

中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划说明书

特别提示:

本计划说明书依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》等法律、行政法规和中国证监会有关规定制作, 管理人保证本计划说明书的内容真实、准确、完整, 不存在任何虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

投资者签署本计划说明书即表明其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, 并已阅知本计划说明书和《资产管理合同》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。本计划说明书不构成管理人、托管人和销售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》且合同生效后, 投资者即为《资产管理合同》的委托人, 其认购或申购资产管理计划份额的行为本身即表明其对《资产管理合同》及本计划说明书的承认和接受。投资者将按照《资产管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

(一) 资产管理计划名称和类型

名称	中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划
类型	本计划为混合类基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划
份额分级	无
杠杆水平	0

(二) 管理人与托管人概况、聘用投资顾问等情况

管理人(发行机构)	中信期货有限公司
托管人	兴业银行股份有限公司
投资顾问	无
销售机构	中信期货有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司

(三) 资产管理计划的投资范围、投资策略和投资限制情况, 投资风险揭示

投资范围	(一) 投资范围 1. 本计划投资于: 债券(不包括银行间债券)、货币市场基金、债券逆回购、证券公司资产管理计划、基金公司(含基金子公司)特定客户资产管理计划、期货公司资产管理计划、保险公司资产管理计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行并由具有相关资质机构托管的契约式私募证券投资基金、银行理财产品以及中国证监会认可的其他投资品种。 2. 法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的, 管理人在履行合同变更程序后, 可以将其纳入本计划的投资范围。在履行合同变更程序后, 可以变更《资产管理合同》约定的投资范围。 (二) 投资比例 本计划作为混合类集合资产管理计划, 投资组合比例应符合以下规定: 1. 投资于存款、债券等债权类资产的比例低于资产管理计划总资产 80%; 2. 投资于股票等权益类资产的比例低于资产管理计划总资产 80%; 3. 投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值比例低于资产管理计划总资产 80%, 或衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%; 4. 本计划的总资产占净资产的比例不超过 200%; 5. 本计划投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 25%。管理人管理的全部集合资产管理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。 6. 本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产品, 按市值计算, 不得低于本计划资产净值的 80%。
投资策略	本计划基于宏观情况下的资产配置, 在兼顾流动性的条件下, 投资于各类资产管理产品及私募证券投资基金, 追求绝对收益。通过定期评价各类资产表现, 跟踪子基金策略收益、子基金资产相关性与策略相关性, 在遵守监管相关规定与合同约定的前提下, 根据市场情况调整资产与策略的配置比例, 以期获得较高的收益风险比。 本计划主要采用 FOF 策略。子基金的投资采用多策略组合、多交易品种分散投资; 子基金综合考虑管理人的主体资格和单个策略的风险收益特征以及策略和策略之间的相关性特征等。通过精选管理人、

