

申港证券明珠 FOF1 号
集合资产管理计划产品说明书
2020 年 月 日

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》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称《内容与格式指引》）《申港证券明珠 FOF1 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。

投资者承诺以真实身份参与资产管理计划，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资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利，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》的投资者，其认购或申购资产管理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。

集合计划基本信息	名称	申港证券明珠 FOF1 号集合资产管理计划
	管理期限	9 年
	产品类型	商品及金融衍生品类集合资产管理计划
	募集期	指本资产管理计划开始接受投资者认购参与日至募集结束日，具体时间见有关公告，本资产管理计划初始募集期不超过 60 天。
	封闭期	1、封闭期：本资产管理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。 2、开放期：（1）本计划自成立后每 3 个月的对应日开放一次参与（如遇非工作日，则顺延至下一个工作日开放），每次开放五天，投资者可办理参与申请，具体以管理人网站发布的公告为准。
开放期	（2）本计划自成立后每 6 个月的对应日开放一次退出（如遇非工作日，	

	<p>则顺延至下一个工作日开放), 每次开放五天, 投资者可办理退出申请, 具体以管理人网站发布的公告为准。</p> <p>(3) 本集合资产管理计划每三个月至多开放一次计划份额的参与、每六个月至多开放一次计划份额的退出, 中国证监会另有规定的除外。</p> <p>仅在合同变更基于投资者利益考虑或因资产管理计划规模变动等客观因素导致管理人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情形下, 管理人才有权设置临时开放期, 临时开放期内投资者可办理退出申请, 临时开放期的具体安排以管理人公告为准。</p>
预警平仓线	<p>本计划预警线:【0.9000】, 设置平仓线:【0.8700】</p> <p>管理人特别提示: 本计划设置 0.8700 元为平仓线, 并不代表管理人完成平仓变现后本计划单位净值等于 0.8700 元, 根据管理人变现操作的交易执行情况, 本计划终止日计划单位净值可能低于 0.8700 元。</p>
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 1,000,000.00 元, 追加参与的最低金额为人民币 10,000.00 元。
投资经理	周颖颖、黄群
投资范围	<p>(1) 权益类: 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)、沪深证券交易所上市的可转债、可交债、债券型和货币市场型公开募集证券投资基金、银行存款、银行理财产品;</p> <p>(3) 商品及金融衍生品类: 中国金融期货交易所上市的股指期货、国债期货, 沪深交易所上市的股票期权。</p> <p>(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品:</p> <p>基金公司或基金子公司发行的资产管理产品、在基金业协会登记为私募证券投资基金管理人发行并由具有证券投资基金托管资格的机构托管或由具有相关资质的机构提供私募基金综合服务的私募证券投资基金、集合资金信托计划、证券公司及其子公司资产管理计划、期货公司或期货子公司发行的资产管理计划等金融监管部门批准或备案发行的产品。</p> <p>如法律法规或监管机构规则变动允许本计划投资其他品种的, 经管理人、</p>

	<p>托管人及全体委托人一致同意后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>在符合本合同约定的前提下，投资者授权管理人可将本集合资产管理计划投资由本集合资产管理计划管理人发行的其他资产管理计划。</p>
投资比例	<p>(1) 投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品占计划总值的比例：不低于 80%（含 80%）</p> <p>(2) 经过穿透合并计算，本资产管理计划最终投资于权益类、固收类、商品及金融衍生品类的投资比例为：权益类 0-80%（不含）；固收类：0-80%（不含）；商品及金融衍生品类账户权益不低于计划总资产 20%（含）；商品及金融衍生品类持仓合约价值的比例不低于计划总资产 80%（含）。</p> <p>经穿透核查，本资产管理计划所投资子计划（子基金）不得投资于非标准化债权类、股权类、商品及金融衍生品类资产。本资产管理计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算该资产管理计划所投资资产的金额或比例。投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额。以上投资比例由管理人自行监控。</p> <p>权益类、固定收益类按照该资产的市值占整个资产管理计划总值的比例来计算。</p>
投资策略	<p>研发团队研判市场动态，通过调查研究和投资分析建立公募和私募基金产品池，并进行分类管理，根据公募和私募基金的绩效评估和市场的变化，遴选投资标的，建立投资组合，以期获得长期稳定回报。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本计划是基金中基金资产管理计划，投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品占计划总值的比例不低于 80%（含 80%）。本计划会基于宏观经济发展趋势、政策导向、市场未来的发展趋势以及各大类资产未来的风险收益比等因素，判断权益类、固定收益类、商品及金融衍生品类资产之间的相对吸引力，在一定范围内调整大类资产配置的比例。其中本资管计划投资的银行理财产品仅为固定收益类银行理财产品。</p> <p>2、优选基金策略</p> <p>在确定资产配置基础上，通过定量和定性相结合的方法筛选出各类基金</p>

