

华安证券恒贏 7 号集合资产管理计划说明书

二零一九年 月

特别提示：

本说明书依据《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》）、《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《运作管理规定》）、《华安证券恒贏 7 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，不存在任何虚假内容、误导性陈述和重大遗漏。

投资者承诺以真实身份和自有资金参与资产管理计划，并承诺委托资金的来源符合法律、行政法规的规定，所披露或提供的信息和资料真实，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本集合计划资产，但不保证本集合计划资产投资不受损失，不保证最低收益。本说明书对计划未来的收益预测仅供投资者参考，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》的投资者，其认购或申购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。投资者将按照《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。

| | | |
|----------------|--------|--|
| 计划 基本 信息 | 名称 | 华安证券恒贏 7 号集合资产管理计划 |
| | 类型 | 固定收益类集合资产管理计划 |
| | 目标规模 | 本集合计划推广期和存续期均无规模上限。 |
| | 管理期限 | 本集合计划管理期限为十年，到期后可展期。 |
| | 推广期 | 管理人与托管人协商一致即启动计划的推广工作。2019 年 10 月 18 日至 2019 年 10 月 25 日，具体推广期以管理人的发行公告为准，但最长不超过 60 天。 |
| | 封闭期 | 封闭期：指本集合计划封闭运作，不接受投资者的参与和退出业务的阶段。 |
| | 开放期 | 本计划自成立之日起 6 个月为封闭期，封闭期结束后次月的前 5 个工作日为首个开放期，之后每满 6 个月后当月的前 5 个工作日为后续开放期。遇节假日顺延，如有变动，管理人可视情况调整，以管理人公告为准。投资者可在开放期办理参与和退出。 |
| | 建仓期 | 本集合计划建仓期自产品成立之日起不得超过 3 个月。 |
| | 份额面值 | 人民币 1.00 元。 |
| | 风险收益特征 | 本产品以债券投资为主，风险评级为 R2 级。 |
| | 最低金额 | 首次参与最低金额为人民币 30 万元，追加参与的最低金额为人民币 1000 元。 |
| | 相关费率 | 1、认购/申购费：0 2、退出费：0 3、管理费：0.5%/年 4、托管费：0.05%/年 5、业绩报酬：本集合计划封闭期间对该产品年化收益率超过业绩报酬计提基准部分提取 60%作为业绩报酬，提取频率不超过每 6 个月一次。 6、业绩报酬计提基准：首个封闭期业绩报酬计提基准为产品成立时中国人民银行一年期定期存款基准利率+3.8%，封闭期内若一年期定期存款基准利率调整，业绩报酬计提基准不作变更。其后每个封闭期的业绩报酬计提基准，管理人将根据实际情况进行适当调整，届时以管理人公告为准。 |

