凭证、企业债券、公司债券、非公开发行公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券(SCP)、国际机构债、政府支持机构债、非公开定向债务融资工具(PPN)、项目收益票据(PRN)、项目收益债、可分离债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券(含私募可交换债券)、资产支持证券(ABS)、资产支持票据(ABN)、债券型基金、分级基金优先级份额、商业银行理财计划、期限大于7天的债券逆回购;</p> <p>②衍生金融工具,包括国债期货等、金融衍生工具的投资需依从相关法律法规的规定;</p> <p>③现金类资产,包括银行存款(包括定期存款及其他银行存款)、同业存单、流动性较高商业银行理财计划、货币市场基金、现金、期限在7天以内(含7天)的债券逆回购等。</p> <p>④其他类资产,包括以固定收益类资产为主要投资标的的集合信托计划、基金公司和基金子公司设立的“一对多”资管计划以及私募证券投资基金。</p> <p>本集合计划可参与债券正回购业务。</p> <p>如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的,资产管理人在与资产托管人协商一致并履行合同变更程序后,可以将其纳入本计划的投资范围,并应为管理人和托管人相关系统准备以及投资组合调整留出必要的时间。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>(1)固定收益类资产投资占集合计划资产总值的比例为0-100%;</p> <p>(2)债券正回购不超过集合计划资产净值的40%;</p> <p>(3)现金类资产投资占集合计划资产总值的比例为0-100%;</p> <p>(4)投资于金融衍生工具仅限风险对冲,其中投资国债期货缴纳的保证金不超过集合计划资产净值的3%;</p> <p>(5)其他类资产投资占集合计划资产总值的比例为0-20%。</p>
	风险收益特征	本集合计划主要投资于固定收益类品种,为中低风险的理财产品。
	适合推广对象	本集合计划推广对象为风险承受能力较弱、追求稳健收益的合格投资者。
当 事 人	管理人	长江证券(上海)资产管理有限公司
	委托人	指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本集合计划的投资者,包括个人投资者和机构投资者。
	托管人	兴业银行股份有限公司
	推广机构	长江证券(上海)资产管理有限公司、长江证券股份有限公司 管理人可以增加符合监管规定的机构作为本集合计划的推广机构,具体见届时管理人公告。
	管理人自有份额	指管理人以自有资金参与本集合计划而依法取得和持有的本集合计划份额。管理人以自有资金参与的份额不超过集合计划总份额的20%。详细见管理合同。
	委托人份额	委托人通过签订《管理合同》而依法取得和持有的本集合计划份额。
集 合 计	办理时间	认购在推广期办理,申购在开放期办理,委托人可以按照管理合同约定,在本集合计划的开放期内办理参与业务。
	办理场所	推广机构指定的推广营业网点或指定网站
	办理方式、程序	(1)投资者按推广机构的具体安排,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

划的参与		<p>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) 以纸质方式签署的，投资者签署管理合同和风险提示书后，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认后有效，构成管理合同的有效组成部分；</p> <p>以电子方式签署的，投资者同意以电子签名方式签署管理合同及风险揭示书后，既可以到集合计划推广机构指定营业网点的柜台申请参与集合计划，也可以登录推广机构指定网络系统以自主下单的方式申请参与集合计划。参与申请经管理人确认后有效，构成管理合同的有效组成部分；</p> <p>(4) 投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销；当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销；</p> <p>(5) 投资者于T日提交参与申请后，可于T+2日后在办理参与的推广机构查询参与确认情况；</p> <p>(6) 当参与申请合计超过规模上限时，管理人应当暂停接受所有委托人的参与申请，并以最高募集规模为上限，按“时间优先、时间相同金额大者优先”的原则，来确定参与成功的份额。参与规模以管理人的确认结果为准。</p>
	参与费	0
	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，其中利息以注册登记机构的记录为准。
集合计划的退出	办理时间	委托人可以按照管理合同约定，在本集合计划的开放期内办理退出业务。
	办理场所	推广机构指定的推广营业网点或指定网站
	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，在约定的办理时间内向推广机构提出退出申请。</p> <p>(2) 退出申请的确认</p> <p>委托人T日提出的退出申请，经管理人确认后，可在T+2之后向推广机构所属网点或网络查询退出的确认情况。</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（遇特殊情况，支付日期顺延）从托管账户划出。</p>
	退出费	0
	巨额退出	当某个开放日集合计划净退出申请份额超过上一工作日集合计划总份额的10%时，管理人可以依照合同约定进行特别处理，详见《管理合同》。
单个委托人巨额退出	本集合计划不设单个委托人大额退出限制条款。	
集合计划成立的条件、时间	集合计划的参与资金总额不低于3千万元人民币且其委托人的人数为2人(含)以上，资产管理人应自推广期届满之日起5个工作日内聘请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，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3千万元或委托人的人数少于2人条件下，或者不满足管理人发行公告约定的条件，或者推广期间发生使集合计划无法成立的不可抗力，集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部推广费用，并将已认购资金及利息在推广期结束后30个工作日内退还集合计划委托人。	
集合计划份额转让、非交易过户和冻结	<p>1、集合计划份额的转让</p> <p>本集合计划存续期间，在技术条件允许的情况下，管理人可根据证监会的相关</p>	