类别中优秀的基金经理和基金品种进行投资。定量分析考察基金管理人历史业绩的主动管理能力，通过超额收益、风险及收益风险比等因素，加权评估得到综合得分；定性分析考察基金管理人基本情况、投资管理团队、投资策略、内控管理等，加权评估得到综合得分。在定性和定量分析的基础上，形成备选投资库，进行持续跟踪评估，并依此构建投资组合，从而获取长期稳定的超额收益。

3、资产管理计划的决策依据

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投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：

(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；

(2) 国内外经济形势、外汇利率、市场利率变化趋势等的研究；

(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。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，以追求投资者的本金安全为第一要旨，在此基础上为投资者争取较高的收益。

4、资产管理计划的投资程序

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。

(1) 投资分析和研究

管理人资管投资部内设投资研究岗，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，经过评估和风险评判，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。

(2) 制定资产配置策略

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

	<p>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>
<p>投资限制</p>	<p>为维护投资者的合法权益，本资产管理计划的投资限制为：</p> <p>(1) 经穿透合并计算，本计划总资产占净资产的比例不得超过 200%，此项由管理人自行监控；</p> <p>(2) 按市值计，投资于单只公募股票型基金的比例不超过计划资产净值的 25% ；</p> <p>(3) 按市值计，投资于单只资产管理产品的比例不超过计划资产净值的 25%；</p> <p>(4) 经穿透核查，本计划投资于同一资产的资金不得超过计划资产净值的 25%，此项由管理人自行监控；</p> <p>(5) 期货的风险度不得超过 90%，$\text{期货风险度} = \text{期货保证金占用} / \text{期货账户全部权益}$（含保证金占用及可用资金）；</p> <p>(6) 不得投资于结构化资产管理计划的劣后端；</p> <p>(7) 不得直接参与融资交易、债券正回购交易；</p> <p>(8) 本计划不得投资于分级基金；不得投资于权证；</p> <p>(9) 不得投资于投资范围之外的投资品种；</p> <p>(10) 本计划遵循相关法律法规或监管部门对于投资比例限制的规定。</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</p>

	<p>比例的，资产管理人将自超标发生之日起在具备交易条件的 15 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、流动性受限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> <p>本资产管理计划的禁止行为包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、违规将资产管理计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途； 2、将资产管理计划资产用于可能承担无限责任的投资； 3、向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺； 4、挪用资产管理计划资产； 5、向管理人、托管人出资； 6、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营； 7、募集资金超过计划说明书约定的规模； 8、使用资产管理计划资产进行不必要的交易； 9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为； 10、投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形： <ol style="list-style-type: none"> （1）投资项目被列入国家发展改革委最新发布的淘汰类产业目录； （2）投资项目违反国家环境保护政策要求； （3）通过穿透核查，投资标的最终投向上述投资项目； 11、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。 <p>上述禁止行为均是根据本资产管理计划设立时现行有效的《管理办法》及《运作规定》制定的，如未来监管机构取消或修改上述规定，本资产管理计划将按照最新规定取消或修改上述投资限制及禁止行为。</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本资产管理计划属于中高等风险（R4）投资品种。</p>

	适合推广对象	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
	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）监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；</p> <p>（五）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>（六）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，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，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、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；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；</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>
<p>集 合 计 划 的 认 购 / 参 与</p>	<p>办理时间</p>	<p>（1）募集期认购</p> <p>本资产管理计划的具体募集期以管理人的销售公告为准。在募集期内，投资者在工作日内交易时间可以认购本资产管理计划。本资产管理计划初始募集期不超过 60 天。</p> <p>（2）存续期参与</p> <p>本资产管理计划存续期的开放期内可办理投资者参与业务。</p>
	<p>办理程序</p>	<p>1、募集期认购的程序和确认</p> <p>（1）投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在募集期的交易时间段内办理。</p> <p>（2）投资者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，支付认购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)。投资者申请认购时应在该指定账户备足认购的货币资金；若指定账户内认购资金不足，销售机构不受理该笔认购申请。</p> <p>投资者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，由于投资者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，由投资者承担，管理人和托管人不承担责任。投资者办理认购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，以各销售机构的具体规定为准。</p> <p>（3）投资者签署本合同后，方可申请认购资产管理计划。投资者到资产</p>