| | |
|--------|---|
| | 7、其他费用：除交易手续费、增值税、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。 |
| 份额的分级 | 本集合资产管理计划不分级 |
| 投资范围 | <p>1、投资范围：（1）本集合计划投资于国内依法发行的国债、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、企业债券、公司债券（含非公开发行公司债）、可转债、可交换债、债券型基金、分级基金优先级、资产证券化产品、现金、债券逆回购、银行存款、同业存单、超短期融资券、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、货币市场基金及中国证监会允许本集合计划投资的其他固定收益类产品，可参与债券正回购。投资信用类债券，主体评级（或债项）必须在 AA（含）以上；（2）本集合计划投资资产证券化产品，底层资产非产品，底层资产相对分散，现金流稳定，现金流归集路径清晰；投资份额仅限于优先级，且投资评级为 AA（含）以上的份额；投资品种挂牌场所为银行间市场和交易所市场。（3）可参与一级市场新股申购、可转债与可交换债转股；（4）投资者在此同意并授权管理人可以将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。交易完成 5 个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者，并向中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会和证券交易所报告。</p> <p>2、资产配置比例：（1）本集合计划投资固定收益类资产比例为资产总值的 80-100%，可参与债券正回购，但债券正回购金额不得超过该计划资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外；（2）本集合计划投资于同一资产的资金，不超过该计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合计划资产管理计划，以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合计划资产管理计划，不受前款规定限制。（3）本集合计划投资可转债、可交换债等产品金额不超过资管计划资产净值的 40%；（4）本集合计划参与新股申购所获配新股及可转债或可交换债因转股而持有的股票，合计不超过计划资产净值的 20%；（5）本集合计划现金类资产比例为资产总值的 0-100%。其中，现金类资产包括但不限于：现金、银行存款、同业存单、剩余期限在 7 天以内的债券逆回购、货币市场基金、期限在 1 年以内的国债、政策性金融债及央行票据等。</p> |
| 适合推广对象 | 本集合计划主要投资于债券等固定收益类金融工具，风险评级为 R2 级，可面向 C2、C3、C4 和 C5 类投资者进行推广。 |
| 当事人 | 管理人 华安证券股份有限公司 |
| | 托管人 中国光大银行股份有限公司 |
| | 代理推广机构 华安证券股份有限公司 |
| 计划的 | 办理时间 投资者可以在推广期和开放期的任意一个工作日参与本集合计划。 |
| | 办理场所 华安证券各营业部 |
| | 办理方 1、推广期参与价格为份额面值，存续期参与价格为开放期内参与当日的集合计划。 |

| | |
|--------|--|
| 参与 | <p>式、程序</p> <p>划单位净值。</p> <p>2、本计划采用金额参与的方式，即参与以金额申请。</p> <p>3、投资者办理参与业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。</p> <p>4、当日的参与申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。</p> <p>5、参与申请的确认。销售网点受理参与申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对投资者参与申请的有效性进行确认。投资者可在当个开放期结束后至各销售网点查询最终确认情况。</p> <p>6、参与申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，为无效申请，已交付的委托款项将退回投资者指定资金账户。</p> <p>7、管理人在不损害投资者权益的情况下，经与销售机构协商一致，可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前3个工作日告知投资者。管理人提前3个工作日在其网站集合理财相关区域上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。同时，管理人应提前书面告知销售机构。</p> <p>8、拒绝或暂停参与的情形及处理方式：</p> <p>(1) 在如下情况下，管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：</p> <p>a.本计划份额持有人达到200户；</p> <p>b.根据市场情况，管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对本计划业绩产生负面影响，从而损害现有投资者的利益的情形；</p> <p>c.因本计划所持某个或某些证券进行权益分派等原因，使管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有投资者利益的；</p> <p>d.管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他投资者利益的；</p> <p>e.法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>管理人决定拒绝接受某些投资者的参与申请时，参与款项将退回投资者账户。</p> <p>(2) 在如下情况下，管理人可以暂停接受投资者的参与申请：</p> <p>a.因不可抗力导致无法受理投资者的参与申请；</p> <p>b.证券、期货交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值和计划份额净值；</p> <p>c.发生本合同规定的暂停计划资产估值情况；</p> <p>d.法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知投资者。在暂停参与的情形消除时，管理人应及时恢复参与业务的办理并予以告知投资者。</p> |
| 参与费 | 参与费率及计算：投资者参与本资产管理计划，免收参与费用。 |
| 认购资金利息 | 投资者的参与资金在推广期产生的利息将折算为计划份额归投资者所有。 |
| 计划的退出 | <p>退出安排</p> <p>1、退出的办理时间</p> <p>投资者可在开放期内根据合同约定的方式办理集合计划的退出业务。</p> <p>2、退出的原则</p> <p>(1) “未知价”原则，即本计划的退出价格以退出申请提交日所在交易日收市后计算的计划份额净值为基准进行计算；</p> <p>(2) 采用份额退出的方式，即退出以份额申请；</p> |

