

申港证券巨杉1号
集合资产管理计划产品说明书

特别提示：

本说明书依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券公司客户资产管理业务规范》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称《运作规定》）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《指导意见》）、《申港证券巨杉1号集合资产管理合同》（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。

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	申港证券巨杉1号集合资产管理计划
	目标规模	本集合计划募集期规模上限为5亿份，存续期上限为50亿份（含管理人自有资金参与部分，不包括参与资金在募集期利息转份额部分）
	管理期限	10年
	产品类型	混合类集合资产管理计划
	募集期	指本集合计划开始接受委托人参与日至募集结束日，具体时间见有关公告，本集合计划初始募集期不超过60天。
	封闭期	封闭期：本集合计划除开放日外其余时间均为封闭期。封闭期内不办理参与和退出业务。
	开放期	开放期：开放期：本计划自成立后每3个月的对应日开放一次（如遇非工作日，则顺延至下一个工作日开放），每次连续开放三天，委托人可办理参与和退出申请，具体以管理人网站发布的公告为准。
份额面值	人民币1.00元。	

最低金额	<p>首次认购的最低金额为人民币 400,000.00 元,追加认购的最低金额为人民币 10,000.00 元;追加认购的金额不设级差,上述金额都不包含认购费。</p>
投资范围	<p>(1) 权益类:沪深证券交易所上市的 A 股股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、沪港通中港股通标的范围内的股票、深港通中港股通标的范围内的股票、股票型和混合型公开募集证券投资基金;</p> <p>(2) 固定收益类:债券逆回购(小于或等于 14 天)、沪深交易所上市的可转换债券、沪深交易所上市的可交换债券、债券型和货币市场型公开募集证券投资基金、债券正回购(小于或等于 14 天)、银行存款;银行间市场及交易所挂牌交易的债券;</p> <p>(3) 衍生品:中国金融期货交易所上市的股指期货,沪深交易所上市的股票期权。</p>
投资策略	<p>通过对宏观经济、行业发展、资金供给、证券市场走势等方面的分析和预测,在严格的风险控制基础上,主动构建及调整投资组合,力求实现委托财产的稳健增值。</p> <p>1、基于对产业和公司基本面的深刻理解,投资于特定时代背景下最优赛道中的最具成长性公司。投资策略中优先级排序为“垄断成长、寡头成长、垄断价值”。评估企业价值主要分为:①研究护城河的深度及变化趋势(产品力、商业模式、企业文化);②评估企业价值空间的大小。</p> <p>2、根据对市场风险的判断,必要的时候,本计划将通过在中国金融期货交易上市交易的股指期货(包括上证 50 股指期货、沪深 300 股指期货、中证 500 股指期货等)对组合中的股票现货持仓进行风险对冲。</p> <p>3、资产管理计划的决策依据</p> <p>资产管理计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据,并以维护资产管理计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括:</p> <p>(1)《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件;</p> <p>(2)国内外经济形势、外汇利率、市场利率变化趋势等的研究;</p> <p>(3)投资对象收益和风险的匹配关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策,是本资产管理计划维护投资者利益的重要保障。</p>

	<p>针对本资产管理计划的特点，在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，以追求委托人的本金安全为第一要旨，在此基础上为委托人争取较高的收益。</p> <p>4、资产管理计划的投资程序</p> <p>投资决策与操作流程控制包括投资研究流程、投资对象备选库的确定、资产配置与重大投资项目提案的形成、投资决议的形成与执行程序、投资组合跟踪与反馈以及核对与监督过程。</p> <p>(1) 投资分析和研究</p> <p>管理人资管权益部内设投资研究岗，从宏观经济形势、行业发展趋势、市场趋势、投资标的评价结果等多个角度综合分析，运用定性和定量方法进行研究，经过评级、估值和风险评判，通过严格的筛选程序，构建备选库，撰写研究报告，制定投资策略建议和投资建议，并根据市场变化情况，适时做出调整。</p> <p>(2) 制定资产配置策略</p> <p>管理人资产管理投资决策委员会根据研究部门的研究成果，在考虑市场运行趋势的基础上，对投资策略和投资建议进行仔细讨论并确定资产配置策略，规定本资产管理计划在不同类型资产上的配置比例。</p> <p>(3) 构建与调整投资组合</p> <p>本资产管理计划投资经理（即投资经理）在投资决策委员会的授权范围内，根据确定的投资原则和资产配置比例，从备选库中选择合适的投资标的构建投资组合，并负责进行投资组合的日常管理。</p> <p>(4) 风险管理与组合的调整</p> <p>管理人资管业务管理部、风险管理部负责监控本资产管理计划的投资运作和交易，对本资产管理计划的投资组合进行绩效和风险评估，根据市场变化对投资组合的资产配置和调整提出风险控制意见。投资经理需根据资管业务管理部、风险管理部意见，调整组合结构，优化组合的风险收益配比，在维护资产安全的前提下，获取较高的资本增值。</p>
投资限制	<p>为维护委托人的合法权益，本资产管理计划的投资限制为：</p> <p>(1) 按成本计，本计划持有一家上市公司所发行的单一股票数量不得达</p>