管理计划销售机构指定营业网点的柜台申请认购资产管理计划。认购申请采取时间优先、金额优先原则进行。申请是否有效以管理人的确认为准。认购申请经确认有效后，构成本合同的有效组成部分。

(4) 投资者于T日提交认购申请后，一般可于T+2日后在办理认购的网点查询认购确认情况。投资者应当及时查询和确认认购申请的相关信息。

确认无效的申请，销售机构将退还投资者已交付的认购款项本金，就该投资者而言，集合资产管理合同自始无效。

(5) 投资者认购申请成功后，其认购申请和认购资金不得撤销。

(6) 认购份额= (认购金额+募集期内产生的利息) / 计划单位面值

(7) 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。

2、存续期参与的程序和确认

(1) 投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在开放日的交易时间段内办理。

(2) 投资者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)。投资者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。

投资者承诺在本集合资产管理合同有效期内，不得撤消指定账户，并妥善保管账户资料，由于投资者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，由投资者承担，管理人和托管人不承担责任。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。

(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。参与申请经确认有效后，构成本合同的有效组成部分。

(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。投资者应当及时查询和确认参与申请的相关信息。

		<p>确认无效的申请，销售机构将退还投资者已交付的参与款项本金，就该投资者而言，集合资产管理合同自始无效。</p> <p>(5) 投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销。</p>
	参与费	本产品不收取参与费。
	认购资金利息	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。
集合计划的退出	办理时间	投资者在开放期根据本合同约定的及管理人的公告条件退出本资产管理计划。在满足资产管理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。
	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) “预约退出”原则，即对于开放期内退出本集合计划份额的，投资者需提前至少15个工作日(T-15日)向管理人提出预约退出申请，然后在开放期内(T日)正式提出退出申请。管理人有权拒绝投资者未经预约的退出申请。</p> <p>(4) “先进先出”原则，即对同一投资者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>(5) 投资者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>对于开放期(T日)内退出本集合计划份额的，投资者必须根据本资产管理计划管理人或销售机构规定的手续，需提前至少15个工作日(T-15日)直接或通过销售机构向管理人书面提出预约退出申请，在开放期的业务办理时间向管理人或销售机构提出正式退出申请，申请退出份额数量超过投资者持</p>

	<p>有份额数量时，超出部分申请无效。</p> <p>(2) 退出申请的确认</p> <p>投资者于 T 日提交正式退出申请后，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>投资者的退出申请确认后，退出款项将在 T+5 日内从托管账户划出。</p>
退出费	<p>退出时持有期不足 350 天（含），退出费率为 1%；退出时持有期超过 350 天，退出费为 0。退出费归本计划资管计划资产所有。</p>
大额退出、巨额退出	<p>1、单个投资者大额退出的认定、申请和处理方式</p> <p>(1) 单个投资者大额退出的认定</p> <p>单个投资者单日退出份额超过上一日资产管理计划总份额 5%，即视为单个投资者大额退出。</p> <p>(2) 单个投资者大额退出的申请和处理方式</p> <p>投资者必须提前 20 个工作日直接或通过销售机构向管理人书面提出预约退出申请，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>单个开放期内，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投资者的退出申请时，按正常退出程序执行。</p> <p>部分延期退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者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。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申</p>

		<p>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开放日办理。转入下一个开放日的退出申请不享有优先权并以该开放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。投资者在申请退出时可选择当日未受理部分予以撤销，未进行选择的默认顺延。</p> <p>(3) 连续巨额退出</p> <p>连续巨额退出的认定：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>连续巨额退出的处理方式：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投资者的退出申请：</p> <p>(1) 不可抗力的原因导致资产管理计划无法正常运转；</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) 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投资者利益时；</p> <p>(4) 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>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>管理人可以自有资金认购/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个工作日告知投资者和托管人，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：</p> <p>管理人自有资金份额与其他投资者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：</p> <p>(1) 管理人自有资金份额的持有期限不少于 6 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，可以与其他投资者同样办理退出业务。</p> <p>(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期退出完成调整。</p> <p>(3) 管理人自有资金退出应告知投资者和托管人，告知方式为管理人指定披露网站公告。</p> <p>(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投资者享有相同权利。</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>资产管理计划成立的条件、时间</p>	<p>本资产管理计划的参与资金总额（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，投资者的参与资金只能存入注册登记机构指定的募集账户，不得动用。</p>
<p>资产管理计划设立失败（本金及利息返还方式）</p>	<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投资者已缴纳的款项，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>