| | |
|--|---|
| | <p>(3) 可将其全部或部分集合计划份额退出。本集合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，选择部分退出本计划份额的，投资者在退出后持有的计划份额所对应的资产净值不得低于【30】万元。当管理人发现投资者申请部分退出本计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划份额所对应的资产净值低于30万元人民币的，管理人有权适当减少该投资者的退出金额，以保证部分退出申请确认后投资者持有的计划份额所对应的资产净值不低于【30】万元。当投资者持有的计划份额所对应的资产净值低于【30】万元人民币（含【30】万元人民币）时，需要退出本计划的，投资者必须选择一次性全部退出本计划；</p> <p>(4) 投资者在退出计划份额时，管理人按时间优先的原则，对该持有人账户中的计划份额进行处理，即先确认的份额先退出，后确认的份额后退出。</p> <p>3、退出的程序和确认</p> <p>(1) 退出申请的提出</p> <p>投资者可在原参与网点，在规定的开放时间内出示有效身份证件办理退出申请，或登录原参与推广机构指定的网络系统以自主下单的方式申请退出集合计划。投资者提交退出申请时，其必须在注册登记机构有足够的集合计划余额。</p> <p>(2) 退出申请的确认</p> <p>销售网点受理退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了退出申请。退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对投资者退出申请的有效性进行确认。投资者可在当个开放期结束后至各销售网点查询最终确认情况。</p> <p>(3) 退出款项划付</p> <p>投资者退出申请确认后，管理人应按规定向投资者支付退出款项，退出款项自确认之日起7个工作日内支付退出款项。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。</p> <p>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投资者账户。</p> <p>4、退出费</p> <p>本集合计划不收退出费。</p> <p>5、退出的限制与次数</p> <p>本集合计划不设退出次数限制。</p> <p>6、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>在单个开放日，本集合计划净退出申请份额（退出申请份额总数扣除参与申请份额总数后的余额）超过1000万份（包括1000万份）时，即认为发生了大额退出。</p> <p>(2) 单个委托人大额退出的申请和处理方式</p> <p>单个投资者大额退出的预约申请单个投资者的单笔退出为巨额退出的情况下，该投资者必须在开放期之前至少提前3个交易日向管理人提交预约退出申请。</p> <p>7、巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(1) 认定标准</p> <p>若本计划于某个开放期内的计划份额净退出申请超过前一交易日的计划总份额的【10%】，即认定为计划发生了巨额退出。在单个开放日，本集合计划净额退出申请份额（退出申请份额总数扣除参与申请份额总数后的余额）超过1000万</p> |
|--|---|

份（包括 1000 万份）时，即认为发生了大额退出。同一开放期内连续 2 个开放日以上（含 2 个交易日）发生巨额退出，即认定为计划发生了连续巨额退出。出现巨额退出时，管理人和销售机构协商一致，可以根据本计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。出现连续巨额退出时，如管理人认为有必要，可暂停接受计划份额退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过【20】个工作日，并应当及时告知投资者。

（2）退出顺序、退出价格确定和退出款项支付

a.全额退出：当管理人和销售机构认为有能力兑付投资者的全部退出申请时，管理人接受全额退出，并按正常退出程序执行。

b.部分退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为因支付投资者的退出申请而进行的财产变现可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于上一交易日计划总份额的【10%】的前提下，可对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，应当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；对于未能退出部分，投资者在提交退出申请时可以选择延期退出或取消退出。选择延期退出的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部退出为止；选择取消退出的，当日未获受理的部分退出申请将被撤销。延期的退出申请与下一开放日退出申请一并处理，无优先权并以下一开放日的各类计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部退出为止。如投资者在提交退出申请时未作明确选择，投资者未能退出部分作自动延期退出处理。

（3）告知客户方式

当发生巨额退出、连续巨额退出时，管理人应当及时告知投资者。管理人在其网站集合理财相关区域上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

