

先锋期货长兴 FOF1 号集合资产管理计划

计划说明书

2022 年 1 月

特别提示:

本计划说明书根据《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》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《先锋期货臻选 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》(下称《管理合同》)等相关法律法规和中国证监会有关规定制作,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。

委托人承诺以真实身份参与资管计划,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管计划资产,但不保证资管计划一定盈利,也不保证最低收益。本说明书不构成管理人、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》的委托人,其认购或申购资管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。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。

本计划的 基本信息	名称	先锋期货臻选 FOF1 号集合资产管理计划
	类型	固定收益类 FOF
	运作方式	开放型
	存续期限	10 年
	份额初始募集面值	人民币 1.00 元。
	最低初始募集规模	不低于 1000 万元人民币
	预警/止损线	有: 预警线为 0.9200 元/份; 止损线为 0.9000 元/份。
当 事 人	管理人	先锋期货有限公司
	托管人	国泰君安证券股份有限公司
	运营外包机构	国泰君安证券股份有限公司
	投资顾问	无

	推广机构	先锋期货有限公司
本计划的 投资信息	投资范围	1、投资范围 (1) 权益类资产/股权类资产：证券交易所发行上市的股票（包括但不限于新股申购、上市公司非公开发行股票）、港股通标的范围内的股票、证券交易所发行上市的存托凭证、股票型及混合型公募基金。 (2) 固定收益类资产/债权类资产：证券交易所或银行间市场发行交易的债券、证券交易所或银行间市场发行交易的资产支持证券、银行间市场发行交易的资产支持票据、债券逆回购、同业存单、现金、银行存款（包括定期存款、活期存款、协议存款、结构性存款及其他银行存款）、货币市场基金。 (3) 资产管理产品类资产：证券公司及其子公司资产管理计划、基金公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募基金。
	投资比例	(1) 本计划穿透投资于【固定收益类资产/债权类资产】投资比例依【市值】合计不低于资产管理计划财产总值的 80%】; (2) 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资产管理产品的投资比例依【市值】合计不低于资产管理计划资产总值的 80%。 上述投资比例，如涉及穿透核查或穿透合并计算的，管理人应当定期向托管人提供相应底层核查材料或计算数据，托管人仅按照管理人提供的材料及提供频率进行事后监督，管理人应确保对所提供数据材料的真实性、准确性以及完整性负责。
	投资策略	根据投资策略类型、收益、回撤、投资团队背景及技术含量等客观、主观指标进行所投资或预计投资的资产管理产品的筛选。
	投资限制	1、本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过【200%】; 2、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%；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。同一资产的认定及计算方式：股票、存托凭证、债券、资产支持证券、资产支持票据、同业存单、各类资产管理产品、债券逆回购按单只证券或产品市值进行计算；期货、期权按占用保证金合计进行计算；资产管理人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%。 3、本计划不得投资于结构化金融产品（含资产证券化产品）的次级/劣后级份额（公募基金除外）； 4、本计划开放退出期内，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%。 5、本计划不得投向未经具有证券投资基金托管资格的机构托管的私募基金； 6、本计划投资的资产管理产品或私募基金必须以股票、债券、公募证券投资基金、商品及金融衍生品等各类标准化金融资产为最终投资标的。 7、本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该资产管理计划资产净值的 20% 上述投资限制，如涉及穿透核查或穿透合并计算的，管理人应当定期向托管人提供相应底层核查材料或计算数据，托管人仅按照管理人提供的材料数据及提供频率进行事后监督，管理人应确保对所提供数据材料的真实性、准确性以及完整性负责。
	风险等级	本资产管理计划属于(R3)风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为(C3)及以上的普通合格投资者及专业投资者。
	投资风险揭示	投资有风险。当您/贵机构认购或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/贵机构在做出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同，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。
收	利润构成	本计划可供分配收益为截止收益分配基准日本计划的累计未支付利润和已