		2、投资者的人数少于2人。
资产管理计划份额转让		资产管理计划存续期间，本资产管理计划不提供产品转让功能。
费用、报酬	费用种类 (计提标准、方法、支付方式)	<p>(一) 托管费</p> <p>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。</p> <p>托管费每日计提，每月支付一次，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在每月的第3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。</p> <p>(二) 管理费</p> <p>本资管计划投资于本资管计划管理人管理的其他资管计划的部分不收取管理费。本资管计划管理费按前一日资管计划资产净值扣除前一日所持有本资管计划管理人管理的其他资管计划公允价值后的余额(若为负数，则取0)的1.2%/年费率计提。每日管理费计算方法如下： $T = E \times 1.2\% \div 365$; T为每日管理费； E为前一日的资管计划资产净值扣除前一日所持有本资管计划管理人管理的其他资管计划公允价值后的余额，若为负数，则E取0。</p> <p>管理费每日计提，每月支付一次，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在每月的第3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。</p> <p>管理人收款账户信息： 户名： 申港证券股份有限公司</p>

账号： 1001309919024211005

开户银行： 中国工商银行股份有限公司上海自贸试验区分行

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。

(三) 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。

(四) 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。

(五) 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。

(六) 业绩报酬

1、业绩报酬提取原则

(1) 在两种情况下本计划将计提业绩报酬: ①是投资者申请退出或本资产管理计划期满清算或结算或收益分配时,仅对退出或清算或参与收益分配的份额提取自上一个业绩报酬计提日(若该份额没有计提过业绩报酬,则为认购/参与日)至投资者申请退出日或清算日或收益分配日期间的业绩报酬,

②是在固定时点对所有资管计划份额提取；固定时点提取是以产品成立日每满6个月的对应日（遇节假日则顺延至下一工作日）为业绩报酬计提日。

(2) 按份额持有人每笔参与份额分别计提业绩报酬；

(3) 在①情况下提取的业绩报酬，业绩报酬从投资者退出或清算金额中扣除或从投资者收益分配金额中扣除；在②情况下提取的业绩报酬，以扣减份额持有人份额的方式提取，管理人于业绩报酬计提日计算每一份额持有人每笔参与份额对应业绩报酬，以业绩报酬计提日计划份额净值为基数，折算得到需调减的委托人份额；

(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；分红款少于提取业绩报酬时，则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时，当分红款少于业绩报酬，管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。

(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，若发生产品分红导致提取业绩报酬的，则对应6个月内应于固定时点提取的业绩报酬不再提取。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，管理人计算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，销售期参与的为资产管理计划成立日，存续期参与的为参与日下一个工作日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，若年化收益率小于或等于6%，则管理人提取业绩报酬；若年化收益率大于6%，则管理人对超出部分按20%的比例累进提取业绩报酬。

年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1^* - P_0^*}{P_0^* \times D}$$

R 为年化收益率； P_1^* 为业绩报酬计提日的单位累计净值； P_0^* 为上一业绩报酬计提日的单位累计净值； P_0 为上一报酬计提日的单位净值； D 为上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限。当该份额没有计提过业绩报酬时，若为募集期参与的，则 P_0^* 为产品成立日单位累计净值， P_0 为产品成立日单位净值；若为开放期参与的，则 P_0^* 为参与申请日单位累计净值， P_0 为参与申请日单位净值。

在业绩报酬固定提取时点提取业绩报酬的，业绩报酬以扣减计划份额持有人份额的方式提取；赎回和合同终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金中扣除；收益分配时计提业绩报酬，业绩报酬从投资者收益分配金额中扣除。

(1) 单个计划份额持有人单笔投资计划份额在固定时点提取业绩报酬的计算公式如下：

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (PF _{i,j})
$R \leq 6\%$	0	0
$R > 6\%$	20%	$PF_{i,j} = [(R - 6\%) \times 20\%] \times A_{i,j} \times D_{i,j} / 360$

$$\Delta S_{i,j} = \frac{PF_{i,j}}{NAV}$$

(2) 单个计划份额持有人单笔投资计划份额在赎回时和合同终止时以及收益分配时提取业绩报酬的计算公式如下：

管理人业绩报酬计提公式如下：

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (PF _{i,j})
R ≤ 6%	0	0
R > 6%	20%	$PF_{i,j} = [(R - 6\%) \times 20\%] \times A_{i,j} \times D_{i,j} / 360$