到或超过其总股本的 5%；本计划持有一家上市公司所发行的单一股票数量不得超过其流通股本（即上市公司股本—限售股本，除上下文义推测有其他含义外，本计划的计划文件中所称“流通股本”均以此定义为准）的 10%；

（2）按成本计，投资于单只主板、中小板股票的比例不超过计划资产净值的 25%，投资于单只创业板股票的比例不得超过计划资产净值的 15%；投资全部创业板股票的金额合计不超过计划资产净值的 40%。

（3）按成本计，本计划投资于单只公募基金的市值不得超过本计划资产总值的 25%（即：单一基金的市值÷本计划资产总值≤25%），且本计划持有单只基金的市值不得超过该基金最新公开对外披露份额的 5%；所投公募基金的基金最新公开对外披露市值规模不得低于 10 亿元；

（4）按成本计，投资于同一发行人发行的债券的市值不得超过计划资产总值的 25%（即：同一发行人发行的债券市值合计÷计划资产总值≤25%），且本计划持有单只债券的市值不得超过该债券总发行规模的 5%；

（5）投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%，（其中投资于衍生品的，以保证金计算口径计算，对于衍生品比例的监控由管理人自行监控，托管人不承担监督责任）；

（6）本计划投资的债券的主体信用评级不得低于 AA，且债项信用评级不得低于 AA；本计划投资的短期融资券的主体信用评级不得低于 AA，且债项信用评级不得低于 A-1；

（7）本计划届满前 3 个月内，不得认购新发行的开放日在计划到期日之后的开放式基金；

（8）期货账户全部权益（含保证金占用及可用资金）不得超过计划资产净值的 50%；

（9）期货的风险度不得超过 90%，期货风险度=期货保证金占用/期货账户全部权益（含保证金占用及可用资金）；

（10）本计划预警线（含）以上净敞口比例不得超过【-20%，100%】，预警线以下净敞口比例不得超过【-20%，50%】，净敞口比例=【（所有权益类资产多头价值+所有期货多头合约价值+所有期权多头合约价值）-（所有权益类资产空头价值+所有期货空头合约价值+所有期权空头合约价值）】/集合资产

		<p>管理计划净值；</p> <p>(11) 期权账户保证金不得超过计划资产净值的 15%</p> <p>(12) 不得主动投资于已公告退市或已进退市整理期的股票、S、ST、*ST、SST、S*ST 类的股票；</p> <p>(13) 本计划不得投资于分级基金；不得投资于权证；不得投资于银行理财产品；</p> <p>(14) 本计划申购新股时，申报的数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>(15) 不得投资于投资范围之外的投资品种；</p> <p>(16) 本计划总资产占净资产的比例不得超过 200%；</p> <p>(17) 禁止投资于限售期超过本计划到期日的股票。</p> <p>(18) 法律法规或监管部门规定的其他投资限制。</p> <p>本计划存续期内，因证券、期货市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素致使资产管理计划投资不符合约定投资比例的，投资顾问应当在相关品种可交易之日起 5 个交易日内提供调整建议供资产管理人参考；资产管理人将自超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内使本计划投资符合约定的投资比例。如发生证券停牌或其他非资产管理人可以控制的原因导致资产管理人不能履行调整义务的，则调整期限相应顺延。但资产管理人应当于恢复正常交易之日起的 5 个交易日内调整完毕。</p>
	风险收益特征	本集合计划属于中高级（R4）风险投资品种。
	适合销售对象	适合风险识别、评估、承受能力积极型（C4）、激进型（C5）的合格投资者。
当 事 人	管理人	申港证券股份有限公司
	托管人	招商证券股份有限公司
	代理销售机构	本计划的销售机构和注册登记机构均为申港证券股份有限公司，募集手续根据公司相关规程办理，若新增销售机构的，管理人应于管理人官方网站进行公告。

投资经理	黄群
投资者权利和义务	<p>1、投资者的权利</p> <p>(一) 分享资产管理计划财产收益；</p> <p>(二) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；</p> <p>(三) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；</p> <p>(四) 根据本合同的规定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会，行使相关职权；</p> <p>(五) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；</p> <p>(六) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；</p> <p>(七) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。</p> <p>2、投资者的义务</p> <p>(一) 认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法；</p> <p>(二) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承受能力问卷，如实提供资产或者收入情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；</p> <p>(三) 承诺投资资产管理计划的最终资金来源不存在为贷款、发行债券等筹集的非自有资金的情形；</p> <p>(四) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；</p> <p>(五) 认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(六) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；</p> <p>(七) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；</p> <p>(八) 向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料</p>

