

华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划说明书

二零一九年十一月

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》)、《华安证券安赢套利 1 号周开债券型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	华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划
	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自产品变更之日起【5】年,期满可展期。
	推广期	管理人与托管人协商一致即启动计划的推广工作。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	除产品开放期之外的日期
	开放期	自产品变更之日的下一周起,每周一与周三为开放期;若遇节假日及非交易日,则不开放
	建仓期	本集合计划建仓期自产品成立之日起不得超过 6 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 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: 0.08%/年 5、业绩报酬: 本集合计划对该产品年化收益率超过业绩报酬提取基准部分提取 60% 作为业绩报酬,提取频率不超过每 6 个月一次。 6、业绩报酬提取基准: 业绩报酬提取基准为产品变更时中国人民银行一年期定期存款基准利率+2.0% (截至 2019 年 9 月 1 日中国人民银行一年期定期存款利率为 1.5%)。自产品变更之后的业绩报酬提取基准,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）本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、货币市场基金，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定；（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）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（包括存款、债券）比例不低于资产总值的80%，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资产管理计划，不受前款规定限制。</p> <p>（3）全部资产投资于标准化资产的集合资产管理计划和证监会认可的其他资产管理计划，其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该资产管理计划资产净值的20%；（4）本集合计划投资信用债的债项评级不低于AA+，若无债项评级，则主体评级需满足该要求；短期及超短期融资券债项评级不低于A-1；（5）本集合计划持有剩余期限超过397天的债券当日市值不得超过集合计划净值的20%；（6）本集合计划投资评级为AA+的资产证券化优先级及信用债所对应的当日市值不得超过集合计划净值的20%，投资评级为AAA的资产则不受此限制。（7）现金类资产本集合计划现金类资产比例为资产总值的0-100%。开放期，现金类资产不低于本集合计划资产净值的5%。其中，现金类资产包括：现金、通知存款、可提前支取的银行存款及大额存单、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。（8）集合资产管理计划开放退出期内，其资产组合中7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>法律法规或中国证监会允许计划投资其他品种的，资产管理人应事先取得投资者同意，在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>本集合资产管理计划的建仓期为自产品成立之日起6个月。建仓期的投资活动，应当符合本资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地</p>

		方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，本资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。
	适合推广对象	本集合资产管理计划主要投资于债券等固定收益类金融工具，风险评级为 R1 级，可面向 C1、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	交通银行股份有限公司
	代理推广机构	华安证券股份有限公司
计划的参与	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
	办理方式、程序	<p>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、在推广期内，当集合计划募集规模接近或达到约定的规模上限时，管理人将自次日起暂停接受参与申请。</p> <p>4、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>5、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>6、投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认后，构成本合同的有效组成部分；</p> <p>7、投资者参与申请确认后，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>8、投资者于 T 日提交参与申请后，可于 T+2 日后在办理参与的推广机构查询参与确认情况。</p> <p>9、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投资者的参与申请，并以最高募集规模为上限，按“时间优先、金额优先”的原则，来确定参与成功的份额，即首先按照参与时间，先参与者先确认，对于同等参与时间的投资者参与申请，金额高者先确认，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> <p>10、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>1) 本计划份额持有人达到 200 户；</p> <p>2) 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>3) 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>4) 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>5) 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>1) 不可抗力导致无法受理投资者的参与申请；</p> <p>2) 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</p>

安证

		<p>净值和计划份额净值；</p> <p>3) 发生本合同规定的暂停计划资产估值情况；</p> <p>4) 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	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	退出安排	<p>1、退出的办理时间</p> <p>退出在开放期办理。</p> <p>2、退出的原则</p> <p>(1) “未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出申请日（T 日）集合计划每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) “先进先出”原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额。</p> <p>3、退出的程序和确认</p> <p>(1) 退出申请的提出</p> <p>投资者必须根据本集合计划推广机构规定的手续，在开放日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投资者持有份额数量时，申请无效。</p> <p>(2) 退出申请的确认</p> <p>投资者可在 T+2 日（包括该日）之后到推广机构取得 T 日退出申请成交确认单，若交易未成功或数据不符，投资者可与为其办理手续的人员联系并进行核实。</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+3 日内从托管账户划出。</p> <p>4、退出费及退出份额的计算</p> <p>(1) 退出费用</p> <p>退出费率为 0%。</p> <p>(2) 退出金额的计算方法</p> <p>本集合计划退出时以申请日计划单位净值作为计价基准，按实际金额支付。退出金额的计算公式如下：</p> <p>退出金额 = T 日计划单位净值 × 退出份额 - 业绩报酬</p> <p>上述计算结果均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>(3) 收取方式</p> <p>投资者退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出投资者的指定账户，退出款项将在 T+3 日内从托管账户划出。如集合计划出现暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。</p> <p>5、退出的限制与次数</p> <p>每次退出的最低份额为 1000 份，投资者可将其部分或全部集合计划份额退出。投资者在本计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，应符合合格投资者标准，且参与金额应满足资产管理计划首次参与的最低金额限制（不含参与费用），</p>