其中：

$D_{i,j}$ ：第 i 个计划份额持有人第 j 笔投资自认购/申购之日（认购日为计划成立日、参与日为参与所对应开放日）至本计提日的存续自然天数。若第 i 个计划份额持有人第 j 笔投资发生过业绩报酬计提的，则为上一个发生业绩保持计提的业绩报酬计提之日至本计提日的存续自然天数；

$PF_{i,j}$ ：本计提日第 i 个计划份额持有人第 j 笔投资的业绩报酬；

NAV：本计提日计划份额净值。

$\Delta S_{i,j}$ ：固定时点提取业绩报酬时，第 i 个计划份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬对应的应调减份额；

$A_{i,j}$ 为第 i 个计划份额持有人第 j 笔投资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；

如果 $PF_{i,j}$ 计算结果为负或者为零,则该计提日第*i*个计划份额持有人第*j*笔投资提取的业绩报酬为零,计划管理人就该笔投资不提取业绩报酬。

某计提日管理人计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个计划份额持有人各笔投资业绩报酬之和,但对于被冻结(人民法院、人民检察院、公安机关及其他国家有权机构依法要求冻结)的份额则不计提业绩报酬。某计提日单个计划份额持有人计提的业绩报酬总额为该计划份额持有人持有的各笔投资业绩报酬之和。

注:单个计划份额持有人单笔投资业绩报酬保留到小数点后2位,小数点后第3位四舍五入。

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。若因资管计划中现金资产余额不足以支付业绩报酬或遇法定节假日、休息日及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。

(七) 资产管理计划的税收

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,且无需事先征得投资者的同意(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):管理人在向投资者交付利益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的,投资者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;投资者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,管理人有权向投资者追索垫付的税费和孳息款项,投资者应按管理人通知向管理人指定账户返还垫付款。投资者已知悉并同意,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。

收益分配	收益构成	本资产管理计划收益指资产管理计划利息收入、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	<p>1、同一类份额享有同等分配权；</p> <p>2、本计划收益分配方式为现金分红；</p> <p>3、在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，管理人有权进行收益分配；</p> <p>4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担；</p> <p>5、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，管理人、托管人协商一致，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	分配方式为现金分红
资产管理合同的变更、终止与财产清算	<p>一、资产管理合同的变更</p> <p>（一）以下情况可由管理人和基金托管人协商后修改：</p> <p>（1）调低管理费、托管费、业绩报酬等费用；</p> <p>（2）法律法规要求增加的资管计划费用的收取；</p> <p>（3）因相应的法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定、要求发生变动而必须对资产管理合同进行修改。</p> <p>管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并在管理人官网上进行公示，披露合同变更的具体内容。投资者不同意变更的，应在公告后的 2 个工作日内以书面方式告知管理人。投资者未在前述时间回复意见的视为投资者同意合同变更。投资者不同意变更的，管理人应对不同意变更的投资者退出事宜作出公平、合理安排。</p> <p>以上合同变更公告满 5 个工作日后生效。投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致并公告期满后变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。</p> <p>（二）因其他原因需要变更资产管理合同的，可通过签署补充协议等方式进行合同变更。委托人不同意变更的，管理人应对不同意变更的委托人退出事宜作出公平、合理安排。资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意。</p>	

资产管理合同发生变更的，管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向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。

（三）当发生“（1）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，资产管理计划由其他管理人承接；（2）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，资产管理计划由其他托管人承接”情形时，管理人和托管人的更换程序如下：

1、管理人的更换程序

（1）公告：管理人更换后，由托管人在中国证监会批准后5个工作日内公告。

（2）交接：原管理人应作出处理资管计划事务的报告，并向新任管理人办理资管计划事务的移交手续；新任管理人应与托管人核对资管计划资产总值和净值。

（3）资管计划名称变更及合同修改：管理人更换后，应按其要求替换或删除资管计划名称中原公司的字样，并对合同进行变更。

2、托管人的更换程序

（1）公告：托管人更换后，由管理人在中国证监会和中国人民银行批准后5个工作日内公告。

（2）交接：原托管人应作出处理资管计划事务的报告，并与新任托管人进行资管计划资产移交手续；新任托管人与资管计划管理人核对资管计划资产总值和净值。

（四）合同变更后，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

（五）投资者、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证资产管理计划资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。