		<p>及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；</p> <p>（九）不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；</p> <p>（十）不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；</p> <p>（十一）保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；</p> <p>（十二）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。</p>
集合计划的参与	办理时间	<p>（1）募集期参与</p> <p>在募集期内，投资者在工作日内交易时间可以参与本集合计划。本集合计划的具体募集期以管理人的销售公告为准。</p> <p>（2）存续期参与</p> <p>投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在开放期的交易时间段内申请参与本集合计划。</p>
	办理程序	<p>（1）投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在开放期的交易时间段内办理。</p> <p>（2）委托人应指定以本人名义开立的银行资金账户作为办理本集合资产管理合同项下，支付参与资金及收取退出资金和收益等款项的账户（以下简称指定账户）。委托人申请参与时应在该指定账户备足参与的货币资金；若指定账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请。</p> <p>委托人承诺在本集合资产管理合同有效期内，不得撤销指定账户，并妥善保管账户资料，由于委托人原因造成退出款项和收益不能及时划入指定账户及由此造成的损失，由委托人承担，管理人和托管人不承担责任。委托人办理参与业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守《集合资产管理合同》规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。</p> <p>（3）投资者签署本合同后，方可申请参与资产管理计划。投资者到资产管理计划销售机构指定营业网点的柜台申请参与资产管理计划。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行。申请是否有效以管理人的确认为准。参与</p>

		<p>申请经确认有效后，构成本合同的有效组成部分。</p> <p>(4) 投资者于 T 日提交参与申请后，一般可于 T+2 日后在办理参与的网点查询参与确认情况。委托人应当及时查询和确认参与申请的相关信息。</p> <p>确认无效的申请，销售机构将退还委托人已交付的参与款项本金，就该委托人而言，集合资产管理合同自始无效。</p> <p>(5) 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。</p>
	参与费	<p>参与金额 $M < 300$ 万，参与费率为 0.5%；参与金额 $M \geq 300$ 万，参与费为 0。</p> <p>本计划采用外扣法计费，即参与费用=净参与金额*参与费率。</p>
	认购资金利息	<p>投资者的参与资金在募集期产生的利息将折算为计划份额归投资者所有。募集期产生的利息，以份额登记机构记录为准。</p>
集合计划的退出	办理时间	<p>委托人在开放期根据本合同约定的及管理人的公告条件退出本集合计划。在满足集合计划合同约定自有资金退出条件的情形下，管理人可以自行安排自有资金的退出。业务办理时间以销售机构指定营业网点的规定为准。</p>
	办理方式程序	<p>1、退出的原则</p> <p>(1) “未知价”原则，即以退出日 (T 日) 的资产管理计划单位净值为计价基准进行退出金额计算。</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，即对同一委托人在管理人或该销售机构参与的资产管理计划份额进行退出处理时，参与确认日在前的资产管理计划份额先退出，参与确认日期在后的资产管理计划份额后退出。</p> <p>(4) 委托份额自参与确认之日 (募集期参与的为产品成立日；成立后参与的为申购确认日) 起 12 个月内不得退出。</p> <p>(5) 委托人可将其全部或部分资产管理计划份额退出。本资产管理计划按照份额进行退出，申请退出份额精确到小数点后两位。</p> <p>2、退出的程序和确认</p> <p>(1) 退出申请的提出</p> <p>委托人必须根据本资产管理计划管理人或销售机构规定的手续，在开放日的业务办理时间向管理人或销售机构提出退出申请，申请退出份额数量超</p>

		<p>过委托人持有份额数量时，申请无效。</p> <p>(2) 退出申请的确认</p> <p>投资者于 T 日提交退出申请后，可于 T+3 日后在办理退出的网点查询退出确认情况。</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 日内从托管账户划出。</p>
退出费		<p>本集合计划不收退出费。</p>
大额退出、巨额退出、连续巨额退出		<p>1、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式</p> <p>(1) 单个委托人大额退出的认定</p> <p>单个委托人单日退出份额超过上一日资产管理计划总份额 5%，即视为单个委托人大额退出。</p> <p>(2) 单个委托人大额退出的申请和处理方式</p> <p>委托人必须提前 5 个工作日直接或通过销售机构向管理人预约申请，否则管理人有权拒绝接受其退出申请。</p> <p>2、巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(1) 巨额退出的认定</p> <p>单个开放日内，本资产管理计划净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之余额）超过上一日计划份额总份数的 10%，即认为是发生了巨额退出。</p> <p>(2) 巨额退出的处理方式</p> <p>当出现巨额退出时，管理人可以根据本资产管理计划当时的资产组合状况决定全额退出或部分退出。</p> <p>全额退出：当管理人认为有能力支付委托人的退出申请时，按正常退出程序执行。</p> <p>部分延期退出：当管理人认为支付委托人的退出申请有困难或认为兑付委托人的退出申请可能对本资产管理计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出计划份额不低于上一日计划总份额的 10%的前提下，对其余退出申请延期办理，延期时间不得超过 10 个工作日。对于当日的退出申请，</p>