已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。投资者部分退出资产管理计划的，其退出后持有的资产管理计划份额市值应当不低于规定的合格投资者首次参与的最低金额。投资者持有的资产管理计划份额市值低于规定的首次参与的最低金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。否则，该部分份额将被强制退出。本集合计划不设退出次数限制。

在符合上述规定的前提下，管理人可根据市场情况，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制并告知投资者。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。

6、单个投资者大额退出的认定、申请和处理方式

(1) 单个投资者大额退出的认定

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。

(2) 单个投资者大额退出的申请和处理方式

当投资者申请大额退出时，需提前 3 个工作日向管理人提出书面预约。如构成巨额退出，应按巨额退出程序办理。

7、巨额退出的认定和处理方式

(1) 巨额退出的认定

单个开放日，投资者当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的 10% 时，即为巨额退出。

(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出：

全额退出：当管理人认为有条件支付投资者的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分顺延退出：当管理人认为支付投资者的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额 10% 的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将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；未能受理的退出部分，投资者可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以该工作日的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

(3) 告知客户的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

8、连续巨额退出的认定和处理方式

(1) 连续巨额退出的认定

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

(2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按说明书及资产管理合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在管理人指定网站上进行公告。

9、拒绝或暂停退出的情形及处理方式；

	<p>在如下情况下，管理人可以暂停接受投资者的退出申请：</p> <p>(1) 因不可抗力导致管理人无法支付退出款项。</p> <p>(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) 当委托人单日申请退出份额超过 1000 万份以上（包括 1000 万份）时，未提前 3 个工作日向管理人提出书面预约的；</p> <p>(6) 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集合计划，应符合《管理办法》、《运作规定》和中国证监会及中国证券投资基金业协会的相关规定。</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： (1) 管理人持有计划份额与投资者持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也有承担与计划份额相对应损失的风险。 (2) 本集合计划管理人自有资金参与份额部分只采取现金分红，不采取红利再投资方式。</p> <p>5、管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月，参与、退出时应当提前 5 个工作日告知投资者和托管人，但因规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与集合计划比例超过法律、法规及本合同规定的上限时的退出除外。</p> <p>6、为应对巨额退出，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，管理人及其附属机构参与的自有资金参与、退出可不受上述第 3、5 点的限制，但需事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会报告。</p> <p>7、本集合计划因规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划比例超过法律、法规及本合同规定的上限时，管理人有权在当日立即退出全部或部分自有资金，并在事后及时告知投资者和托管人。</p> <p>8、风险揭示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注计划规模变动情况，控制流动性风险。</p> <p>9、信息披露：管理人及时在管理人指定网站公告自有资金参与或退出情况。</p>

		10、管理人应定期将本计划投资者变更情况报送协会。
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> <ol style="list-style-type: none"> 1、推广过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定; 2、参与资金总额(不含参与费)不低于1000万元人民币; 3、参与客户不少于2人(含); 4、符合本合同及说明书的相关约定; 5、相关法律、法规规定的其他条件。
计划设立失败(本金及利息返还方式)		<p>募集期届满,本计划未达到本合同约定的成立条件的,本计划募集失败,则管理人应当承担下列责任:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用; 2、在募集期届满后30日内返还投资者已缴纳的款项,并加计银行同期活期存款利息,利息金额以本计划注册登记机构的记录为准;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		<p>集合计划存续期间,投资者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本计划份额,并按规定办理份额变更登记手续。转让后,持有本计划份额的合格投资者合计不得超过200人。管理人应当在本计划份额转让前,对受让人的合格投资者身份和本计划的投资者人数进行合规性审查。受让方首次参与本计划的,应当先与管理人、托管人签订资产管理合同。</p>
费用、报酬	费用种类(计提标准、方法、支付方式)	<ol style="list-style-type: none"> 1、管理费 在通常情况下,集合资产管理费按前一日集合资产净值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资产管理费; 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。 2、托管费 在通常情况下,集合资产的托管费按前一日集合计划资产净值0.08%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资产托管费; 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。 3、证券交易费用: 本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认(申)购和赎回费、印花税等有关税费,作为交