8、延期支付及延期退出的情形和处理方式

发生下列情形时，管理人可延期支付退出款项或延期办理投资者退出申请：

（1）因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

（2）发生本合同规定的暂停基金资产估值情况。

（3）证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值。

（4）同一开放期内连续两个或两个以上交易日发生巨额退出。

（5）发生继续接受退出申请将损害现有份额持有人利益的情形时。

（6）当前一估值日计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当延期支付退出款项或延期办理退出申请。

（7）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定延期支付或延期支付时，已确认的退出申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第（4）款所述情形，按本合同的相关条款处理。在延期退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知投资者。

9、拒绝或暂停退出的情形及处理方式：

在如下情况下，管理人可以暂停接受投资者的退出申请：

（1）因不可抗力导致管理人无法支付退出款项。

（2）证券交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值

| | |
|-------------------|--|
| | <p>和计划份额净值。</p> <p>(3) 发生本合同规定的暂停本计划资产估值的情况。</p> <p>(4) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。</p> <p>(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一的，管理人应当及时告知投资者。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并及时告知投资者。管理人在其网站集合理财相关区域上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。</p> <p>10、本计划不接受违约退出。</p> |
| 办理场所 | 华安证券各营业部 |
| 管理人自有资金参与情况 | <p>管理人可以使用自有资金参与本集合计划。</p> <p>1、自有资金的参与条件 管理人以自有资金参与本计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司股东会、董事会或其他授权程序的批准。</p> <p>2、自有资金的参与方式 管理人在推广期和存续期内可以以自有资金参与本计划。</p> <p>3、自有资金参与的份额比例 自有资金参与的份额不得超过本计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本计划的份额合计不得超过计划总份额的 50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，管理人应当依照中国证监会规定及本合同约定及时调整达标。</p> <p>4、自有资金的收益分配和责任承担 管理人自有资金所持的集合资产管理计划份额，应当与投资者所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。</p> <p>5、自有资金的退出 管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。自有资金参与、退出时，应提前 5 个工作日告知投资者和托管人。 为应对本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，管理人自有资金的参与、退出可不受前述比例和持有期限限制，但应及时告知投资者和托管人，并向相关证监会派出机构及协会报告。</p> |
| 计划成立的条件、时间 | <p>本集合资产管理计划的募集金额缴足之日起十个工作日内，管理人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，若满足集合计划的成立条件，则在投资者参与资金实际交付并经管理人确认以后，资产管理人宣布本集合计划成立，并将成立公告以书面形式发送资产托管人。计划设立完成前，投资者的参与资金只能存入计划份额登记机构指定的专门账户，不得动用。具体成立日期以管理人公告为准。本集合计划成立条件：</p> <p>1、本计划初始募集规模不低于 1000 万元； 2、投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人； 3、募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。</p> |
| 计划设立失败（本金及利息返还方式） | 推广期满，集合计划参与资金总额（不含参与费与管理人自有资金参与部分）未达到 1000 万元人民币，或其投资者少于 2 人，或推广期内发生使本集合计划无法设立的不可抗力事件，则本集合计划设立失败。如本集合计划设立失败，管理 |