	<p>按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理并接受的退出申请；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权并以该工作日的计划单位净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。委托人在申请退出时可选择当日未受理部分予以撤销，未进行选择默认顺延。</p> <p>3、连续巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(1) 连续巨额退出的认定</p> <p>集合计划连续两个开放日（含两日）以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。</p> <p>(2) 连续巨额退出的处理方式</p> <p>出现连续巨额退出时，管理人可采用全额退出或部分延期退出方式处理，当管理人认为有必要时，也可拒绝或暂停接受退出申请，并对已经接受的退出申请，采用全额退出或部分延期退出方式处理。</p>
<p>拒绝或暂停退出的情形及处理</p>	<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) 不可抗力的原因导致资产管理计划无法正常运作；</p> <p>(2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日资产管理计划资产净值无法计算；</p> <p>(3) 若连续巨额退出，可以拒绝或暂停接受委托人的退出申请。</p> <p>(4) 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>(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且中国证监会无异议的特殊情形。</p> <p>发生拒绝或暂停受理退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理。</p>
<p>管理人自有资金参与情况</p>	<p>管理人自有资金可以认购/参与本资产管理计划。</p> <p>1、自有资金的认购/参与方式和比例：</p> <p>管理人将以自有资金认购/参与本资产管理计划，管理人自有资金不超过资产管理计划规模（含自有资金部分）的15%。上述自有资金的份额占比如果</p>

	<p>出现除不尽的情况，可由管理人按照实际计算情况进行调整，最终误差不得超过 0.1%。管理人自有资金参与应提前 5 个工作日告知委托人和托管人，告知方式为管理人指定披露网站公告。</p> <p>2、自有资金的收益分配： 管理人自有资金份额与其他委托人持有计划份额享有相同的分红和收益权。</p> <p>3、自有资金退出的条件： (1) 管理人自有资金份额的持有期限不少于 12 个月，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) 因资产管理计划规模变动等客观因素导致自有资金份额被动超过法律、法规及本合同规定比例上限的，管理人应当依照中国证监会规定或 3 个工作日内安排临时开放日退出完成调整。 (3) 管理人自有资金退出应告知委托人和托管人，告知方式为管理人指定披露网站公告。 (4) 为应对集合资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人以其自有资金参与及后续的退出可以不受本条前述约定限制。出现上述情形时，管理人应及时告知投资人和托管人，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。</p> <p>4、风险揭示：管理人自有资金参与本资产管理计划与委托人享有相同权利。</p> <p>5、信息披露：管理人自有资金变动信息将在管理人网站上进行公告。</p>
<p>集合计划成立的条件、时间</p>	<p>本资产管理计划的净参与资金总额（不含参与费）不低于 1 千万元人民币，投资者的人数为 2 人（含）以上，且不超过 200 人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；</p> <p>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资产管理计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本资产管理计划成立。资产管理计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入注册登记机构指定的专门账户或</p>

		资产托管机构的募集专户，不得动用。
集合计划设立失败（本金及利息返还方式）		<p>本资产管理计划募集期结束，如出现下列情形，资产管理计划设立失败，管理人承担资产管理计划的全部募集费用，并将已认购资金及利息在募集期结束后 30 个工作日内退还资产管理计划委托人已缴纳的款项，认购资金产生的利息，以注册登记机构记录为准。</p> <p>1、本资产管理计划规模低于人民币 1 千万元；</p> <p>2、委托人的人数少于 2 人。</p>
集合计划份额转让		本集合资产管理计划份额不得转让
费用、报酬	费用种类（计提标准、方法、支付方式）	<p>（一）本资产管理计划的各项费用</p> <p>1、管理费：1%/年</p> <p>2、托管费：0.05%/年</p> <p>3、投资顾问费：0.5%/年</p> <p>4、业绩报酬：本资产管理计划按照本条款第（八）项的约定对超出部分计提 20%业绩报酬，其中 5%为管理人业绩报酬，支付给管理人，15%为投资顾问业绩报酬，支付给投资顾问。</p> <p>5、其他费用：</p> <p>与本资产管理计划相关的交易手续费、印花税、审计费、律师费、银行结算费用、开户费、登记结算及相关服务费等资产管理计划运营过程中发生的相关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，从资产管理计划资产中支付。</p> <p>上述计划费用中第 5 项费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付。以上所列费用管理人以固有财产先行垫付的，有权从本资产管理计划资产中优先受偿。</p> <p>上述第 1 至 5 均属于可列入资产管理计划财产费用的项目。资产管理计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不得在资产管理计划资产中列支。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资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。</p>

