

## 华西证券东风3号集合资产管理计划说明书

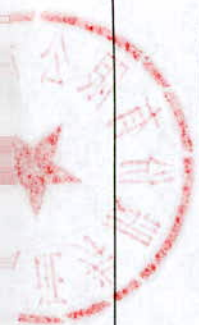
### 特别提示:

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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第151号，下称《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》（证监会公告【2018】31号）等法律、行政法规、中国证监会等国务院金融监管机构及中国证券投资基金业协会的有关规定，以及《华西证券东风3号集合资产管理计划资产管理合同》拟定，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《资产管理合同》、《风险揭示书》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计划资产，但不保证计划一定盈利，也不保证最低收益。本说明书对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《资产管理合同》、《风险揭示书》且合同生效后，投资者即为《资产管理合同》的委托人，其参与本计划的行为本身即表明其对《资产管理合同》、《风险揭示书》及本说明书的承认和接受。委托人将按照《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	华西证券东风3号集合资产管理计划
	类型	固定收益型集合资产管理计划
	目标规模	本集合计划不设规模上限，单个客户首次参与金额不低于30万元。本集合计划委托人数量为2人以上(含)200人以下(含)。 管理人有权根据实际情况调整初始募集期的目标规模，并由管理人在管理人指定网站公告。
	管理期限	本集合计划设固定存续期为10年，出现集合资产管理合同约定的终止情形时，终止清算，期满可展期
	推广期	本集合计划推广期指管理人公告的集合计划接受委托人参与日至推广期结束日。本集合计划推广期最长不超过60个自然日。
	开放期	1、封闭期：除开放期以外的期间为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。 2、开放期：本集合计划自成立之日起满6个计划月度后的对应日及下一工作日为首个开放期，之后每满3个计划月度的对应日及下一工作日为后续开放期，委托人退出仅可在每个开放期首个开放日办理，若开放期遇法定节假日、休市日等则自动顺延，具体以管理人公告为准。 本集合计划合同变更时，管理人将公告临时开放期，委托人可在合同变更临时开放期退出集合计划。
	份额面值	人民币1.00元。
	最低募集金额	集合计划的最低初始募集规模为人民币1000万元。
	相关费率	1、认购费/参与费:0% 2、托管费:0.02%/年 3、管理费:0.30%/年 4、退出费:份额持有期不足360天，退出费率0.3%；持有期超过360天(含)，不收取退出费。 赎回费计入基金资产。 5、业绩报酬:参见管理合同集合计划的费用、业绩报酬部分 6、其他费用:参见管理合同集合计划的费用、业绩报酬部分
	投资范围及投资比例	1、投资范围 (1) 固定收益类资产，包括国内依法发行的国债、地方政府债、金融债(含次级债、混合资本债)、央行票据、公司债(含交易所非公开发行公司债)、企业债、可转换债券、可交换债券、银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具(如短期融资券、中期票据、集合票据、非公开定向债务融资工具)、资产支持证券优先级、永续债、债券逆回购、投资范围不超过上述品种的债券型公募基金以及法律法规或中国证监会认可的其他固定收益类投资品种等； (2) 现金类资产，包括现金、银行存款(包括活期存款和定期存款、协议存款)、同业存单、货