	分散策略、动态跟踪并及时进行调仓止损，实现投资品种以及策略的多元化，从而有效地分散风险，强化母基金整体收益的安全。
投资限制	为维护本计划投资者的合法权益，按照法律法规以及《资产管理合同》的约定，集合计划投资将遵守下列限制性规定： 1、不得直接投资于股票、期货类等权益类资产； 2、投资于单一资产的比例不得超过计划资产总值的 25%（按市值法计算）。管理人管理的全部集合资产管理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。 3、本计划的总资产占净资产的比例不超过 200%； 4、本计划所投资的资管产品不再投资公募基金以外的其他产品。 5、本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产品，按市值计算，不得低于本计划资产净值的 80%。
投资风险揭示	投资有风险。当您参与资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您在作出投资决策之前，请仔细阅读《中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书》和《中信期货睿意全天候 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》“风险揭示”章节，充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。
风险等级	R3-中风险
产品风险收益特征	中风险中收益
最不利投资情形	全部本金亏损
（四）收益分配和风险承担安排	
收益构成	本资产管理计划可供分配收益包括：计划投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入等。因运用计划财产带来的成本或费用的节约计入收益。
分配原则	（一）每份计划份额享有同等分配权（因管理人业绩报酬的存在，每份额计划实际得到的分红金额可能有所不同）； （二）基本分红条件为：计划收益分配基准日的计划份额净值减去计划份额收益分配的金额后不能低于 1.00 元/份，但资产管理计划终止日进行分配的除外； （三）在满足基本分红条件前提下，本计划每年收益分配次数最多为 2 次，两次收益分配的间隔时间不得低于 6 个月，若资产管理计划成立不满 3 个月可不进行收益分配； （四）在满足基本分红条件前提下，本计划可以进行收益分配。本计划的分红权益登记日和收益分配基准日由管理人确定。本计划红利发放日距离收益分配基准日（可供分配利润计算截止日）的时间不得超过 15 个工作日； （五）法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。
分配方式	（一）本计划默认分红方式为现金分红，投资者可以选择现金分红或红利再投资分红方式。委托人同意遵守注册登记机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制定的规则）。 （二）委托人可以选择将所获红利再投资于本计划，选择采取红利再投资形式的，分红资金在扣除管理人业绩报酬（如有）后，按分红除权日的集合计划每份额净值转成集合计划份额。集合计划份额计算要保留到小数点后两位数，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。
风险承担	资产管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。
（五）管理人、托管人报酬，以及与资产管理计划财产管理、运用有关的其他费用的计提标准和计提方式	
管理人报酬计提标准、计提方式	（一）管理人的管理费 管理费按前一日计划资产净值的【1.0】%年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 【1.0】\% \div 365$ H 为每日应计提的管理费 E 为前一日的资产管理计划资产净值（成立当日以初始委托计划份额总数计提）。本计划的管理费每日计提，逐日累计至每季度季末最后一个自然日，按季支付，由管理人与托管人双方核对无误后，管理人有权于次季度后的 15 个工作日内向托管人发送管理费划款指令，托管人收到划款指令后从资产管理计划财产中将应付未付的管理费一次性支付给管理人。 （二）管理人的业绩报酬 本计划于资产委托人退出时、分红时、计划终止清算时采用单人单笔高水位净值法计提业绩报酬。于退出时计提业绩报酬，退出确认为计提日，退出日为基准日，业绩报酬从投资者的退出资金中扣除。 于分红时计提业绩报酬，分红登记日为计提日，登记日前两个工作日为基准日，业绩报酬从投资者