(二) 托管费

本资产管理计划的年托管费率为 0.05%，每日托管费计算方法如下：

$$T = E \times 0.05\% \div 365;$$

T 为每日托管费；

E 为前一日的资产管理计划资产净值。

托管费每日计提，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初第五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(三) 管理费

本资产管理计划的年管理费率为 1%，每日管理费计算方法如下：

$$T = E \times 1\% \div 365;$$

T 为每日管理费；

E 为前一日的资产管理计划资产净值。

管理费每日计提，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初第五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(四) 投资顾问费

本资产管理计划

的年投资顾问费率为 0.5%，每日投资顾问费计算方法如下：

$$T = E \times 0.5\% \div 365;$$

T 为每日投资顾问费；

E 为前一日的资产管理计划资产净值。

投资顾问费每日计提，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初第五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如

发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

投资顾问收款账户信息：

户名： 巨杉（上海）资产管理有限公司

账号： 121913343510606

开户银行： 招商银行上海分行民生支行

以上收款账户如有变更的；管理人需至少提前两个工作日以告知函的形式通知托管人，账户变更生效日为托管人收到告知函的次一工作日。

（五）交易费用：本资产管理计划应按规定比例在发生投资交易时计提并支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金、结算费等费用。

本资产管理计划向所租用交易单元的券商支付佣金，其费率由管理人根据有关政策法规确定。在每月初第五个工作日内支付给提供交易单元的券商。

（六）资产管理计划注册登记费用：资产管理计划注册登记机构收取的相关费用，包括存续期参与、退出等。

（七）其他费用：资产管理计划成立后的信息披露费用、会计师费和律师费、银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费资产管理计划运营过程中发生的相关费用。

银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间每日计提，按规定支付费用。

开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入资产管理计划费用。

本资产管理计划的审计费，按与会计师事务所签订协议所规定的金额和支付时间支付，由资产管理计划资产承担。

与资产管理计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入资产管理计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。

（八）业绩报酬

1、业绩报酬提取原则

(1) 两种情况下本计划将计提业绩报酬，一种是委托人申请退出或本资产管理计划期满清算或结算时提取，另一种是收益分配时提取；

(2) 按份额持有人每笔参与份额分别计提业绩报酬；

(3) 业绩报酬从委托人退出或清算金额中扣除或从委托人收益分配金额中扣除；

(4) 份额持有人退出或本计划终止时，业绩报酬对应按照份额持有人退出份额和本计划终止时持有份额计算。如赎回份额为某一笔认购/申购份额的一部分，则该赎回份额单独核算业绩报酬，而该笔认购/申购份额的剩余部分不受影响；

(5) 业绩报酬提取应当与资产管理计划的存续期限、收益分配和投资运作特征相匹配，提取频率不得超过每 6 个月一次。因投资者退出资产管理计划时，管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

2、业绩报酬的计算

在业绩报酬计提日，管理人根据每笔参与份额的高水位线原则，提取每笔参与份额计提日累计单位净值超过该笔参与份额上一发生业绩报酬计提日或参与日累计单位净值高水位线部分的 20%，作为业绩报酬，其中 5%为支付管理人业绩报酬，15%为支付投资顾问业绩报酬，于支付日由管理人出具划款指令给托管人，由托管人根据划款指令直接支付。

业绩报酬的计提方法如下：

当集合份额持有人申请赎回、分红或终止时，管理人根据委托人每一份的收益率（R）提取业绩报酬。经计算确认的业绩报酬从委托人赎回或清算款中或分红款项中以现金支付。

A=赎回日、分红日或终止日累计份额净值；

C=上一个业绩报酬提取日累计份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则 C 为该份额申购开放日累计份额净值（申购份额）或份额初始面值（认购份额）；

D=上一个业绩报酬提取日份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则 D 为该份额申购开放日份额净值（申购份额）或份额初始面值（认购

		<p>份额);</p> <p>E=业绩报酬;</p> <p>F=赎回或清算份额或分红日持有份额;</p> <p>收益率 $R=(A-C)/D \times 100\%$</p> <p>业绩报酬计提标准为:</p> <p>当 $R>0\%$时,对超过 0%的收益部分提取 20%的业绩报酬,即 $E=F \times (A-C) \times 20\%$。</p> <p>业绩报酬的支付:每次业绩报酬计提结束后,由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令,托管人于 5 个工作日内从资产管理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。因业绩报酬计算涉及注册登记数据,管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成,托管人无需复核。</p> <p>(九) 资产管理计划的税收</p> <p>为免歧义,各方特别约定并优先使用如下条款:本合同各方特别约定,如依据相关法律法规或财政税务主管部门的规定,就本计划投资运营过程中发生的增值税应税行为及其他应税行为,由管理人作为纳税主体缴纳的,该税费由计划财产承担,管理人有权以计划财产予以缴纳,且无需事先征得委托人的同意(除本约定外,本计划已列明的资产管理业务费用产生的税费由各收款方自行缴纳的,相关方应自行缴纳):管理人在向委托人交付利益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的,委托人应按照管理人通知要求缴纳相应税费(具体以管理人通知为准),管理人亦有权以计划剩余财产直接缴纳;委托人不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。如管理人因此垫付相应税费等款项的,管理人有权向委托人追索垫付的税费和孳息款项,委托人应按管理人通知向管理人指定账户返还垫付款。委托人已知悉并同意,计划资产承担上述税费可能导致资产变现损失或投资收益减损。</p>
收益分配	收益构成	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。
	分配原则	1、在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下,本计划每会计年度最多进行 1 次收益分配;

