

长江资管乐享季季盈 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》）、《长江资管乐享季季盈 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，积极配合管理人履行“反洗钱”职责，不利用本集合计划进行“洗钱”等违法犯罪活动，未通过拆分转让资产管理计划份额或收益权、或短期借贷等方式变相突破合格投资者标准，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，不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

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》、本说明书及有关的规定享有权利、承担义务。

集合计划基本信息	名称	长江资管乐享季季盈 1 号集合资产管理计划
	类型	集合资产管理计划
	目标规模	本集合计划推广期和存续期规模上限见管理人公告，且不超过 50 亿份。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	开放期：本集合计划自成立之日起原则上每 3 个月开放一次，开放时间为一个工作日，具体开放期以管理人公告为准。开放期当日统一办理委托人有效的预约参与、预约退出和参与申请，开放期当日可接收委托人参与申请，不接受委托人的退出申请。管理人也有权根据产品运作情况设置临时开放期，具体开放期以管理人公告为准。
	预约期	本集合计划开放日前五个工作日为预约期，委托人可在预约期提交参与或退出预约申请，预约是否有效以推广机构系统确认为准，有效预约于开放期自动转为正式申请。
	业绩报酬计提基准以及业绩报酬计提基准适用期	管理人将在集合计划推广期首个工作日以及开放期前 5 个工作日公布一个业绩报酬计提基准和业绩报酬计提基准适用期，具体见管理人公告。 业绩报酬计提基准适用期原则上为集合计划成立日每满 3 个月的期限，具体见管理人公告。 上述开放期不含特别开放期。
	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。参与金额级差为 1000 元人民币。	



	相关费率	<p>1、认购/申购费率：0。</p> <p>2、退出费率：0。</p> <p>3、管理费率：0.3%/年。</p> <p>4、托管费率：0.02%/年。</p> <p>5、业绩报酬：详见管理合同第十三章。</p> <p>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。</p>
	投资范围及投资比例	<p>1、投资范围</p> <p>本集合计划的投资范围为：固定收益类资产，包括国债、金融债（含政策性金融债）、地方政府债、证券公司次级债、央行票据、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、期限在7天以上的债券逆回购、可转换债券、可交换债券、证券公司发行的公司债券、资产支持证券、非公开债、非公开定向债务融资工具、项目收益债等。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、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）的债券逆回购以及中国证监会认可的其他投资品种。</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>(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) 投资于可转债类债券转股形成的股票应在具备交易的5个工作日内卖出。</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的证券或承销期内承销的证券。交易完成后，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所报告。</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。</p>
	风险收益特征	本集合计划主要投资于固定收益类品种，为中低等级风险的理财产品。
	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	交通银行股份有限公司深圳分行
	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。
	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。
	办理时间	(1) 推广期参与

集 合 计 划 的 参 与		<p>在推广期内，投资者在推广机构指定的时间内可以参与本集合计划。</p> <p>(2) 存续期参与</p> <p>本集合计划自成立之日起原则上每3个月开放一次，开放时间为一个工作日，具体开放期以管理人公告为准。委托人可在开放期办理参与业务；本集合计划开放日前五个工作日为预约期，委托人可在预约期提交预约参与、预约退出申请，预约是否有效以推广机构系统确认为准，有效预约于开放期自动转为正式申请。</p> <p>管理人也有权根据产品运作情况设置临时开放期，在管理人设置临时开放期开放参与的前提下，委托人可以办理参与业务，具体时间和办理方式以管理人公告为准。</p>
	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) 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；</p> <p>(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；</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有效后，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有效后，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成功后，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) 投资者提交参与申请后，可于T+2日（T为开放日）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，即先参与先确认，同一时间提交的，金额大的优先确认。超过规模上限后的所有参与无效。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	<p>本集合计划自成立之日起原则上每3个月开放一次，开放时间为一个工作日，具体开放期以管理人公告为准。本集合计划开放日前五个工作日为预约期，委托人可在预约期提交预约退出申请，预约是否有效以推广机构系统确认为准，有效预约于开放期自动转为正式申请。未预约退出的，管理人在该开放期有权拒绝其退出申请。</p> <p>管理人也有权根据产品运作情况设置临时开放期，在管理人设置临时开放期开放退出的前提下，委托人可以办理退出业务，具体时间和办理方式以管理人公告为准。</p>
	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，在管理合同约定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，申请无效。集合计划份额的退出需经管理人同意，管理人有权拒绝本集合计划份额退出。</p>

