

**万联证券季添利1号集合资产管理计划说明书**  
2018年6月

**特别提示:**

本说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》)、《万联证券季添利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,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	万联证券季添利1号集合资产管理计划
	类别	集合资产管理计划
	目标规模	本集合计划存续期规模上限为50亿元,推广期规模上限为6亿元(不含认购期利息) 管理人有权根据实际情况调整推广期和存续期规模上限及集合计划份额的规模上限,并由管理人在管理人指定网站公告。
	管理期限	本集合计划不设固定管理期限。符合终止的条件,本集合计划可提前终止。
	推广期	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及接受参与的集合计划份额事项等由管理人公告确定。 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。
	封闭期、开放期	1、封闭期:本集合计划存续期内,除开放期以及特别开放期以外其余都是封闭期,封闭期内不办理参与、退出业务。 2、开放期:本集合计划定期开放,每个运作周期起始日为上一运作周期到期日之后的首个工作日,对于首个运作周期,运作周期起始日为计划成立日。每个运作周期原则上为三个月(首个运作周期除外),管理人有权在此基础上调整,运作周期到期日遇节假日顺延至下一个工作日,具体运作周期及到期日由管理人公告确定。 原则上本计划的开放期为每个运作周期到期日,接受委托人的参与及退出申请,管理人可以公告调整开放期的具体时间安排。 委托人如需办理退出必须按照管理人公告的规则提前预约,委托人未提前预约的,管理人有权拒绝委托人退出申请。管理人应该在每个参与退出日前公告委托人本次预约退出的具体安排。 3、特别开放期:存续期内,管理人有权设置特别开放期,接受委托人的参与或退出申请,具体见管理人公告。此外,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,则管理人将设置特别开放期,接受委托人的赎回申请。 管理人可以根据实际情况,选择使用管理人网站、电子邮件、手机信息等方式向委托人告知本集合计划相关信息。
	份额面值	人民币1.0000元。
	参与价格	在推广期内,参与集合计划的价格以每份额人民币1.0000元为基准进行计算。开放期内参与价格为开放期内参与当日的单位净值。
最低金额	集合计划份额单个客户首次参与的最低金额为人民币100万元,追加参与的最低金额为人民币1	



	<p>万元，超过最低参与金额的部分不设金额级差。</p>
<p>相关费率</p>	<p>1、参与费率：0  2、退出费率：0  3、管理费率：0.50%/年  4、托管费率：0.05%/年  5、管理人业绩报酬：  业绩报酬计提日：本计划的业绩报酬计提日为分红日、委托人退出日和计划终止日。  在集合计划当前运作周期到期日之前，由管理人公告下个运作周期的业绩报酬计提基准K以及业绩报酬计提比例X。其中，首个运作周期的业绩报酬计提基准K以及业绩报酬计提比例X将于推广期前由管理人公告。  在业绩报酬计提日，若委托人在该期内的实际年化收益率S小于或等于该期的业绩报酬计提基准K，管理人不计提业绩报酬；若在该期内的实际年化收益率S大于该期的业绩报酬计提基准K，管理人将对超过部分的收益以业绩报酬计提比例X计提业绩报酬，剩余部分归委托人所有。  管理人确定本计划业绩报酬计提基准主要基于集合计划投资的债券、货币市场基金、债券回购、银行存款等投资标的所构成的投资组合的收益测算。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，但不保证本集合计划资产本金不受损失，也不保证最低收益。  6、对于因委托资产运营过程中所产生的税费，由管理人根据法律、法规规定缴纳，并从委托资产中予以扣除。  7、其他费用：除交易手续费、印花税、管理费、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>
<p>投资范围</p>	<p>本集合计划主要投资于固定收益类、现金类、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。如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>具体如下：</p> <p>(1) 在国内银行间市场、交易所上市交易的固定收益证券：包括利率债（国债、政策性金融债、地方政府债和央行票据）、信用债（金融机构债、企业债、公司债（含公募及非公开发行公司债）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、非公开定向债务融资工具PPN、资产支持证券、可转债、可交换债等；</p> <p>(2) 现金类资产：包括现金、银行存款、银行间同业存单NCD、债券回购、公募货币型基金；</p> <p>(3) 公募债券型基金；</p> <p>(4) 国债期货（不含实物交割）；</p> <p>本集合计划不直接投资股票和权证，但因所持可转换债券及可交换债转股形成的股票、因投资于可分离交易的可转换债券而产生的权证，在其可上市交易后不超过15个交易日的时间内卖出。</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>
<p>投资比例及限制（具体投资比例限制可能根据银行需求调整，具体以合同约定为准）</p>	<p>(1) 本集合计划投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于80%；非因管理人主观因素导致突破前述比例限制的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的15个交易日内调整至符合要求。</p> <p>(2) 存续期在一年（含）以下信用债主题评级在AA-（含）以上；存续期在一年（不含）以上信用债主题评级在AA（含）以上；资产支持证券债项评级在AA+（含）以上。</p> <p>(3) 公募债券型基金投资余额不得超过该基金规模的30%（以参与时点公募债券型基金最新公开披露的数据为准）；主体评级AA+（不含）以下债券投资存量余额（以市值计算）占比不得超过本计划资产净值的50%。</p> <p>(4) 本集合计划参与证券回购融入资金余额不得超过计划资产净值的40%；本集合计划总资产不得超过净资产的200%；</p> <p>(5) 本产品参与债券正回购资金余额或逆回购资金余额超过上一日净资产100%的，管理人和托管人应向相关监管部门报告。</p> <p>(6) 委托投资组合的债券加权久期不超过5年。对于含权债基浮息债，如果中债推荐久期，则以</p>