		<p>2、本计划由管理人决定收益分配基准日及收益分配发放日；</p> <p>3、同一类份额享有同等分配权；</p> <p>4、本计划收益分配方式为现金分红；</p> <p>5、收益分配基准日计划的份额净值减去每份额收益分配金额后不能低于1.000元；</p> <p>6、收益分配比例由管理人根据计划运作情况决定；</p> <p>7、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由资产管理计划财产承担；</p> <p>8、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在法律法规和监管机构允许的范围内，经全体投资者、管理人、托管人书面协商一致，可以对上述收益分配条件和时间进行调整，并在管理人网站上公告。</p>
	分配方式	收益分配方案经管理人、托管人协商一致，在管理人网站上公告。
集合计划展期	是否可以展期	到期可以展期
终止和清算		<p>资产管理计划终止的情形，包括但不限于下列事项：</p> <p>（一）资产管理计划存续期届满且不展期；</p> <p>（二）经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；</p> <p>（三）管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；</p> <p>（四）托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；</p> <p>（五）持续五个工作日投资者少于2人的；</p> <p>（六）未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；</p> <p>（七）法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。</p>

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报中国证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

集合计划的清算

资产管理计划在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划资产，以及财产清算的有关事项：

（一）资产管理计划财产清算小组

1. 资产管理计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

2. 资产管理计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

（二）资产管理计划财产清算的程序

1、资产管理计划达到终止条件管理人应通知托管人准备进入清算程序。自资产管理计划终止之日起 5 个工作日内成立资产管理计划清算小组，资产管理计划清算小组按照监管机构的相关规定进行资产管理计划清算；

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 5 个工作日内，管理人和托管人应当在按照本本合同规定扣除清算费用、管理费、托管费等费用后，将资产管理计划资产按照委托人拥有资产管理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，并注销资产管理计划专用证券账户、资金账户等；

4、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单元保证金，在注册登记机构对其进行调整交收日才能收回，届时，资产管理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，并注销资产管理计划专用证券账户和资金账户。

6、清算结束后 5 个工作日内，管理人应当按照本条（四）的清偿顺序分配资产管理计划剩余财产。

（三）清算费用由计划财产承担，支付方式以管理人公告为准。

（四）资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

资产管理计划财产按下列顺序清偿：

	<p>(1) 支付清算费用；</p> <p>(2) 交纳所欠税款；</p> <p>(3) 清偿计划债务；</p> <p>(4) 按照合同约定支付管理费、托管费；</p> <p>(5) 将资产管理计划资产按委托人持有资产管理计划份额的比例和合同的约定分配给委托人。</p> <p>(五) 资产管理计划延期清算处理方式</p> <p>若本资产管理计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定多次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据多次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行多次清算，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，以货币资金的形式全部分配给委托人。</p> <p>资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p> <p>(六) 资产管理计划财产清算报告的告知安排</p> <p>清算结束后 5 个工作日内由资产管理计划清算小组在管理人网站公布清算结果，并且在清算结束后 5 日内，将清算结果报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；</p> <p>(七) 资产管理计划财产清算完毕后，托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户、证券账户和期货账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。</p> <p>(八) 资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。</p>
<p>投资风险揭示</p>	<p>本资产管理计划面临包括但不限于以下风险：</p> <p>(一) 市场风险</p> <p>市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：</p> <p>1、政策风险</p> <p>货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化</p>

对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

2、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

3、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使资产管理计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

4、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致资产管理计划投资收益变化。

5、衍生品风险。金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

6、购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

（二）管理风险

在集合资产管理计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响集合资产管理计划的收益水平，从而产生风险。

（三）流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本资产管理计划在开放期出现投资者大额或巨额赎回，致使本资产管理计划没有足够的现金应付资产管理计划退出支付的要求所导致的风险。

（四）信用风险

资产管理计划在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约，从而导致资产管理计划财产损失。

(五) 管理人、托管人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险

管理人、托管人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

(六) 募集失败风险

募集期结束后，若本资产管理计划未达到最低起始运作规模，则存在计划募集失败的风险。

(七) 关联交易风险

若本计划涉及关联交易，可能存在损害投资者利益的风险。

(八) 本资产管理计划的特定风险

1、资产管理计划提前终止的风险

资产管理计划运作期间，当本资产管理计划单位净值等于或低于平仓线的，本资产管理计划有提前终止的风险。

2、委托人可能无法参与的风险

由于本资产管理计划设定了募集期及存续期的规模上限要求，管理人将根据合同的约定对份额的规模进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本资产管理计划或参与被确认无效的风险。