		<p>币市场基金、期限在1年内(含1年)的国债、期限在1年内(含1年)的央行票据、期限在1年内(含1年)的政府债券;</p> <p>(3) 本集合计划可投资于国债期货;</p> <p>(4) 本集合计划可参与债券正回购业务;</p> <p>(5) 本集合计划不直接从二级市场买入股票,但可以持有因可交换债券、可转换债券转股所形成的股票。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>除产品成立后6个月的建仓期、产品终止前30个工作日清算准备期之外,其它运作时间内管理合同项下委托财产所投资的投资组合将遵循以下比例和限制:</p> <p>(1) 集合计划投资于存款、债券等债权类资产(包括上述投资范围中固定收益类及现金类资产)不低于集合计划资产总值的80%;集合计划参与证券回购融入资金余额不得超过集合计划上一日资产净值的100%;债券逆回购资金余额不得超过集合计划上一日资产净值的100%;集合计划的总资产不得超过集合计划净资产的200%;</p> <p>(2) 集合资产管理计划开放退出期内,其资产组合中七个工作日可变现资产的价值,不低于该计划资产净值的10%;</p> <p>(3) 集合计划投资于债券的主体及债项评级必须为AA(含)以上(银行间短期融资券债项评级不得低于A-1),如无债项评级,以主体评级为准;</p> <p>(4) 集合计划投资于单只债券的投资额(以成本计)不得超过集合计划资产净值的25%,且不得超过其债券发行总量的25%;</p> <p>(5) 本集合计划不得投资于以非正当事由将资管产品或其受益权作为底层资产的资产支持证券。</p> <p>(6) 集合计划投资于可交换债、可转换债比例合计不超过资产净值的20%;不得从二级市场购买股票,如果因可交换债券、可转换债券转股持有股票,应在其可交易之日起的15个交易日内卖出。</p> <p>(7) 集合计划投资于以固定收益品种为投向的债券型公募基金品种合计不超过集合资产管理计划净值的30%。</p> <p>(8) 集合计划投资于国债期货,持仓合约价值的比例低于资产管理计划总资产80%,且保证金应低于资产管理计划总资产20%;</p> <p>(9) 集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过集合计划资产净值的20%。</p> <p>(10) 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非因管理人主观因素导致突破上述投资比例限制的,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>
	风险收益特征及适合推广对象	本集合资产管理计划的风险等级为中等风险【R3】,适合风险承受能力等级匹配且法律法规及监管规定允许投资的个人投资者、机构投资者,及监管机构允许投资本集合计划的其他投资者。
当 事 人	管理人	华西证券股份有限公司
	托管人	宁波银行股份有限公司
	推广机构	华西证券股份有限公司、上海天天基金销售有限公司及其他符合条件的销售机构。
集 合 计 划 的	办理时间	<p>集合计划投资者可在本集合计划开放日根据管理合同相关约定申购和/或赎回本集合计划,但集合计划管理人根据法律法规、中国证监会的要求或管理合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。</p> <p>本集合计划自成立之日起满6个计划月度后的对应日及下一工作日为首个开放期,之后每满3个计划月度的对应日及下一工作日为后续开放期,委托人退出仅可在每个开放期首个开放日办理,若开</p>

参与、退出	<p>放期遇法定节假日、休市日等则自动顺延，具体以管理人公告为准。</p> <p>(1) 参与的程序及确认</p> <p>①投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理；</p> <p>②投资者应开设销售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，销售机构不受理该笔参与申请；</p> <p>③投资者签署管理合同后，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>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；</p> <p>⑤投资者于T日提交参与申请后，管理人按照“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对参与总规模和人数实行限量控制。投资者可于T+2日后在办理参与的网点查询参与确认情况。</p> <p>(2) 退出的程序及确认</p> <p>①退出申请的提出</p> <p>集合计划委托人必须根据集合计划销售机构规定的手续，向集合计划销售机构提出参与或退出的申请。</p> <p>②退出申请的确认和款项划付</p> <p>委托人可在T+2日（包括该日）之后到销售机构取得T日退出申请成交确认单。</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，T+7个工作日之内到账。</p>
参与、退出费用及金额计算	<p>1、参与费用</p> <p>本集合计划无参与费</p> <p>2、退出费用</p> <p>份额持有期不足360天，退出费率0.3%；持有期超过360天（含），不收取退出费。退出费计入计划资产。</p> <p>参与份额与退出金额的计算方式：</p> <p>1、参与份额计算</p> <p>参与份额=参与金额÷参与日计划单位净值</p> <p>集合计划募集期认购单位净值为集合计划面值，集合计划份额面值为1.00元。委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。</p> <p>2、退出金额计算</p> <p>委托人在开放日退出本计划，管理人根据计划单位净值计算其退出金额。</p> <p>退出金额=委托人申请退出份额×退出日份额单位净值（如为份额折算日，则为折算前份额单位净值）-管理人业绩报酬（如有）-退出费用（如有）</p> <p>退出金额采用四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的误差计入集合计划资产。</p>
拒绝或暂停退出的情形及处理	<p>1、暂停参与的情形</p> <p>如出现如下情形，集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划委托人的参与申请：</p> <p>(1) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常工作；</p> <p>(2) 管理人认为本集合计划出现或可能出现超额募集情况；</p> <p>(3) 证券交易场所所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的集合计划资产净值；</p> <p>(4) 管理人认为集合计划资产规模过大，可能对集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有集合计划委托人的利益；</p> <p>(5) 集合计划管理人、集合计划托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；</p> <p>(6) 销售机构对委托人资金来源表示疑虑，委托人不能提供充分证明的；</p> <p>(7) 集合计划管理人认为会有损于现有集合计划委托人利益；</p> <p>(8) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形；</p>