		<p>中债推荐久期为准。</p> <p>(7) 次级债（包括二级资本债）发行主体仅限于国有金融机构，且债项评级在AA（含）以上。</p> <p>(8) 国债期货交易实施累计损失（损失仅指国债期货的损失，且交易盈利不冲抵累计损失）限额管理。国债期货当日累计保证金余额占比不超过委托投资本金1%，年度累计损失限额不超过委托投资本金的1.5%，季度累计损失限额不得超过委托投资本金的1%，月度累计损失限额不得超过委托投资本金的0.5%。</p> <p>(9) 以市值计算，可转债、可交换债投资总额不得超过集合计划净值20%。</p> <p>本计划自投资运作期开始之日起6个月内使集合资产管理计划的投资组合比例符合上述资产组合比例的要求。如因一级市场申购发生投资比例超标下，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管理人之外的因素，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15个交易日内将投资比例降至许可范围内。如遇限售期或其他客观因素等原因导致交易条件不具备，则上述期限自动顺延，具体顺延时间由管理人确定。</p> <p>托管人仅对上述（1）、（4）、（5）点投资限制进行监控。</p>
	份额分级	本集合计划不分级。
	风险收益特征	本集合计划为固定收益类产品。集合计划在销售与推广环节适用的风险等级（如有）以推广机构公布为准。
	适合推广对象	<p>本集合计划的适合推广对象为具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或其他组织：（1）具有2年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元；（2）最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；（3）金融管理部门视为合格投资者的其他情形。</p> <p>投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划。</p> <p>如未来法律法规或监管机构对合格投资者有新规定的，本集合计划将按新规定执行。</p>
当 事 人	管理人	万联证券股份有限公司
	托管人	兴业银行股份有限公司
	推广机构	万联证券股份有限公司及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本集合资产管理计划的机构。
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，投资者在每个工作日可以参与本集合计划。推广时间等推广安排及接受参与的集合计划份额事项等由管理人公告确定。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集合计划的发售时间，并及时公告。</p> <p>(2) 存续期参与</p> <p>存续期参与在开放期办理。业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。</p> <p>若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，管理人将视情况对前述退出办理的日期及时间进行相应的调整并公告。</p>
	办理场所	推广机构指定的场所。
	办理方式、程序	<p>1、办理方式</p> <p>以金额申请。</p> <p>2、办理程序</p> <p>(1) 投资者按推广机构的具体安排或通过推广机构的指定系统，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资金账户，并在资金账户备足参与资金。若资金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) 本合同若通过电子签名的方式签署, 投资者在签署本合同前, 必须曾与推广机构签署过《电子签名约定书》; 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后, 构成本合同的有效组成部分;</p> <p>(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后, 构成本合同的有效组成部分;</p> <p>(5) 投资者参与资金的汇款账户以推广机构相关文件载明为准, 参与申请确认后, 其参与申请和参与资金不得撤销;</p> <p>(6) 存续期投资者于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。投资者推广期参与的, 可于计划成立之日起2个工作日后到办理参与的推广机构查询参与确认情况。投资者认可管理人对其参与有效性的确认;</p> <p>(7) 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>a. 推广期参与份额的计算</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>参与费用=参与金额-净参与金额</p> <p>b. 存续期参与份额的计算</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/T日计划单位净值</p> <p>其中T日指管理人受理委托人参与申请的工作日。</p> <p>委托人多笔参与时, 按上述公式进行逐步计算。参与份额保留小数点后两位, 小数点后第三位四舍五入, 由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。</p>
	认购资金利息	委托人的参与资金在推广期募集户产生的利息折算为份额归委托人所有, 具体利息折算数额以注册登记机构登记为准。
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开放期内可以办理退出业务。管理人有权设置特别开放期, 接受委托人的参与或退出申请, 具体见管理人公告。业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。</p> <p>若出现新的证券交易市场或其他特殊情况, 管理人有权视情况对前述退出办理的日期及时间进行相应的调整并公告。</p>
	办理场所	在本合同约定的时间办理, 委托人可在原参与网点申请退出集合计划。
	退出的原则	<p>(1) “未知价”原则, 即退出集合计划的价格以退出申请日(T日)集合计划单位净值为基准进行计算; 巨额退出的情形另行约定;</p> <p>(2) 采用份额退出的方式, 即退出以份额申请;</p> <p>(3) “先进先出”原则, 即对委托人在该推广机构参与的集合计划份额进行退出处理时, 参与确认日期在前的集合计划份额先退出, 参与确认日期在后的集合计划份额后退出;</p> <p>(4) 当日的退出申请可以且只能在当日交易时间结束之前撤销。</p>
	退出的程序和确认	<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, 在开放日的业务办理时间内向推广机构提出退出申请。申请退出份额数量超过委托人持有份额数量时, 全部申请无效。</p> <p>(2) 退出申请的确认</p> <p>存续期投资者于T日提交退出申请后, 可于T+2日后在办理退出的推广机构查询退出确认情况。若交易未成功或数据不符, 委托人可与为其办理手续的人员联系并进行核实。巨额退出、连续巨额退出的情形按本章节第二部分第8-9项巨额退出及连续巨额退出的认定及办理方式办理;</p>