（六）管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利。在合同变更基于投资者利益考虑的情形，设置临时开放日，临时开放日投资者只能申请退出，不能参与，临时开放日的具体安排以管理人公告为准。

二、资产管理计划的展期

本资产管理计划管理期限为9年。

（一）展期的条件

1、在存续期间，本资产管理计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定、本合同、《说明书》的约定；

2、展期没有损害投资者利益的情形；

3、中国证监会规定的其他条件。

本集合资产管理计划展期的，还应当符合本集合资产管理计划的成立条件。

（二）展期的程序与期限

1、展期的程序：本资产管理计划拟展期的，管理人应当在指定网站上公告展期相关事项，并同时公告资产管理计划的具体展期方案。

2、展期的期限：管理人应将展期的期限以公告形式通知投资者。

（三）展期的安排

1、通知展期的时间及方式

管理人与托管人协商一致后在管理人网站进行公告，对资产管理计划展期事宜进行说明。

2、投资者参与展期

管理人将通过公告对投资者回复的方式做出安排，并通知投资者如不同意参与资产管理计划展期，应在公告规定期限内按照管理人公告规定的形式作出答复；未在规定时间内作出答复的，视为同意本资产管理计划展期。

（四）投资者不同意展期的处理办法

不同意展期的投资者，可以在原存续期届满前的开放期或资产管理人设定的展期临时开放期内通过销售机构办理退出手续，具体办理要求和相关事项以管理人公告为准。未在原存续期届满前的开放期或资产管理人设定的展期临时开放期内办理退出手续的，视为同意展期。

（五）展期的实现

1、如果展期后的集合资产管理合同、计划说明书与原集合资产管理合同、计划说明书有变更之处，管理人将在其指定网站上对新的集合资产管理合同、

计划说明书进行公告，并在 5 个工作日内将变更情况报中国证券投资基金业协会或其他机构备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

2、若同意本资产管理计划展期的投资者的人数不少于 2 人，且原存续期届满日符合展期条件的，本资产管理计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本资产管理计划不能展期。

3、若本资产管理计划在原存续期届满日有未能流通变现的资产，同意展期的投资者需同意继续持有该未能流通变现的资产，且同意展期的投资者持有的资产管理计划资产净值不得低于本资产管理计划未能流通变现资产规模。

4、本资产管理计划可以连续展期，且展期次数不限。

5、管理人应在展期后 5 个工作日内将展期情况报中国证券投资基金业协会或其他机构备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

三、资产管理计划的终止

资产管理计划终止的情形，包括但不限于下列事项：

- （一）资产管理计划存续期届满且不展期；
- （二）经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；
- （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；
- （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；
- （五）持续五个工作日投资者少于 2 人的；
- （六）未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- （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。

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，前述第（六）项约定的情形除外。

四、资产管理计划的清算

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投资者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投资者，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投资者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投资者，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：

（1）支付清算费用；

（2）交纳所欠税款；

（3）清偿计划债务；

（4）按照合同约定支付管理费、托管费；

	<p>(5) 按照合同约定以管理人参与本计划的自有资金对投资者进行有限补偿（如有）；</p> <p>(6) 将资产管理计划资产按投资者持有资产管理计划份额的比例和合同的约定分配给投资者。</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投资者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投资者。</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。</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>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：每周第二个工作日披露前一个工作日资产管理计划单位净值。若该周仅有一个工作日，即于该工作日披露上周最后一个工作日的净值数据。</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> <p>2、资产管理计划的资产管理季度报告和托管季度报告</p>

管理人每季度向投资者提供一次准确、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。托管人在每季度向投资者提供一次季度托管报告。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（托管人提供）；
- (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) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 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；
- (7) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (8) 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；
- (9) 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或者存续期间不足三个月的，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

管理人每年度向投资者提供一次准确、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。托管人在每年度向投资者提供一次托管报告。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（托管人提供）；

(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, 通过管理人网站向投资者提供, 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

管理人根据投资者的申请要求, 向投资者提供季度对账单。对账单内容应包括投资者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。

投资者应向管理人提供邮寄地址等资料, 因投资者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投资者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、投资者承诺可通过电话、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、投资者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，同时视为投资者对管理人欲通知的内容已全部知悉理解：

（1）以电话方式通知的，以通话当时视为已通知送达；

（2）以传真方式通知的，以传真发出即视为已通知送达；

	<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、投资者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，如因投资者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投资者自行承担。</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>