上海)资
经

		<p>(2) 退出申请的确认</p> <p>委托人提出预约退出申请后，经管理人确认后，可在 T+2 日（T 为开放日）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+7 日内从托管账户划出。</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》。
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。
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规定向证监会认可的交易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>
费用、报酬	费用种类	包括管理人的管理费、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、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。
	不由集合计	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

划承担的费用	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。
业绩报酬	<p>1、计提原则：</p> <p>(1) 本集合计划的业绩报酬计提日为开放日（含临时开放日和特别开放日）和集合计划终止日。</p> <p>(2) 在本集合计划的业绩报酬计提日，若从集合计划成立日或上一业绩报酬计提日持有至本次业绩报酬计提日的期间份额年化收益率超过管理人公告的当期业绩报酬计提基准，则管理人对份额年化收益率超过该业绩报酬计提基准的部分的90%计提为管理人业绩报酬。</p> <p>2、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 为集合计划成立日或上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的期间份额年化收益率；</p> <p>Ai 为本次业绩报酬计提日的单位净值；</p> <p>Bi 为集合计划成立日或上一业绩报酬计提日单位净值；</p> <p>Di 为集合计划成立日或上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的期间累计单位分红金额；</p> <p>Ti 为集合计划成立日或上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的实际天数；</p> <p>Ri 的计算在百分号内保留两位小数。</p> <p>3、期间业绩报酬计提计算公式：</p> $Y_i = F_i \times B_i \times (R_i - K_i) \times \frac{T_i}{365} \times 90\%$ <p>Yi 为业绩报酬计提日应计提的业绩报酬；</p> <p>Fi 为本次业绩报酬计提日登记在册的份额数；</p> <p>Bi 为集合计划成立日或上一业绩报酬计提日单位净值；</p> <p>Ki 为当期业绩报酬计提基准；</p> <p>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 若从集合计划成立日或上一业绩报酬计提日持有至本次业绩报酬计提日的期间份额年化收益率大于管理人公告的当期业绩报酬计提基准，则管理人对份额年化收益率超过该业绩报酬计提基准的部分的90%计提为管理人的业绩报酬。</p> <p>② 若从集合计划成立日或上一业绩报酬计提日持有至本次业绩报酬计提日的期间份额年化收益率小于或等于管理人公告的当期业绩报酬计提基准，则管理人不计提业绩报酬。</p> <p>2、业绩报酬的提取</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> <p>风险提示：本集合计划的业绩报酬提取基准，仅是管理人计提业绩报酬的基准，并非管理人给予委托人的预期收益，更非管理人向委托人做出保本保收益的承诺。委托人的实际收益率有可能低于该业绩报酬计提基准，本集合计划资产出现极端损失情况下，委托人可能面临投资本金受损的风险。请投资者注意。</p>



收益分配	<p>1、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划收益分配后的金额不能低于集合计划面值。</p> <p>2、采用现金分红方式。</p> <p>3、在符合收益分配条件和原则的条件下，管理人可根据集合计划运作实际情况对本集合计划进行收益分配。</p> <p>4、红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日。</p> <p>5、现金红利款自款项从集合计划托管账户划出之日起 7 个工作日内划转到委托人账户。</p> <p>6、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担。</p> <p>7、法律、法规或监管机构另有规定的除外。</p>
集合计划展期	<p>本集合计划不设固定存续期限，无需展期。</p>
终止和清算	<p>1、符合《管理合同》约定条件的，集合计划终止。</p> <p>2、集合计划终止的，依照《管理合同》约定 5 个工作日内成立清算小组并负责清算；清算结束后 15 个工作日内，将清算结果按照监管机构要求报备，并在备案后三个工作日内披露集合计划清算报告；</p> <p>3、集合计划在清算结束后 15 个工作日内，管理人和托管人在扣除清算费用、管理费、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。</p>
特别说明	<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>