(上海)资产管理  
i 缝

	<p>规定向证监会认可的交易场所申请开通份额转让，具体时间将由管理人确定后在网站公告。管理人和托管人无需就本集合计划份额转让事宜与委托人另行签订协议。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> <p>2、集合计划份额的非交易过户</p> <p>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。</p> <p>3、集合计划份额的冻结</p> <p>集合计划注册登记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。</p> <p>当集合计划份额处于冻结状态时，集合计划注册登记机构或其他相关机构有权拒绝集合计划份额的退出、非交易过户等业务的申请。</p>	
有限补偿	<p>集合计划第 i 个封闭期终止日或集合计划终止时，若第 i 个封闭期起始日持有至该封闭期终止日或集合计划终止时（以下简称“该期间”）的份额期间年化收益率超过该期间业绩比较基准，则管理人对该期间份额年化收益率超过该期间业绩比较基准的部分从集合计划资产中全部预提为管理人业绩报酬，管理人可从当期预提的业绩报酬中收取一定比例（不超过 80%，具体提取比例见管理人公告）作为管理人实际收入。</p> <p>若该期间份额年化收益率未达到该期间业绩比较基准，则管理人以累计预提的集合计划业绩报酬余额为限，对委托人份额进行有限补偿，至份额实际年化收益率达到该期间业绩比较基准，或预提的业绩报酬余额补偿至 0 为止。委托人在特别开放期申请份额退出，退出金额以集合计划单位净值为基准进行计算，不享有有限补偿。</p>	
费用、业绩报酬	费用种类	<p>包括管理人的管理费和业绩报酬、托管人的托管费、证券交易费用、证券账户开户费、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、增值税税费等、本集合计划成立后的会计师费和律师费、按照国家有关规定可以列入的其他费用。</p>
	不由集合计划承担的费用	<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>
	业绩报酬	<p>1、业绩报酬的计提</p> <p>集合计划第 i 个封闭期终止日或集合计划终止时，若第 i 个封闭期起始日持有至封闭期终止日或集合计划终止（以下简称“该期间”）时的份额年化收益率超过管理人公告的该期间业绩比较基准，则管理人对该期间份额年化收益率超过该期间业绩比较基准的部分从计划资产中全部预提为管理人业绩报酬，管理人可从当期预提的业绩报酬中收取一定比例（不超过 80%）作为管理人实际收入。具体提取比例见管理人公告。</p> <p>(1) 期间年化收益率计算公式：</p> $R_i = \frac{A_i - B_i + D_i}{B_i} \times \frac{365}{T_i} \times 100\%$ <p>Ri 为该期间的年化收益率； Ai 为第 i 个封闭期终止日或集合计划终止时的单位净值（提取前单位净值）；</p>

	<p>Bi 为第 i 个封闭期起始日单位净值； Di 为该期间单位分红金额； Ti 为该期间的实际天数； Ri 的计算在百分号内保留两位小数，小数点后两位四舍五入。</p> <p>(2) 期间业绩报酬计提计算公式：</p> $Y_i = F_i \times B_i \times (R_i - K_i) \times \frac{T_i}{365}$ <p>Yi 为该期间预提的业绩报酬； Fi 为集合计划第 i 个封闭期终止日或集合计划终止时登记在册的份额数； Bi 为第 i 个封闭期起始日单位净值； Ki 为该期间的业绩比较基准； Yi 的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。</p> <p>①集合计划第 i 个封闭期终止日或集合计划终止时，若该期间年化收益率超过该期间业绩比较基准，则管理人对份额年化收益率超过该期间业绩比较基准的部分全部预提为管理人业绩报酬，管理人可从当期预提的业绩报酬中收取一定比例（不超过 80%）作为管理人实际收入。具体提取比例见管理人公告。</p> <p>②集合计划第 i 个封闭期终止日或集合计划终止时，若该期间份额年化收益率等于该期间业绩比较基准，则管理人不计提业绩报酬。</p> <p>③集合计划第 i 个封闭期终止日或集合计划终止时，若该期间份额年化收益率未达到该期间业绩比较基准，则管理人以累计预提的集合计划业绩报酬余额为限，对委托份额进行有限补偿，至份额实际年化收益率达到该期间业绩比较基准，或预提的业绩报酬余额补偿至 0 为止。委托人在特别开放期申请份额退出，退出金额以集合计划单位净值为基准进行计算，不享有有限补偿。</p> <p>2、业绩报酬的收取</p> <p>每个封闭期结束时，管理人可从当期预提的业绩报酬中收取一定比例（不超过 80%）作为管理人实际收入。具体提取比例见管理人公告。</p> <p>每年 12 月 20 日（如遇节假日顺延至下一工作日），若留存未提取的业绩报酬有余额，管理人可全部或者部分提取。</p> <p>集合计划终止时，业绩报酬余额在进行有限补偿之后（如触发），管理人将提取全部的业绩报酬余额（若有）。</p> <p>业绩报酬的收取由管理人出具划款指令，托管人依据划款指令，将业绩报酬支付给管理人。</p>
税收	管理合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。详见管理合同。
收益分配	本集合计划存续期间不进行收益分配。
集合计划展期	本集合计划不设固定存续期限，无需展期。



<p><b>终止和清算</b></p>	<p>1、符合《管理合同》约定条件的，集合计划终止；</p> <p>2、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>3、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</p> <p>4、清算报告披露后七个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费及管理人业绩报酬等费用后，将集合计划资产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，以货币的形式全部分派给委托人，之后注销集合计划专用证券账户和资金账户。；</p> <p>5、集合计划清算程序终止后五个工作日内由集合计划清算小组在集合计划管理人公司网站上披露，并在集合计划清算程序终止后的十五个工作日内将清算结果向监管机构备案。</p> <p>详见《管理合同》。</p>
<p><b>特别说明</b></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>