		<p>发生上述(1)到(5)项情形时,集合计划管理人应当通过管理人网站报告委托人。</p> <p>2、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) 不可抗力导致集合计划无法正常运作;</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) 因市场剧烈波动或者其他原因,导致本集合计划的现金出现困难时,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。</p>
	<b>管理人自有资金参与集合计划</b>	管理人不以自有资金参与本集合计划。
	<b>集合计划的分级</b>	本集合资产管理计划不分级。
	<b>集合计划成立的条件、时间</b>	<p>1、集合计划成立条件:初始募集规模不低于1000万元,投资者人数不少于2人,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>2、验资与成立:集合计划的募集金额缴足之日起10个工作日内,管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告,并在取得验资报告后公告集合计划成立。</p>
	<b>集合计划设立失败(本金及利息返还方式)</b>	本集合计划推广期结算后未达到成立条件,由管理人公告宣布募集失败,由管理人承担因募集行为而产生的债务和费用,并将已认购资金及推广期利息在推广期结束后30日内退还集合计划委托人。利息金额以本集合计划注册与过户登记人的记录为准。
	<b>集合计划开始运作的条件和日期</b>	<p>1、条件:集合计划管理人公告成立。</p> <p>2、日期:公告成立之日起,管理人可按合同约定开始运作。</p>
<b>集合计划的投资</b>	<b>投资理念与投资策略</b>	<p>(一) 投资目标</p> <p>本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资,在有效控制投资风险的基础上,力争获取稳健的投资回报。</p> <p>(二) 投资策略</p> <p>(1) 债券投资策略</p> <p>1) 利率预期策略</p> <p>管理人通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断,形成对未来市场利率变动方向的预期,主动地调整债券投资组合的久期,提高债券投资组合的收益水平。</p> <p>2) 收益率曲线策略</p> <p>管理人通过对债券市场微观因素的分析判断,形成对未来收益率曲线形状变化的预期,获取收益率曲线形变带来的投资收益。</p> <p>3) 信用策略</p> <p>信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响,因此,一方面,本集合计划将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势;另一方面,采用内外结合的信用研究和评级制度,研究债券发行主体企业的基本面,以确定企业主体债的实际信用状况。</p> <p>4) 个券优选策略</p> <p>管理人根据债券市场收益率数据,对单个债券进行估值分析,并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。</p> <p>(2) 新券申购策略</p> <p>对于新发行的证券品种,管理人将凭借丰富的资产管理经验以及新券定价能力,可在询价与配售过程中把握主动、发挥优势,追求可控风险之下的收益最大化。</p>

		<p>(3) 基金投资策略</p> <p>本集合计划坚持从研究基金价值入手,采用定性分析与定量分析相结合的方法,选择管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金构建备选基金池,对基金的投资理念和投资价值进行判断。</p>
	<p><b>投资决策</b></p>	<p>1、决策依据</p> <p>集合计划以国家有关法律、法规和管理合同的有关规定为决策依据,并以维护集合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》、《管理规定》、《指导意见》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关规范性文件;</p> <p>(2) 根据宏观、微观经济环境和有关经济政策以及证券市场趋势制定投资策略;</p> <p>(3) 在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策,是本集合计划维护投资者利益的重要保障。在衡量投资收益与风险之间的配比关系时,力争保护投资者的本金安全,在控制风险的前提下追求收益的最大化。</p> <p>2、投资决策程序</p> <p>(1) 投资经理根据研究报告,结合对市场的判断,在证券投资库的范围内合理构建投资组合,决定具体的投资品种及买卖时机;结合投资组合的风险与绩效评估结果,对投资组合进行监控和调整,使之不断得到优化。</p> <p>(2) 交易人员依据投资经理指令,负责及时、准确、高效地完成各类证券交易指令。对于投资经理下达的交易指令,交易员应审核交易指令是否符合风险监控规定,符合规定的才予以执行。</p> <p>(3) 管理人风控岗对投资计划的过程进行日常监督和风险控制,投资经理根据本集合资产管理计划退出的情况控制投资组合的流动性。</p> <p>(4) 管理人在确保本集合资产管理计划委托人利益的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资决策程序做出调整。</p>
<p><b>费用、业绩报酬</b></p>	<p>集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p>	<p>1、托管人托管费计提和支付:</p> <p>本集合计划托管费按前一自然日集合计划资产净值的 0.02%年费率计提,计算方法如下:</p> $H=E \times 0.02\% \div 365$ <p>H 为每日应支付的托管费;</p> <p>E 为前一自然日集合计划资产净值。</p> <p>集合计划托管费每日计提,逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次。经管理人与托管人双方核对无误后,由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的投资指令将上一季度计提的托管费从集合计划资产中一次性支付给托管人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。</p> <p>2、管理人管理费计提和支付:</p> <p>本集合计划的管理费按前一自然日集合计划资产净值的 0.30%年费率计提。计算方法如下:</p> $H=E \times 0.30\% \div 365$ <p>H 为每日应计提的集合计划管理费</p> <p>E 为前一自然日集合计划资产净值</p> <p>管理人的管理费每日计提,逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次,经管理人与托管人双方核对无误后,由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的投资指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。</p> <p>3、业绩报酬的计提和支付</p> <p>管理人收取业绩报酬的原则:</p> <p>本计划设置产品业绩报酬计提基准 <math>R_i</math> (年化收益率),管理人有权根据市场情况在开放期前调整开放期后本集合计划适用的业绩报酬基准 <math>R_i</math> 及其适用期间,具体以管理人推广公告和各开放期前管理人公告为准。</p>