	<p>(3) 退出款项划付</p> <p>委托人退出申请确认后, 管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构, 再由注册登记机构划往推广机构, 并通过推广机构划往申请退出委托人的指定账户。如集合计划出现暂停估值的情形时, 管理人与托管人协商后, 可以将划拨日期相应顺延。</p>
退出费及退出份额的计算	<p>(1) 退出费率: 0</p> <p>(2) 退出金额的计算公式:</p> <p>委托人退出金额的计算方法如下:</p> <p>退出金额=退出份额*T 日计划单位净值-业绩报酬 (如有)</p> <p>退出金额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, 由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。</p>
退出的限制与次数	<p>当委托人持有的计划份额资产净值高于100万元人民币时, 委托人可以选择在开放日全部或部分退出集合计划份额; 选择部分退出集合计划的, 委托人在退出后持有的计划份额资产净值不得低于100万元人民币。当管理人发现委托人申请部分退出集合计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于100万元人民币的, 管理人有权适当减少该委托人的退出金额, 以保证部分退出申请确认后委托人持有的计划资产净值不低于100万元人民币。当委托人持有的计划份额资产净值低于100万元人民币 (含100万元人民币) 时, 需要退出计划的, 委托人必须选择一次性全部退出集合计划。</p> <p>委托人在某一开放日内的退出次数不受限制。</p>
单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式	<p>单个开放日, 单个委托人当日累计净退出申请份额超过2000万, 即为单个委托人大额退出。</p> <p>单个委托人单日退出申请份额超过2000万的, 应当提前5个工作日向管理人提起退出预约申请。</p> <p>单个委托人大额退出的顺序、价格确定和款项支付按巨额退出的顺序、价格确定和款项支付执行。</p>
巨额退出的认定和处理方式	<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, 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: 连续两个或以上开放日发生巨额退出的, 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; 但遇不可抗力等特殊情况下不受上述时限的限制。</p> <p>管理人可以根据集合计划运作的实际情况在不损害委托人利益的前提下更改上述退出安排。本集合计划退出安排的更改将遵循本合同变更的相关程序。</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>
连续巨额退出的认定和处理	<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>