	的可分红资金中扣除且不超过可分红资金。 于终止清算时计提业绩报酬，业绩报酬从投资者的清算资金中扣除。 资产管理人将根据投资者每笔投资的年化收益率，对年化收益率超过 7% 以上部分按 10% 比例收取业绩报酬。 计算公式如下： $R_{i,j} = \frac{NAV_{i,j}^k - NAV_{i,j}^h}{NAV_{i,j}^l} \times 365 \div T$ <table border="1"> <tr> <th>年化收益率</th><th>计提公式</th></tr> <tr> <td>$R_{i,j} < 7\%$</td><td>$E=0$</td></tr> <tr> <td>$R_{i,j} \geq 7\%$</td><td>$E = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m [S_{i,j} \times NAV_{i,j}^l \times (R_{i,j} - 7\%) \times 10\% \times T \div 365]$</td></tr> </table> 其中，$R_{i,j}$ 为第 i 个投资者持有的第 j 笔份额的年化收益率； $NAV_{i,j}^k$ 为本次业绩报酬计提基准日第 i 个投资者持有的第 j 笔份额的份额累计净值； $NAV_{i,j}^h$ 为前一次业绩报酬计提基准日第 i 个投资者持有的第 j 笔份额的份额累计净值（首次计提时，则为初始面值或参与时份额累计净值）； $NAV_{i,j}^l$ 为前一次业绩报酬计提基准日第 i 个投资者持有的第 j 笔份额的份额净值（首次计提时，则为初始面值或参与时份额净值）； T 为前一次业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数； E 为此次应计提的业绩报酬； $S_{i,j}$ 为此次业绩报酬计提时第 i 投资者持有的第 j 笔计划份额； n 为此次业绩报酬计提时涉及的投资者数量； m 为此次业绩报酬计提时涉及的每个投资者涉及的持有份额笔数。	年化收益率	计提公式	$R_{i,j} < 7\%$	$E=0$	$R_{i,j} \geq 7\%$	$E = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m [S_{i,j} \times NAV_{i,j}^l \times (R_{i,j} - 7\%) \times 10\% \times T \div 365]$
年化收益率	计提公式						
$R_{i,j} < 7\%$	$E=0$						
$R_{i,j} \geq 7\%$	$E = \sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m [S_{i,j} \times NAV_{i,j}^l \times (R_{i,j} - 7\%) \times 10\% \times T \div 365]$						
托管人报酬计提标准、计提方式	托管费按前一日计划资产净值的【0.05】% 年费率计提，计算方法如下： $H2 = E2 \times 【0.05】\% \div 365$ H2 为每日应计提的托管费 E2 为前一日的资产管理计划资产净值（成立当日以初始委托计划份额总数计提）。本计划的托管费每日计提，逐日累计至每季度季末最后一个自然日，按季支付，由资产管理人与资产托管人双方核对无误后，管理人有权于次季度后的 15 个工作日内向资产托管人发送托管费划款指令，资产托管人收到划款指令后从资产管理计划财产中将应付未付的托管费一次性支付给资产托管人。						
投资顾问报酬计提标准、计提方式	无						
其他由资产管理计划承担的费用	（一）资产管理计划财产开立账户需要支付的费用； （二）银行账户的资金结算汇划费、账户维护费； （三）资产管理计划在发生投资交易时按规定比例支付的经手费、证管费、过户费、印花税、佣金等，直接计入当期费用； （四）份额登记机构等资产管理计划的行政服务机构的服务费（如有）； （五）资产管理计划成立以后与计划资产运作相关的会计师费、律师费等中介服务费，资产管理计划合同生效后与之相关的信息披露费用； （六）与资产管理计划运作直接相关应税项目或应税行为产生的增值税及附加税费； （七）按照法律法规规定及《资产管理合同》约定的应当由资产管理计划承担的其他费用。						
不由资产管理计划承担的费用	一、管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划财产的损失。 二、管理人和托管人处理与计划运作无关事项或不合理事项所发生的费用等。 三、资产管理计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用。 四、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入计划费用的项目。						
（六）参与费、退出费等投资者承担的费用和费率，以及投资者的重要权利和义务							
封闭期、开放日约定	本资产管理计划不设封闭期。 本计划的开放日分为申购开放日和赎回开放日。本计划申购开放日为每月 15 日-17 日（如遇非交易日则顺延至下一交易日），接受计划份额的参与；赎回开放日为每年的 1 月和 7 月首个申购开放日的前一个交易日，接受计划份额的退出。举例：若本计划 2021 年 8 月 1 日成立，2021 年 8 月 16 日-8 月 18 日为申购开放日（遇非交易日则顺延至下一交易日），以此类推；2022 年 1 月 14 日为赎回开放日，以此类推。 申请参与的资产委托人应在开放日前 5 个工作日内至 1 个工作日，即 T-5 个工作日内至 T-1 个工作日（含）15:00 前向资产管理人提交参与申请，参与成功以委托人已签署合同并且参与资金到达募集账户为准。 申请退出的资产委托人应在开放日前 15 个工作日内至 10 个工作日，即 T-15 个工作日内至 T-10 个工作日（含）15:00 前向资产管理人提交退出申请。						