(1) 份额折算

在本集合计划每一期业绩报酬计提基准适用期间最后一日日终，管理人对集合计划进行份额折算。份额折算后集合计划单位净值调整为 1.0000 元，本集合计划的份额总额与委托人持有的份额数将发生调整，但调整后的委托人持有的份额占集合计划份额总额的比例不发生变化。份额折算对委托人的权益无实质性影响。份额折算后，委托人将按照折算后持有的份额享有权利并承担义务。

折算日日终，集合计划份额单位净值调整为 1.0000 元，折算后，集合计划委托人持有的份额数按照折算比例相应增加或减少(收益可能为正也可能为负即发生亏损)。如折算前单位净值大于 1.0000 元，折算并扣减管理人业绩报酬(如满足业绩报酬计提条件)后新增份额为委托人当期实际获得投资收益。

(2) 管理人收取业绩报酬的原则：

1) 在集合计划份额折算日、份额退出日和集合计划清算期份额清算退出日(统称“业绩报酬计提日”)对符合业绩报酬计提条件的份额计提业绩报酬，业绩报酬计提比例为份额年化收益率超过该业绩报酬计提基准的 50%；

①在集合计划份额折算日计提业绩报酬的，委托人折算后份额将因此减少，管理人自行决定何时提取已计提的业绩报酬；

②在份额退出日和清算期份额清算退出日提取业绩报酬的，业绩报酬从委托人退出资金中扣除，委托人收到的退出资金将减少；

2) 委托人申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额持有期间，计算、计提或提取退出份额对应的业绩报酬。

3) 每个份额折算日管理人核算上一份额折算日(不含当日，如无上一份额折算日则为集合计划成立日)至当前份额折算日(含当日)期间集合计划投资收益和应付管理人业绩报酬，不跨期累计核算。管理人计提业绩报酬后，集合计划发生亏损或未达业绩比较基准时，管理人已计提或提取业绩报酬不用于补偿投资者。

4) 本集合计划业绩报酬提取频率不得超过 6 个月一次，因委托人退出资产管理计划或监管要求调整，管理人按照合同的约定提取业绩报酬，不受此提取频率的限制，在 6 个月内可以提取多次。

(3) 业绩报酬计算公式

$$\text{期间年化收益率 } R_t = [(P_1 - P_0) / P_0] \times (365 \div T_i)$$

$P_1$ =本次业绩报酬计提日的集合计划份额单位净值(如为份额折算日，则为份额折算前扣除业绩报酬前的单位净值)

$P_0$ =份额参与日集合计划份额单位净值

委托人份额为业绩报酬计提基准  $R_i$  持续计提期间开放参与的， $P_0$  为份额参与日单位净值；委托人份额为前一业绩报酬计提基准  $R_{i-1}$  适用期间已有份额及折算后新增份额自动参与下一期的， $P_0$  为特指折算后集合计划份额净值(即 1.0000 元)。

$T_i$ =份额参与日  $i$  日(不含当日)到本次业绩报酬计提日(含当日)的天数

委托人份额为业绩报酬计提基准  $R_i$  持续计提期间开放参与的，份额参与日为委托人实际参与日；委托人份额为前一业绩报酬计提基准  $R_{i-1}$  适用期间已有份额及折算后新增份额的，该部分份额的参与日特指业绩报酬计提基准  $R_i$  持续计提期间的期初时点。