3、极端情形下的损失风险

在极端情况下，如果本资产管理计划发生大幅度的投资亏损，委托人份额可能不能获得收益甚至可能面临本金受损的风险。

4、默认处理的风险

在本资产管理计划合同变更或展期安排中，可能存在但不限于以下潜在风险：

合同中约定委托人不同意资产管理计划合同变更或展期安排的，需在规定期限内按照管理人公告规定的形式回复意见。在此情况下，存在委托人对默认情况的忽略或误解的风险。

5、备案不通过的风险

若因政策变动或者相关监管机构认为本资产管理计划约定不适当而导致备案不通过或者备案通过后被监管机构叫停的，管理人有权在不影响委托人实质性利益的前提下和托管人协商一致修改本集合合同条款或者提前终止本资产管理计划，提请投资者注意此风险。

6、使用电子签名合同的风险

如本资产管理计划资产管理合同采用电子签名方式签署的，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。

(九) 本资产管理计划所投资标的的风险

1、投资股指期货的特有风险

(1) 强制平仓和强制减仓的风险

股指期货实行当日无负债结算制度，对资金管理要求非常高。价格波动剧烈的时候可能面临追加保证金问题，如果没有在规定时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，投资者可能会因此导致亏损。

强制减仓是当市场出现连续两个及两个以上交易日的同方向涨停(跌)等特别重大的风险时，中金所为迅速、有效化解市场风险，防止会员大量违约而采取的措施，即，中金所将当日以涨跌停板价申报的未成交平仓报单，以当日涨跌停板价与该合约净持仓盈利投资者按持仓比例自动撮合成交。由上述减仓造成的经济损失由会员及其投资者承担。

强制平仓和强制减仓都有可能导导致集合计划的多空头寸的市值不匹配，从而使集合计划面临股票市场的系统性风险暴露。

(2) 信用风险

对于金融期货交易而言，信用风险发生的概率极小，原因是在进行期货交易而言，交易所有一套独特的交易体系，如设立一系列的保证金制度，最低资金要求，逐日盯市结算措施及强行平仓制度等，使整个市场的信用风险下降。但这种由结算公司充当所有投资者的交易对手，并承担履约责任，一旦结算公司出现风险暴露，由于其风险过度集中，在重大风险事件发生时，或风险监控制度不完善时也会发生信用风险。

(3) 结算风险

投资者金融期货投资的结算及投资者金融期货资产账户项下的资产保管由期货经纪公司负责。证券投资者如果选择的证券及期货经纪公司在交易过程中存在违法违规经营行为或破产清算，也可能给投资者带来损失。

对从事金融期货的投资者来说，为投资者进行结算的结算会员或同一结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中国金融期货交易所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，投资者的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

2、投资股票期权的特有风险

(1) 价值归零风险

在临近到期日时，虚值和平值期权价值将逐渐归零。在这种情况下，期权到期时权利方将损失全部的权利金。

(2) 到期不行权风险

实值期权在到期时具有内在价值，但如果权利方在行权日未能及时行权或平仓，将损失其原本应得的收益。

(3) 杠杆风险

股票期权可以为投资者带来杠杆收益，但也有可能损失全部权利金（买方），甚至造成更大的损失（卖方）。

(4) 高溢价风险

当出现期权合约价格大幅高于合理价值时，可能出现高溢价风险，投资者切忌跟风炒作。

(5) 流动性风险

在期权合约流动性不足或停牌时，投资者可能无法及时平仓，特别是深度实值/虚值的期权合约，其流动性风险相对更大。

(6) 保证金风险

当市场出现不利变动时，期权卖方可能随时被要求提高保证金数额，若无法按时补足，还可能被强行平仓。

(7) 行权交割风险

如果投资者未能在规定时间备齐足额的现金或现券，可能会造成行权失败或交割违约。

	<p>(十) 其他风险</p> <p>技术风险、操作风险、不可抗力因素导致的风险等。</p> <p>1、管理人操作或者技术风险、电力故障等都可能对本资产管理计划的资产净值造成不利影响；</p> <p>2、因资产管理计划业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；</p> <p>3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；</p> <p>4、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管银行违约等超出资产管理计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致资产管理计划或者资产管理计划委托人利益受损；</p> <p>5、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致资产管理计划资产的损失。</p> <p>6、税收风险</p> <p>根据财政部和国家税务总局《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税【2016】140号文）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税【2017】2号文）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税【2017】56号文），2018年1月1日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，应缴纳增值税。根据资产管理合同，该增值税由本资产管理计划财产承担，管理人有权从资管计划财产计提和扣收增值税。在该种情况下，资管计划的可分配收益可能受到影响，由此会产生委托人收益的减少的风险。</p>
<p>信息披露</p>	<p>(一) 定期报告</p> <p>定期报告包括资产管理计划单位净值报告、资产管理计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告、年度审计报告和对账单。</p> <p>1、资产管理计划单位净值报告</p> <p>披露时间：每周第一个工作日披露上周最后一个工作日资产管理计划单位净值。</p> <p>披露方式：管理人通过管理人网站（www.shgsec.com）披露资产管理计划单位净值。</p>