	未在前述期间提交参与或退出申请书的，管理人有权拒绝受理委托人的参与或退出申请。 存续期间，资产管理人有权调整开放日以及委托人必须提交申请的时间，并通知资产托管人。有权根据证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况对开放日及开放时间作相应调整。
认购费/参与费	本计划认购费/参与费率为 0。
退出费/赎回费	资产委托人于其认购/申购后的 1 年（按 365 天计，下同）内于开放日申请退出的，需缴纳 2% 的退出费用。在其认购/申购后的 1 年（含）后于开放日申请退出的，不需要缴纳退出费用。退出费用（如有）由退出资产管理计划份额的委托人承担，在委托人退出资产管理计划份额时收取，其中 50% 归属委托资产，50% 归属资产管理人。归属资产管理人部分，资产管理人有权减免。
认购、参与、退出办理的方式、程序	（一）“未知价”原则，即委托人按约提交参与申请或/且退出申请后，资产管理计划份额的参与和退出价格以开放期（即：T 日）当日的计划份额净值为基准进行计算。 （二）资产管理计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。 （三）委托人办理参与、退出等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《资产管理合同》规定的前提下，以管理人或销售机构的具体规定为准。 （四）参与和退出申请的确认。销售机构受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了参与和退出申请。参与和退出申请的确认以份额登记机构的确认结果为准。本计划的人数规模上限为 200 人。管理人按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效参与申请。超出计划人数上限的参与申请为无效申请。 在正常情况下，份额登记机构在【T+3】日内对 T 日参与和退出申请的有效性进行确认。若参与不成功，管理人应在【T+3】日起三十日内无息退还委托人已缴纳的款项。 （五）参与和退出申请的款项支付。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无息退回委托人指定资金账户。参与资金在份额确认之前不计利息。委托人退出申请成交后，管理人应按规定向委托人支付退出款项，退出款项自开放日起 9 个工作日内划往委托人的退出账户或者销售机构指定的账户。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按《资产管理合同》和有关法律法规规定处理。
投资者的重要权利和义务	投资者的权利包括但不限于：分享本资产管理计划财产收益；按照资产管理合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；按照法律法规及资产管理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；监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况等。 投资者的义务包括但不限于：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；接受合格投资者认定程序；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（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；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；退还因管理人、托管人、代理销售机构过错导致投资者获得的不当利得等。 投资者的权利与义务详见资产管理合同“当事人及权利义务”章节。
（七）募集期间和产品期限	
募集期间	初始募集期限具体以管理人公告为准，但初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不得超过 60 天。
最低认购金额	本计划接受合格投资者以货币资金认购，最低认购金额为人民币【40】万元，且可追加认购，追加认购金额为【1】万元的整数倍。前述认购金额均不包含认购费。投资者将红利再投资不受前述限制。
成立条件	资产管理计划成立应当具备以下条件： （一）募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定； （二）募集金额达到《资产管理合同》约定的成立规模，且不违反中国证监会规定的最低成立规模； （三）投资者人数不少于二人，且不超过二百人； （四）符合中国证监会规定以及资产管理合同约定的其他条件。
成立失败的处理	资产管理计划初始销售期限届满，不能满足本计划成立条件的，资产管理人应当： 1. 以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用。 2. 在资产管理计划初始销售期限届满后 30 日内退还客户已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息（按照募集账户开立的银行所公布的当期活期存款利率计算委托人认购资金所对应的利息）。利息金额以本资产管理计划注册登记机构的记录为准。
产品期限	10 年
（八）信息披露的内容、方式和频率	
信息披露的内容	资产管理计划应向投资者提供下列信息披露文件： （一）资产管理合同、计划说明书和风险揭示书； （二）资产管理计划净值，资产管理计划参与、退出价格； （三）资产管理计划定期报告，包括季度报告和年度报告；

	管理人应当向委托人提供资产管理计划季度报告和年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况，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； 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. 资产管理计划财务会计报告； 7. 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、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。 资产管理计划季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。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和年度报告。资产管理计划当季度/年度终止的，管理人可以不编制本季度、本年度报告。 （四）重大事项的临时报告； （五）资产管理计划清算报告； （六）法律法规规定的应向投资者披露的其他事项。
信息披露的方式	《资产管理合同》全体当事人一致同意，除特别明确约定外，《资产管理合同》中约定的管理人向投资者进行的通知、通告、告知等都通过管理人网站（https://www.citicsf.com）向投资者披露，不再另行单独通知投资者。管理人通过网站披露法律法规及《资产管理合同》约定的信息，视为管理人已履行披露、通知义务。销售机构另有规定的，从其规定。
信息披露的频率	在资产管理计划运作期间，管理人应当按照以下要求向委托人提供相关信息： 1. 投资标准化资产的资产管理计划至少每周披露一次经托管人复核后的份额净值； 2. 经托管人复核后的开放式资产管理计划（如本计划为开放式资产管理计划）净值的披露频率不得低于资产管理计划的开放频率，分级资产管理计划（如本计划属于分级产品）应当披露各类别份额净值； 3. 每季度结束之日起一个月内披露季度报告，每年度结束之日起四个月内披露年度报告； 4. 发生《资产管理合同》约定的或者可能影响委托人利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向委托人披露； 5. 中国证监会规定的其他要求。
（九）利益冲突情况以及可能影响投资者合法权益的其他重要事项	
利益冲突情况	一、资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形 本计划存在的或可能存在的利益冲突情形包括但不限于： 1、管理人或将计划的资产投资于本机构、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券； 2、管理人或将计划的资产投资于管理人、管理人关联方所设立的资产管理产品； 3、管理人及其附属机构有权以自有资金参与本计划； 4、管理人的董事、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均有权参与本计划； 5、其他可能产生利益冲突的情形。 二、资产管理计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率 管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，采取有效措施，做好充分的信息隔离和利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范、管控可能的利益冲突。管理人运用资产管理计划财产从事关联交易的，事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露；运用资产管理计划财产从事重大关联交易的，事先取得投资者同意，并避免损害投资者利益。具体安排包括： 1、投资者签署《资产管理合同》即视为其授权管理人可以从事《资产管理合同》第三十六条第一款情形下的关联交易，管理人将严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及《资产管理合同》的约定，在交易完成后及时书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者，并按相关规定报告或备案。 2、管理人不得将其管理的资产管理计划资产投资于管理人管理的其他资产管理计划，依法设立的基金中基金资产管理计划以及中国证监会另有规定的除外。其他涉及《资产管理合同》第三十六条第二款利益冲突情形的，管理人将严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及《资产管理合同》的约定，采取有效措施，做好各资产管理产品间充分的信息隔离和利益冲突管理，确保公平交易，并向投资者进行披露。 3、若涉及了《资产管理合同》第三十六条第三款利益冲突情形的，管理人及其附属机构将确保严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及《资产管理合同》的约定，与集合计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险。 计划存续期间，管理人自有资金参与计划的持有期限不得少于 6 个月，参与、退出时，提前 5 个工作日通过管理人网站公告告知投资者和资产托管机构。 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，管理人以自有资金参与及其后续退出本计划可不受前款限制，但将事后及时通