其中，首个业绩报酬计提期间： $P_0=1.0000$ ， $T$ =集合计划成立日(不含当日)到首个业绩报酬计提日(含当日)的天数

在本计划份额折算、份额退出及清算期份额清算退出时，若委托人持有份额实际年化收益率  $R_t$  低于或等于业绩报酬计提基准  $R_i$ ，即：

$R_t \leq R_i$  时，管理人不收取业绩报酬；

若当期实际年化收益率  $R_t$  大于业绩报酬计提基准  $R_i$ ，即：

$R_t > R_i$  时，则管理人对委托人期间年化收益超过  $R_i$  部分按照 50%比例收取业绩报酬。即

期间年化收益率(Rt)	计提比例	业绩报酬 (E) 的计提公式
$R_t \leq R_i$	0	$E=0$
$R_t > R_i$	50%	$E = \sum [N_i \times P_0 \times (R_t - R_i) \times 50\% \times T_i / 365]$

注：

1) 在份额折算日计提业绩报酬的：

E 为管理人应计提的业绩报酬；

$N_i$  为业绩报酬基准  $R_i$  适用期间的任意参与日  $i$  日参与的满足业绩报酬计提条件的份额数；

$T_i$  为份额参与日  $i$  日（不含当日）到本次业绩报酬计提日（含当日）的天数。

2) 在份额退出日、清算期份额清算退出日对委托人退出份额计提业绩报酬的：

E 为管理人应收取的申请退出的委托人退出份额对应的业绩报酬；

$N_i$  为委托人退出的份额数；

$T_i$  为份额参与日  $i$  日（不含当日）到本次业绩报酬计提日（含当日）的天数。

存续期管理人可以根据集合计划实际运作情况，提取已计提并累计的业绩报酬，在提取业绩报酬时，由管理人向托管人发送业绩报酬提取指令，托管人收到指令后从本集合计划资产中将业绩报酬支付给管理人；委托人赎回或计划清算退出份额时，从退出资金中直接提取业绩报酬。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

在集合计划份额折算日、份额退出日和集合计划清算期份额清算退出日计提业绩报酬的，业绩报酬的计算以管理人提供的数据为准，托管人不承担复核责任。

如果法律法规后续对管理人收取的业绩报酬比例有最高上限要求时，管理人将按照合同变更约定程序进行向下调整，无须另行征求委托人的意见。

不由集合计划承担的费用

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与销售有关的费用，不得在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。

收益分配

收益分配

本集合计划不进行收益分配，委托人赎回份额即取得相应投资本金及收益（如有）。

终止和清算

一、有下列情形之一的，集合计划应当终止：

- 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、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；
- 4、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；
- 5、管理人认为必要时可终止本计划；
- 6、集合资产管理计划存续期间，持续五个工作日投资者少于二人；
- 7、不可抗力发生导致本集合计划不能存续；
- 8、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- 9、法律、行政法规、管理合同及中国证监会规定的其他终止情形。

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 9 项约定的情形除外。

二、集合计划的清算

自集合计划终止之日起 5 个工作日内由管理人发起组织清算资产管理计划资产，以及财产清算的有关事项：

	<p>1、成立集合计划清算小组</p> <p>(1) 集合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。</p> <p>(2) 集合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。</p> <p>清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</p> <p>2、集合计划清算程序</p> <p>(1) 集合资产管理计划终止日后5个工作日内启动清算程序，并由集合计划清算小组将终止事项向委托人披露；</p> <p>(2) 集合计划清算小组统一接管集合计划资产；</p> <p>(3) 集合计划清算小组对集合计划资产进行清理和确认；</p> <p>(4) 集合计划清算小组对集合计划资产进行估价；</p> <p>(5) 集合计划清算小组对集合计划资产进行变现；</p> <p>(6) 集合计划清算小组出具集合计划清算报告</p> <p>(7) 集合计划清算小组披露集合计划清算报告；</p> <p>(8) 清算报告披露后5个工作日内进行集合计划剩余资产的分配；</p> <p>(9) 集合计划清算小组注销集合计划相关账户。</p> <p>3、清算费用</p> <p>清算费用是指集合计划财产清算小组在进行清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。</p> <p>4、集合计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按集合计划份额持有人持有的集合计划份额比例进行分配。</p> <p>5、集合计划延期清算处理方式</p> <p>资产管理计划因委托财产流动性受限等原因可延期清算，管理人应当及时向投资者披露延期清算情况，并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>6、集合计划财产清算报告的告知安排；</p> <p>清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告。</p> <p>7、集合计划财产相关账户的注销</p> <p>集合计划财产清算完毕后，集合计划托管人及集合计划管理人应按照交易所、银行的有关规定注销托管资金专门账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。</p> <p>8、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>9、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管理合同的约定，以货币形式全部分配给委托人。</p>
<p><b>特别说明</b></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>



0282501015