| | |
|--------|--|
| | 人将投资者认购参与资金及其所产生的同期银行活期存款利息，在推广期结束后30天内返还给投资者，各方互不承担其他责任。管理人须在本集合计划设立失败后5个工作日内向中国证监会及住所地中国证监会派出机构报告。 |
| 计划份额转让 | 集合计划存续期间，客户可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。转让后，持有资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。管理人应当在集合资产管理计划份额转让前，对受让人的合格投资者身份和资产管理计划的投资者人数进行合规性审查。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订资产管理合同。 |
| 费用、报酬 | <p>1、管理费 集合计划管理费按前一日集合计划资产净值 0.5%的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ 备注：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。 管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据管理人的指令于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。 管理人可根据市场行情及本集合计划运作情况，经与托管人协商一致后，调整管理费率，以管理人网站公告为准。</p> <p>2、托管费 集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值 0.05%的年费率计提。计算方法如下： $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ 备注：H 为每日应计提的集合计划托管费；E 为前一日集合计划资产净值。 托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据管理人的指令于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。 托管人可根据市场行情及本集合计划运作情况，经与管理人协商一致后，调整托管费率，以管理人网站公告为准。</p> <p>3、投资交易费用 投资交易费用指集合计划进行各类投资品种的投资交易而形成的费用，包括但不限于：印花税、交易所经手费、证管费、银行间交易手续费、场外基金办理要求的申购赎回等费用、结算费、过户费、佣金、证券结算风险基金等各项费用，投资交易费用在交易发生时直接计入当期费用；以上各项费用的费率标准按照相关法规政策执行，其中本集合计划支付的佣金费率，由管理人根据有关政策法规确定。</p> <p>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定协议所规定的金额，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。</p> <p>5、按照国家有关规定可以列入的其他费用 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、注册与过户登记人收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用。 银行结算费用，在发生时一次计入集合计划费用； 银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在发生时一次性计入费用； 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集合计划</p> |

| | <p>费用；</p> <p>与集合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，可以在发生时一次进入集合计划费用；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。</p> <p>上述计划费用中第（3）至（4）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。</p> | | | | | | | | | |
|------------------------|---|---|------|----------|------------------------|---|---|----------------|-----|---|
| 不由计划承担的费用 | <p>本集合计划推广期间的费用，管理人、托管人因未履行或未完全履行义务，从而导致的费用支出或本集合计划资产的损失，以及处理与本集合计划运作无关的事项而发生的费用，均不列入本集合计划费用。</p> | | | | | | | | | |
| 业绩报酬 | <p>1、管理人收取业绩报酬的原则：</p> <p>（1）按投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬；</p> <p>（2）在符合业绩报酬计提条件时，在计划分红日（具体以届时的分红公告为准，下同）、投资者退出日和计划终止日计提业绩报酬，提取频率不超过每 6 个月一次；</p> <p>（3）在计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；</p> <p>（4）在投资者退出和计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；</p> <p>（5）在投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额包括一笔参与份额的一部分，则将该部分参与份额视为一笔参与份额进行核算。</p> <p>2、封闭期间业绩报酬的计提方法：</p> <p>（1）当计划分红日、投资者退出日或计划终止日时，若持有期年化收益率 R 小于或等于业绩报酬计提基准，管理人不提取业绩报酬。</p> <p>（2）当计划分红日、投资者退出日或计划终止日时，若持有期年化收益率 R 大于业绩报酬计提基准，管理人提取超出部分的 60%作为业绩报酬。</p> <p>（3）以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，推广期参与的为计划成立日，存续期参与的为申购参与当日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的年化收益率。年化收益率的计算公式如下：</p> $R = \frac{P_1 - P_0}{P} \times \frac{365}{N} \times 100\%$ <p>业绩报酬计提日为计划分红日、投资者退出日或计划终止日； R 为年化收益率 P1 为业绩报酬计提日的份额累计净值； P0 为上一个发生业绩报酬计提日的份额累计净值； P 为上一个发生业绩报酬计提日的份额净值； N 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数。</p> <p>（4）管理人以超额比例的方式提取业绩报酬</p> <p>具体计算方法如下：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>年化收益率(R)</th> <th>提取比例</th> <th>业绩报酬 (F)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R \leqslant$ 业绩报酬计提基准</td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td>$R >$ 业绩报酬计提基准</td> <td>60%</td> <td>$F = A \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 60\% \times \frac{N}{365}$</td> </tr> </tbody> </table> <p>注：①F 为投资者每笔参与应提取的业绩报酬；</p> | 年化收益率(R) | 提取比例 | 业绩报酬 (F) | $R \leqslant$ 业绩报酬计提基准 | 0 | 0 | $R >$ 业绩报酬计提基准 | 60% | $F = A \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 60\% \times \frac{N}{365}$ |
| 年化收益率(R) | 提取比例 | 业绩报酬 (F) | | | | | | | | |
| $R \leqslant$ 业绩报酬计提基准 | 0 | 0 | | | | | | | | |
| $R >$ 业绩报酬计提基准 | 60% | $F = A \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 60\% \times \frac{N}{365}$ | | | | | | | | |