	过管理人网站公告告知投资者和托管人，并根据相关规定报告。 4、 若涉及了《资产管理合同》第三十六条第四款利益冲突情形的，管理人将严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及《资产管理合同》的约定，该部分投资者与本计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险。管理人将及时通过管理人网站公告向投资者进行披露，并对该资产管理计划账户进行监控，以及根据相关规定及时进行报告。 5、 若管理人涉及了其他利益冲突情形的，管理人将严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及《资产管理合同》的约定，及时履行相应的信息披露义务。
计划份额转让	在技术条件成熟的条件下，经管理人同意并开通份额转让事宜之后，本计划份额可以转让。转让后，持有本计划份额的合格投资合计不得超过 200 人。本计划份额转让是指在资产管理计划存续期间，客户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资产管理计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。受让方应接受管理人的合规性审查并确保其自身满足本计划的合格投资者条件，首次参与的本计划的，应先与管理人、托管人签订资产管理合同。 本计划转让平台、转让时间、暂停转让的情形及处理方式等事宜以管理人公司网站公告为准。
巨额赎回约定	(一) 巨额退出的认定：在单个开放日，集合计划净退出申请份额(退出申请总数扣除参与申请总数后的余额)超过上一个工作日集合计划总份额的【20%】时，即为巨额退出。 (二) 巨额退出的程序：巨额退出时，管理人可以根据发生巨额退出的集合计划当时的资产组合状况决定全额退出，或部分顺延退出。 1. 全额退出：当管理人认为有条件支付投资者的全部退出申请时，按正常退出程序办理。 2. 部分顺延退出：当资产管理人认为全额支付资产委托人的退出申请有困难或认为全额支付资产委托人的退出申请可能会对资产管理计划的资产净值造成较大波动时，资产管理人在当日接受退出比例不低于上一日资产管理计划总份额的 20%的前提下，对其余退出申请延期予以办理。对于单个资产管理计划资产委托人的退出申请，应当按照其申请退出份额占当日申请退出总份额的比例，确定该单个资产管理计划资产委托人当日办理的退出份额；资产委托人未能退出部分，除资产委托人在提交退出申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，退出价格为下一个开放日的价格。依照上述规定转入下一个开放日的退出享有退出优先权，并以此类推，直到全部退出为止。部分顺延退出不受单笔退出最低份额的限制。
连续巨额赎回约定	集合计划连续两个开放日以上（含两个开放日）发生巨额退出导致集合计划的现金支付出现困难的，即认为发生了连续巨额退出。连续巨额退出如管理人认为有必要，可暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，并应当管理人网站以公告的形式通知投资者。
其他重大信息	本说明书作为资产管理合同的有效组成部分，与资产管理合同具有同等法律效力。本说明书与资产管理合同中的约定存在冲突的，以资产管理合同的约定为准。
客户服务及投诉受理电话	021-60812938
(十) 中国证监会规定的其他事项：无	

如果您已知晓并理解本资产管理计划的关键要素及产品风险，请确认此投资行为为您本人意愿，愿意自行承担此投资风险。请您抄写以下内容：

“本人已充分理解本计划说明书，知晓产品风险，自愿购买本产品，购买意愿真实，愿意自行承担此投资风险。”

投资人签名：

日期： 年 月 日