

东证融汇汇誉 9 号集合资产管理计划 销售公告

东证融汇汇誉 9 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）将于 2021 年 5 月 18 日正式发售，初始募集期为 2021 年 5 月 18 日至 2021 年 5 月 21 日。本集合计划管理人为东证融汇证券资产管理有限公司，托管人为招商银行股份有限公司宁波分行，注册登记机构为东证融汇证券资产管理有限公司。

本集合计划为商品及金融衍生品类集合资产管理计划。首次参与的最低金额为人民币 100 万元（不含参与费用），超过最低参与金额的部分不设金额级差；追加参与的最低金额为人民币 1 万元，超过部分不设金额级差。

一、本集合计划投资范围

本集合计划投资范围包括证券市场柜台交易的期权合约、收益互换、收益凭证及其他金融衍生品、银行存款（包括银行定期存款、协议存款、同业存款、活期存款）、货币市场基金以及法律法规或中国证监会认可的其他投资品种。

本集合计划投资于金融衍生品的，投资者同意并授权管理人代表本集合计划根据相关监管要求签署《中国

证券市场金融衍生品交易主协议》及其《补充协议》等文件。

本集合计划投资于场外期权、收益互换、收益凭证等非标准化金融衍生品的，管理人应于每个封闭期开始之前，通过指定官网披露本集合计划所投资非标准化金融衍生品的挂钩标的（如有）等要素。

二、本集合计划管理期限

本集合计划管理期限为 4 年。如在本集合计划投资起始运作日起的 24 个月内发生提前终止事件，则本集合计划于发生提前终止事件的下一工作日终止，具体终止日以管理人公告为准。本集合计划成立后，管理人有权视市场情况，决定是否终止。

投资起始运作日指本集合计划正式开展投资活动之日（符合本集合计划合同约定的备案前投资活动除外），原则上为本集合计划完成备案的下一个交易日，具体日期以管理人公告为准。

三、本集合计划的开放期

本集合计划自成立之日起封闭运作，并在计划投资起始运作日起满 24 个月的对日（如遇节假日则顺延）首次开放参与/退出。首次开放后每满 3 个月的对日（如遇节假日则顺延）开放参与/退出。管理人可根据资产配置安排和本集合计划已有投资者利益的考虑进行额

度控制，具体开放期届时以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

除开放期以外的期间，均为封闭期，封闭期内本集合计划封闭运作，不接受投资者参与和退出申请。管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束开放期。开放期的具体日期以管理人公告为准。若出现其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

四、本集合计划首个投资运作期

本集合计划自投资起始运作日起的 24 个月称为“首个投资运作期”，期间封闭运作。如首个投资运作期内发生本集合计划合同约定的提前终止事件，则本集合计划于发生提前终止事件的下一个工作日终止。首个投资运作期的具体起止日期以管理人后续公告为准。

五、本集合计划投资非标准化金融衍生品的挂钩标的

本集合计划首个投资运作期内拟投资场外期权，挂钩标的为中证 500 指数（代码：000905.SH）。

六、本集合计划敲出价格、敲入价格及其计算方式

本集合计划首个投资运作期的敲入价格及计算方式不变动，敲入价格=期初参考价格*80%；首个投资运作期的第一、二个月不观察敲出，第三个月的敲出价格

=期初参考价格*100%，从第四个月开始，敲出价格每月递减 0.5%，最终敲出价格降为 89.5%。其中，期初参考价格为挂钩标的在期初观察日（即投资起始运作日，具体日期以管理人届时公告为准）的收盘价。

敲出价格、敲入价格及其计算方式具体信息如下：

第 i 个月	首个投资运作期敲入价格	首个投资运作期敲出价格
i=1	期初参考价格*80%	不观察敲出
i=2		不观察敲出
i=3		期初参考价格*100%
i=4		期初参考价格*99.5%
i=5		期初参考价格*99%
i=6		期初参考价格*98.5%
i=7		期初参考价格*98%
i=8		期初参考价格*97.5%
i=9		期初参考价格*97%
i=10		期初参考价格*96.5%
i=11		期初参考价格*96%
i=12		期初参考价格*95.5%
i=13		期初参考价格*95%
i=14		期初参考价格*94.5%
i=15		期初参考价格*94%
i=16		期初参考价格*93.5%
i=17		期初参考价格*93%
i=18		期初参考价格*92.5%
i=19		期初参考价格*92%
i=20		期初参考价格*91.5%
i=21		期初参考价格*91%
i=22		期初参考价格*90.5%
i=23		期初参考价格*90%
i=24		期初参考价格*89.5%

七、本集合计划首个投资运作期的业绩报酬计提基准

本集合计划管理人业绩报酬仅在首个投资运作期本计划终止时（含提前终止日）提取，提取计划实际年

化收益率超过业绩报酬计提基准部分的 60%作为业绩报酬。本计划首个投资运作期内每个敲出付息观察日对应的业绩报酬计提基准（年化）为 16%。本集合计划投资起始运作日起 3 个工作日内，管理人将通过指定官网公告本集合计划的敲出付息观察日。若出现其他特殊情况，管理人将视情况对前述敲出付息观察日及业绩报酬计提基准进行相应的调整并公告，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

上述业绩报酬计提基准仅作为业绩报酬计算的基准，供投资者参考，不作为实际收益分配的依据，不构成管理人对本集合计划未来业绩的任何承诺和保证，提请投资者关注产品投资风险、亏损风险。

本集合计划的具体投资范围、比例及成立条件详见《东证融汇汇誉 9 号集合资产管理计划资产管理合同》和《东证融汇汇誉 9 号集合资产管理计划说明书》。

八、本集合计划销售机构及相关信息

1、本集合计划的销售机构：

（1）东证融汇证券资产管理有限公司（直销）

网址：www.nesc.cn

服务热线：021-20361067

（2）东北证券股份有限公司（代销）

网址：www.nesc.cn

服务热线：95360

(3) 上海天天基金销售有限公司（代销）

网址：<http://fund.eastmoney.com>

服务热线：95021

2、本集合计划募集账户信息（直销）：

户名：东证融汇证券资产管理有限公司直销专户

银行账号：310066580018800040554

开户行：交通银行上海市浦东分行

大额支付号：301290050844

投资者在参与本集合计划前请仔细阅读《东证融汇汇誉9号集合资产管理计划资产管理合同》和《东证融汇汇誉9号集合资产管理计划说明书》，并按照销售机构的具体要求办理。

东证融汇证券资产管理有限公司

2021年5月14日