2、资产管理计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人每季度向委托人提供一次准确、完整的资产管理季度报告，对报告期内资产管理计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易等做出说明。资产管理季度报告由管理人编制，资产托管人仅对其中的投资组合报告进行复核。托管人在每季度出具托管报告。上述报告应由管理人于每季度截止日后一个月内通过管理人网站通告，并报中国证券投资基金业协会、证券公司（管理人）住所地中国证监会派出机构。

季度报告包括但不限于下列信息：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划财务会计报告；
- (6) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用，包括计提基准、计提方式和支付方式；
- (8) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (10) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划成立不足三个月的，管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告。

3、资产管理计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人每年度向委托人提供一次准确、完整的资产管理年度报告，对报告期内资产管理计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易等做出说明。资产管理年度报告由管理人编制，资产托管人仅对其中的财务报表、投资组合报告进行复核。托管人在每年度出具托管报告。上述报告应由管理人于每年度截止日后 4 个月内通过管理人网站通告，并报中国证券投资基金业协会、证券公司（管理人）住所地中国证监会派出机构。

年度报告包括但不限于下列信息：

- (1) 管理人履职报告;
- (2) 托管人履职报告;
- (3) 资产管理计划投资表现;
- (4) 资产管理计划投资组合报告;
- (5) 资产管理计划财务会计报告;
- (6) 资产管理计划运用杠杆情况 (如有);
- (7) 资产管理计划财务会计报告;
- (8) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用, 包括计提基准、计提方式和支付方式;
- (9) 资产管理计划投资收益分配情况;
- (10) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项;
- (11) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划成立不足三个月的, 管理人可以不编制资产管理计划当期的年度报告。

4、年度审计报告

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本资产管理计划的运营情况进行年度审计, 并在每会计年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给托管人, 通过管理人网站向委托人提供, 并报中国证券投资基金业协会、管理人住所地中国证监会派出机构。

5、对账单

管理人根据委托人的申请要求, 向委托人提供季度对账单。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值, 参与、退出明细, 以及收益分配等情况。

委托人应向管理人提供邮寄地址等资料, 因委托人未正常提供以上信息、邮寄运营商系统平台故障及内部操作等原因导致委托人未能获得邮寄对账单的, 管理人不承担任何责任。

(二) 临时报告

本资产管理计划存续期间, 发生对本资产管理计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件, 管理人应当在事项发生之日起五个工作日内

在管理人网站(www.shgsec.com)公告的方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

1、资产管理计划运作过程中，负责集合资产管理业务的投资经理发生变更，或出现其他可能对资产管理计划的持续运作产生重大影响的事项；

2、发生巨额退出并延期支付；

3、资产管理计划终止和清算；

4、资产管理计划存续期满并展期；

5、管理人以自有资金参与和退出；

6、合同的补充、修改与变更；

7、与资产管理计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

8、负责本资产管理计划的代理销售机构发生变更；

9、资产管理计划投资于管理人及与管理人有关联关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；

10、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；

11、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

12、管理人或托管人变更；

13、资产计价出现错误（当资产估值导致本资产管理计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本资产管理计划单位净值错误）；

14、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；

15、其他发生对资产管理计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件。

16、管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本资产管理计划；

17、管理人认为重大的其他事项。

（三）通知与送达

1、委托人承诺可通过电话、传真、电子邮件、短信、公告等任何一种方式接收管理人的通知事项。

2、委托人确认管理人按照以下任何一种方式进行通知送达的，视为管理人已经履行本合同项下通知义务，同时视为委托人对管理人欲通知的内容已



	<p>全部知悉理解：</p> <p>(1) 以电话方式通知的，以通话当时视为已通知送达；</p> <p>(2) 以传真方式通知的，以传真发出即视为已通知送达；</p> <p>(3) 以电子邮件方式通知的，以电子邮件发出即视为已通知送达；</p> <p>(4) 以短信方式通知的，以短信发出时即视为已通知送达。</p> <p>(5) 以公告方式通知的，以公告发布之日即视为已通知送达。</p> <p>3、委托人将随时保持电话等联络方式的畅通，随时查看管理人发出的传真、电子邮件、短信及公告信息，如因委托人怠于履行查看义务或提供的联络方式发生变动且未及时变更的，由此产生的责任和风险由委托人自行承担。</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>