| | |
|------|---|
| | <p>②R 为年化收益率； ③A 为投资者每笔参与在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。</p> <p>(5) 业绩报酬的支付 提取业绩报酬时，由管理人向托管人发送业绩报酬划款指令，托管人收到指令后从本集合计划资产中以现金的方式一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。管理人的业绩报酬由管理人负责计算，托管人不承担复核义务。</p> <p>(6) 业绩报酬的计算与复核 业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。</p> |
| 收益分配 | 收益构成 本集合计划收益包括集合计划利息收入、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。本集合计划净收益为集合计划收益扣除按照有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。 资产管理计划可供分配收益：截至收益分配基准日资产管理计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。 |
| | 分配原则 1、本计划存续期内，本计划份额净值大于 1.00 元时，管理人可根据投资运作情况决定是否向投资者分配收益，且分配后净值不得低于 1.00 元，每一计划份额享有同等分配权。具体分配方案、分配比例及收益分配时间以管理人公告为准； 2、本计划收益分配方式为现金分红，具体以管理人公告为准； 3、管理人在每个收益分配基准日确定收益分配方案后，在【3】个工作日内进行收益分配； 4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 |
| | 分配方式 现金分红。 |
| | 分配方案 本集合计划收益分配方案由管理人拟定，在开放日进行收益分配，管理人不另行公告收益分配方案。 |

| | |
|-------|---|
| 终止和清算 | <p>(一) 集合计划应当终止的情形,包括但不限于下列事项:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、资产管理计划存续期届满且不展期; 2、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的; 3、持有人大会决议提前终止资产管理合同; 4、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、被宣告破产,且在六个月内没有新的管理人承接; 5、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产,且在六个月内没有新的托管人承接; 6、持续五个工作日投资者少于 2 人的; 7、未在基金业协会完成备案或不予备案的情形; 8、法律、法规或中国证监会规定的其他情况。 <p>本集合计划终止之日起五个工作日内,由管理人将终止情况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,并同时通告投资者。</p> <p>销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认,而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认,退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对投资者参与、退出申请的有效性进行确认。投资者可在当个开放期结束后至各销售网点查询最终确认情况。</p> <p>(二) 集合计划清算小组</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、自集合计划终止之日起 5 个工作日内由管理人组织成立清算小组,清算小组必须在中国证监会的监督下进行集合计划清算。 2、本集合计划终止之日起 20 个工作日内,托管人在扣除管理费、托管费、清算费用等费用后,将集合计划资产按照投资者拥有份额的比例或本合同的约定,以货币形式全部分配给投资者,并注销集合计划的证券账户和资金账户。 如本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券,管理人应根据本节“本集合计划应当终止的情形”中所述的二次清算方案的规定,对未能流通变现的证券在可流通变现后进行变现和二次清算,并将变现后的资产按照投资者持有集合计划份额的比例或本合同的约定,以货币形式全部分配给投资者。 3、集合计划清算小组成员由集合管理人、集合计划托管机构、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划清算小组可以聘请必要的工作人员。 4、集合计划清算小组负责集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划清算小组可以依法进行必要的民事活动。 <p>销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认,而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认,退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对投资者参与、退出申请的有效性进行确认。投资者可在当个开放期结束后至各销售网点查询最终确认情况。管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算结果报基金业协会备案,并抄报中国证监会相关派出机构。</p> |
| 特别说明 | 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。 |