方式	<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, 管理人可按说明书及资产管理合同载明的规定, 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>
拒绝或暂停退出的情形及处理	<p>发生下列情形时, 管理人可以拒绝或暂停受理委托人的退出申请:</p> <p>(1) 不可抗力导致集合计划无法正常运行;</p> <p>(2) 证券交易场所交易时间非正常停市, 导致当日集合计划资产净值无法计算;</p> <p>(3) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有委托人利益时;</p> <p>(4) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出, 或者其他原因, 导致本集合计划的现金支付出现困难时, 管理人可以暂停接受集合计划的退出申请;</p> <p>(5) 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在说明书、资产管理合同中已载明的特殊情形。</p> <p>发生上述情形之一的, 已接受的退出申请, 若管理人有足额支付能力, 则集合计划管理人将足额支付; 如暂时不能支付的, 可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人, 未支付部分由集合计划管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付, 但最长不超过正常支付时间20个工作日, 并报告给委托人。</p> <p>发生《集合资产管理合同》、集合计划说明书中未予载明的事项, 但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划参与、退出申请的, 可以暂停接受委托人的参与、退出申请。</p> <p>暂停集合计划退出, 集合计划管理人应及时报告委托人。</p> <p>委托人认可上述关于退出的原则及处理方法, 接受管理人依据法律法规及本合同的约定所作出的延期退出或暂停退出的决定。</p>
管理人自有资金参与情况	<p>1、管理人自有资金参与</p> <p>管理人参与的金额不超过推广期委托人所认购集合计划资产总份额(不考虑推广期的利息)的16%。由于本集合计划的规模变动等客观原因导致管理人持有份额超过本集合计划总份额的16%时, 管理人自有资金将退出以确保管理人自有资金参与份额不超过集合计划总份额的16%。</p> <p>2、集合计划存续期间, 自有资金参与集合计划的持有期限不少于法律法规、自律规则规定的最低期限。</p> <p>3、自有资金的收益分配: 管理人参与的份额与其他委托人参与的份额享受同样的收益。</p> <p>4、自有资金责任承担方式和金额: 管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他份额投资者享有同等权益和义务。</p> <p>5、风险提示: 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。同时, 管理人以自有资金参与本集合计划并不意味着管理人将为本集合计划采取垫资兑付措施, 或者为本集合计划承诺保本。</p> <p>6、信息披露: 管理人以自有资金参与或退出本集合计划, 应该提前5个工作日通过管理人网站公告。</p>
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人民币3000万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, 管理人公告本集合计划成立。</p> <p>本集合计划成立的时间为计划管理人根据《管理办法》及相关法规规定发布集合计划成立公告的日期。</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注册登记机构指定的专门账户, 不得动用。</p>
集合计划设立失败(本金及利息返还方式)	<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, 并将已参与资金及同期利息在推广期结束后</p>

	30个工作日内退还集合计划委托人。
集合计划份额转让、非交易过户与冻结	<p>(一) 集合计划份额的转让</p> <p>在监管法规及技术措施允许的情况下, 集合计划存续期间, 客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。份额转让的具体事宜(包括交易平台、时间、业务规则等)由管理人在集合计划份额开始转让前在其网站予以公告。在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>(二) 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>(三) 集合计划份额的冻结</p> <p>集合计划份额冻结、解冻的业务, 由注册与过户登记人办理。</p> <p>集合计划注册与过户登记人只受理国家有关机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻以及注册与过户登记人认可的其他情况的集合计划份额的冻结与解冻。</p> <p>当集合计划份额处于冻结状态时, 集合计划注册与过户登记人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>
费用	<p>(一) 费用种类</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、管理人的管理费、业绩报酬(如有)</li> <li>2、托管人的托管费</li> <li>3、证券交易费用</li> <li>4、开户费用和账户维护费用</li> <li>5、银行汇划费用</li> <li>6、本集合计划合同生效后的会计师费和律师费</li> <li>7、按照国家有关规定可以列入的其他费用</li> </ol> <p>(二) 集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、管理费</li> </ol> <p>本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.50%/年费率计提, 计算方法如下:</p> $H = E \times 0.50\% \div 365$ <p>H为每日应计提的管理费;</p> <p>E为前一日集合计划资产净值。</p> <p>管理费每日计算, 并逐日累计至每季季末, 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度首日起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。</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>2、托管费</li> </ol> <p>托管费按前一日集合计划资产净值的0.05%/年费率计提, 计算方法如下:</p> $T = E \times 0.05\% \div 365$ <p>T为每日应计提的托管费;</p> <p>E为前一日集合计划资产净值。</p> <p>托管费每日计算, 并逐日累计至每季季末, 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度首日起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。</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>3、管理费和托管费的调整</li> </ol>

管理人和托管人可协商调减管理费和托管费，并在管理人指定网站公告。

4、证券交易费用：包括但不限于本计划投资所有金融工具产生的交易费、经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、经纪商佣金、结算费及其他类似性质的费用等。

5、证券账户开户费用：证券账户开户费用由管理人在开户时先行垫付，产品在证券账户开户一个月内成立的，经管理人与托管人核对无误后，自证券账户开户一个月内由管理人出指令从集合计划中扣划。