易成本直接扣除。

4、证券账户开户费用：产品成立后开立证券账户，证券账户开户费由管理人出具指令从集合计划中扣划；若证券账户开立时产品未成立或产品资金不足，证券账户开户费由管理人在开户时先行垫付，待产品成立或产品资金足够时由管理人出具指令从集合计划中划扣，托管人不承担垫付开户费用义务。

5、其他费用：其他费用由管理人本着保护投资者利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。

不由计划承担的费用
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。

业绩报酬

1、管理人收取业绩报酬的原则：
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；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；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；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；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。

2、业绩报酬的计提方法：
本集合计划每笔份额的业绩报酬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）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率R，作为计提业绩报酬的计算基础。年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1 - P_0}{P} \times \frac{365}{N} \times 100\%$$

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。
如R小于或者等于业绩报酬计提标准，则不计提业绩报酬；如R大于业绩报酬计提标准，则对超过业绩报酬计提标准部分的60%计提业绩报酬。
具体业绩报酬计算方法如下

年化收益率(R)	提取比例	业绩报酬(F)
$R \leq$ 业绩报酬计提基准	0	0
$R >$ 业绩报酬计提基准	60%	$F = A \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 60\% \times N / 365$

注：①F为投资者每笔参与应提取的业绩报酬；
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

		<p>值总额。</p> <p>3、业绩报酬支付： 业绩报酬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，管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不作复核。</p>
收益分配	收益构成	<p>本集合计划收益包括集合计划投资所得债券利息、红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。</p> <p>资产管理计划可供分配收益：指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。</p>
	分配原则	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、收益分配时，如果符合本合同约定的管理人业绩报酬计提条件的，将在收益分配的同时计提或提取管理人业绩报酬。</p> <p>5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>
	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>1、有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <p>(1) 管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格，且在六个月内无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的；</p> <p>(2) 托管人因重大违法、违规行为，被监管机关取消业务许可，不能继续担任集合计划托管人，且在六个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的；</p> <p>(3) 管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，且在六个月内无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的；</p> <p>(4) 托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，且在六个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的；</p> <p>(5) 集合计划存续期间，持续五个工作日本集合计划投资者少于 2 人（不含管理人）；</p> <p>(6) 不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；</p> <p>(7) 发生资产管理合同约定的应当终止的情形；</p> <p>(8) 经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；</p> <p>(9) 计划存续期满且不展期；</p> <p>(10) 法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。</p> <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。</p> <p>2、集合计划的清算</p> <p>(1) 自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；</p>



	<p>(2) 清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</p> <p>(3) 管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费、及运营过程中发生的增值税及附加税费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例或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，并注销集合计划证券账户。清算分配结束后及时注销托管账户；在计划财产移交前，由托管人负责保管。清算期间，任何当事人均不得运用该财产。清算期间的收益归属于计划财产，发生的保管费用由被保管的计划财产承担。因投资者原因导致计划财产无法转移的，托管人和管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理；</p> <p>(4) 清算小组在本计划终止后 20 个工作日内编制计划财产清算报告，由管理人或销售机构按照投资者提供的联系方式或由管理人通过其公司网站告知投资者。投资者在此同意，上述报告不再另行审计，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。清算结束后 5 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果。管理人应当在资产管理计划清算结束后五个工作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>(5) 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；</p> <p>(6) 固定管理费、托管费计提规则是以当日资产净值为基数在下一日计提，对于合同最后一日固定管理费、托管费则以当日资产净值为基数在当日计提；</p> <p>(7) 管理人应匡算合同终止日下一个月的最低备付金及交易保证金，并保证有足够的资金进行场内清算。</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>