益分配		实现收益的孰低数。本计划的累计未支付利润是指本计划的利息收入、投资收益、公允价值变动及其他收入等本计划运作产生的各项收入扣除管理费、托管费、运营服务费等本计划运作产生的各项费用后的余额；本计划已实现收益指累计未支付利润减去公允价值变动收益后的余额。
	分配原则和方式	(1)【本计划的收益分配方式为现金方式和红利再投资。】本计划收益分配默认采用现金方式,【红利再投资是将现金红利按照计划分红除权日的计划份额净值自动转为计划份额。】 (2) 同等份额的享有同等分配权。 (3) 收益分配基准日的份额净值减去每份份额收益分配金额后不能低于本计划初始面值。 (4) 当期收益先弥补上一年度亏损后,方可进行当年收益分配。 (5) 计划份额持有人可以选择收益分配方式。计划份额持有人变更收益分配方式的,应当通过销售机构提交申请,由份额登记机构进行处理。 (6) 本计划存续期内是否分配收益、收益分配比例和分配金额由管理人确定。
	分配方案的确定	(1) 收益分配方案由管理人根据本合同制定,包括收益分配的范围、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。 (2) 管理人应当于分红权益登记日前,将收益分配方案交由托管人复核,托管人应于收到收益分配方案后完成对收益分配方案的财务数据的复核,并将复核意见书面通知管理人。资产管理人应确保分配原则、分配时间及分配方式符合法律规定和合同约定,并保证资料的准确性。复核通过后,管理人通过网站公告等通知计划份额持有人收益分配方案。
	收益分配的执行	托管人根据管理人的收益分配方案和提供的红利金额的数据,在红利发放日进行处理。
风险承担		资产管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产,但不保证资产管理计划财产中的认购/参与资金本金不受损失,也不保证一定盈利及最低收益。资产管理计划运作过程中,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。
本计划的费用	管理费	管理费率为年费率 1.3%。在通常情况下，管理费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的管理费 E 为前一自然日的计划资产净值 本计划成立之日起，管理费每日计提，按季支付，由资产管理人于本计划成立之日的下一自然季度起，每季度首日起【10】个工作日内向资产托管人发送资产管理计划管理费划付指令，经资产托管人复核后于【3】个工作日内从资产管理计划资产中支付给资产管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。
	托管费	托管费率为年费率 0.025%。在通常情况下，托管费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的托管费 E 为前一自然日的计划资产净值 本计划成立之日起，托管费每日计提，按季支付，由资产管理人于本计划成立之日的下一自然季度起，每季度首日起【10】个工作日内向资产托管人发送资产管理计划托管费划付指令，经资产托管人复核后于【3】个工作日内从资产管理计划资产中支付给托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延
	运营服务费	运营服务费率率为年费率 0.025%。在通常情况下，运营服务费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times \text{年运营服务费率} \div \text{当年天数}$

	H 为每日应计提的运营服务服务费 E 为前一自然日的计划资产净值 本计划成立之日起，运营服务费每日计提，按季支付，由资产管理人于本计划成立之日的下一自然季度起，每季度首日起【10】个工作日内向资产托管人发送资产管理计划运营服务费划付指令，经资产托管人复核后于【3】个工作日内从资产管理计划资产中支付给运营服务机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。
业绩报酬	(1) 本计划业绩报酬计提基准为年化 8%。 (2) 业绩报酬的计提基准日：委托人退出日、分红权益登记日、计划清算日 (3) 业绩报酬的计算：采用单个委托人单笔投资年化收益差额法计提，即在业绩报酬计提基准日，资产委托人每笔所持份额或退出份额在持有期（即下述公式中的“T”，下同）的年化收益率大于业绩报酬计提基准时，分别计算每笔份额在上一成功计提基准日至本次计提基准日持有期间的年化收益率（R），对超出业绩报酬计提基准的持有期差额收益按 20%比例进行计提。
不列入资产管理计划费用的项目	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，不得在计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划资产的损失，以及处理与资产管理计划资产无关的事项发生的费用等不得列入资产管理计划费用。
税收	1、根据国家税收法律、法规相关要求，本计划运营过程中如发生增值税应税行为，使得资产管理人成为增值税纳税人的，源于本计划增值税应税行为而形成的增值税及其附加税费等相关税负由本计划资产承担。 2、本计划存续期间及清算后，如资产管理人被税务机关要求补缴由本计划增值税应税行为而形成的应由本计划资产承担的增值税及其附加税费等相关税负的，资产管理人有权向资产委托人就补缴金额进行追索。