6、其他费用：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，由托管人按费用实际支出金额支付。

### (三)管理人业绩报酬

业绩报酬计提日：本计划的业绩报酬计提日为分红日、委托人退出日和计划终止日。

在集合计划当前运作周期到期日之前，由管理人公告下个运作周期的业绩报酬计提基准K以及业绩报酬计提比例X。其中，首个运作周期的业绩报酬计提基准K以及业绩报酬计提比例X将于推广期由管理人公告。

在业绩报酬计提日，若委托人在该期内的实际年化收益率S小于或等于该期的业绩报酬计提基准K，管理人不计提业绩报酬；若在该期内的实际年化收益率S大于该期的业绩报酬计提基准K，管理人将对超过部分的收益以业绩报酬计提比例X计提业绩报酬，剩余部分归委托人所有。

业绩报酬计算方法如下：

本期实际年化收益率S	计提比例
$S \leq K$	0
$S > K$	X

业绩报酬计提办法：

$$S = \frac{(C'' - C')}{C} \times \frac{365}{D}$$

$$H = Q \times C \times (S - K) \times \frac{D}{365} \times X$$

其中：

$C''$ ：在业绩报酬计提日的累计净值

$C'$ ：为委托人参与本集合计划时的累计单位净值（若委托人已持满一个封闭运作期，则为前一个分红日的累计单位净值）；

C：为委托人参与本集合计划时的单位净值（若委托人已持满一个封闭运作期，则为前一个分红日的单位净值）；

D：为本次计提业绩报酬区间天数，即该委托人参与本集合计划日（若委托人已持满一个运作周期，则为前一个分红日）至本次业绩报酬计提日的间隔天数；

H：业绩报酬计提日管理人应计提的业绩报酬；

Q：业绩报酬计提日委托人退出份额数或计划分红、终止时持有份额总数；

X：业绩报酬计提比例。

本集合计划在分红日计提业绩报酬的，业绩报酬金额上限为分红金额；即若按照上述公式计算的业绩报酬金额大于该次分红金额的，该次业绩报酬金额以分红金额为限，超出部分管理人予以免收。

业绩报酬的支付，由托管人根据管理人发送的业绩报酬划付指令于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，顺延至最近可支付日支付。

因涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不承担复核业绩报酬的

		<p>责任。</p> <p>(四) 税收</p> <p>集合计划运作过程中涉及的各项主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。</p> <p>根据相关部门发布的法律法规，管理人有权从资管计划财产中计提或扣收增值税，经托管人划付至管理人账户后，由管理人统一缴纳。</p>
	不列入集合计划费用的项目	<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>
收益分配	收益分配原则	<p>1、每一集合计划份额享有同等分配权；</p> <p>2、本集合计划收益分配后计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的计划份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>3、本计划收益分配时，只采用现金红利方式；</p> <p>4、本计划存续期内，管理人可以对计划份额进行收益分配，分红日（即收益分配登记日及除息日）原则上应为各运作周期到期日，具体时间见管理人公告；</p> <p>5、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> <p>6、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。</p>
集合计划展期	是否可以展期	<p>本集合计划不设固定存续期限，无展期条款。</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"> <li>1、 计划存续期间客户少于2人；</li> <li>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，而无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的；</li> <li>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；</li> <li>4、 管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，而无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的；</li> <li>5、 托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的；</li> <li>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；</li> <li>7、 法律、行政法规及中国证监会规定的其他终止情形；</li> <li>8、 管理人认为必要时可以终止本计划。</li> </ol> <p>(二) 清算小组</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、 自集合计划终止之日起5个工作日内成立清算小组，在清算小组接管集合计划资产之前，管理人和托管人应按照集合资产管理合同和托管协议的规定继续履行保护集合计划资产安全的职责。</li> <li>2、 清算小组成员由管理人、托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员。</li> <li>3、 清算小组负责集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法进</li> </ol>



	<p>行必要的民事活动。</p> <p>(三) 清算程序</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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；</li> <li>2、 清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</li> <li>3、 清算结束后20个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、相关税费、管理费、托管费及业绩报酬（如有）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；</li> <li>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；</li> <li>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，以货币形式全部分配给委托人。</li> </ol> <p>(四) 清算费用</p> <p>清算费用是指清算小组在进行清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从集合计划资产中支付。</p> <p>(五) 清算账册及文件的保存</p> <p>集合资产管理计划清算账册及有关文件由托管人按相关法律法规规定年限妥善保存，保存期限不得少于20年。</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。如有与《管理合同》不一致的，以《管理合同》为准。</p>