

首创证券创赢9号集合资产管理计划说明书

2022年6月

特别提示：

本说明书依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（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《运作规定》）、《首创证券创赢9号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。

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《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集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。本说明书对集合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《管理合同》且合同生效后，投资者即为《管理合同》的委托人，其认购或申购集合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《管理办法》、《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	首创证券创赢9号集合资产管理计划
	目标规模	本集合计划推广期和存续期规模上限为50亿元，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推广期的目标规模，并由管理人在管理人指定网站公告。
	管理期限	本集合计划固定管理期限为10年。
	推广期	指自本集合计划启动推广之日起不超过60日的期间，具体推广时间以本集合计划推广公告为准。
	封闭期、开放期	1、封闭期：除开放期和临时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： 本集合计划自成立日起每6个月开放一次，若开放期遇法定节假日、休息日等则自动顺延。具体以管理人公告为准。 本集合计划于推广期或开放期前公告下一个封闭期的业绩报酬计提基准、具体开放日等相关要素。管理人通过深入分析国内外宏观经济走势、社会资金运动及各项宏观经济政策对金融市场特别是货币市场的影响，密切关注市场资金面松紧变化，把握市场利率走势，合理确定集合计划的规模、投资标的以及业绩报酬计提基准

	<p>的范围。管理人确定业绩报酬计提基准主要基于集合计划投资的债券回购、债券、货币市场基金等的收益情况估算，但并不是管理人向委托人保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺，投资风险为委托人自行承担。</p> <p>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。</p>
份额面值	人民币 1.00 元。
参与最低金额	首次参与的最低金额为人民币 30 万元，具体以管理人公告为准，追加参与的金额为人民币 10000 元的整数倍。
相关费率	<p>1、参与费：0%</p> <p>2、托管费：0.05%/年</p> <p>3、管理费：0.7%/年</p> <p>4、退出费：0%</p> <p>5、业绩报酬：对年化收益率超过业绩报酬计提基准以上的部分提取 60%作为管理人的业绩报酬，剩余 40%作为超额收益分配给委托人。</p> <p>6、其他费用：包括证券交易费用、证券账户开户费、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、会计师费、律师费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用。</p>
投资范围及投资比例	<p>1、投资范围</p> <p>本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债(含政策性银行债)、同业存单、企业债、项目收益债(NPB)、公司债(含非公开发行的公司债，下同)、资产支持证券(含证监会和银保监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券，限优先级，且底层不为产品)、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等银行间市场交易的投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型基金等。</p> <p>投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别，短期融资券、超短期融资券、短期公司债券如有债项评级则不低于 A-1。</p> <p>(2) 现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在 1 年内(含 1 年)的国债、到期日在 1 年内(含 1 年)的央</p>

		<p>行票据、到期日在1年内（含1年）的政府债券、不超过7天（含7天）的债券逆回购等。</p> <p>（3）固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的80%-100%。</p> <p>全体委托人一致同意，在本资产管理计划存续期间，为规避特定风险保护投资者合法权益的，本产品投资于固定收益资产的比例可以低于计划总资产的80%，但不得持续6个月低于计划总资产的80%。</p> <p>（4）债券回购：债券正回购或逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的100%。</p> <p>（5）本资产管理计划的总资产不得超过净资产的200%。</p> <p>（6）以成本价计算，本集合计划投资于单一标的债券金额不得超过该债券存续规模的25%，且不得超过本计划资产净值的25%。本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的25%，也不得超过该资产的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。</p> <p>（7）本集合资产管理计划不得直接投资商业银行信贷资产；也不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保。</p> <p>（8）本集合资产管理计划不得投资于将资管/信托产品或其收/受益权作为底层资产的资产支持证券或资产支持票据。</p> <p>（9）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。</p> <p>本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。</p>
	<p>风险 收益 特征 及适 合推 广对 象</p>	<p>本计划属于R2风险等级的证券投资产品。适合向风险承受能力C2及以上的投资者推广。</p>
<p>当 事 人</p>	<p>管理 人</p>	<p>首创证券股份有限公司</p>
	<p>托管 人</p>	<p>平安银行股份有限公司北京分行</p>
	<p>推 广</p>	<p>指首创证券股份有限公司及其他符合相应资格条件的、经管理</p>

	机构	人委托的、代理推广本集合资产管理计划的机构。
集 合 计 划 的 参 与	办 理 时 间	<p>(1) 推广期参与</p> <p>在推广期内，投资者在工作日内可以参与本集合计划。如本集合计划在推广期内参与金额或人数达到发行公告上限，可提前终止推广期。管理人在推广期内使用“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。</p> <p>(2) 存续期参与</p> <p>本集合计划投资者在集合计划的开放期的第一个工作日可办理退出本集合计划的业务，具体安排以管理人公告为准。</p>
	办 理 场 所	推广机构指定的推广营业网点。
	参 与 原 则 、 程 序	<p>1、参与的原则</p> <p>(1) 采用金额参与的方式，即以参与金额申请；</p> <p>(2) 推广期参与价格以人民币 1.00 元为基准进行计算份额；存续期开放申购日内集合计划参与价格以申请当日的单位净值为基准进行计算。</p> <p>(3) 本集合计划份额参与金额或参与人数不超过每次发行公告上限。管理人使用“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对集合计划每次参与规模和人数实行限量控制。</p> <p>(4) 委托人参与本集合计划，应当是合格投资者。</p> <p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：</p> <p>(1) 具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；(2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；(3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；(4) 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；(5) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者(QFII)、人民币合格境外机构投资者(RQFII)；</p> <p>(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> <p>2、参与的程序和确认</p> <p>(1) 投资者按推广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>(3) 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有效，构成本合同的有效组成部分；</p> <p>(4) 投资者参与申请确认后，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>
	参与费	<p>(1) 参与费率：本集合计划无参与费</p> <p>(2) 参与份额的计算方法：</p> <p>①推广期参与 参与份额 = (参与金额 + 参与资金利息) ÷ 计划单位面值</p> <p>②存续期参与 参与份额 = 参与金额 ÷ 参与日计划单位净值</p> <p>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>
	参与资金利息	委托人的参与资金在推广期产生的利息按照银行同期活期存款利率计算，并将折算为计划份额归委托人所有，其中利息以注册登记机构的记录为准。
集合计划的退出	办理时间	本集合计划投资者在集合计划的开放期的第一个工作日可办理退出本集合计划的业务，具体安排以管理人公告为准。
	办理场所	首创证券股份有限公司及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本集合资产管理计划的机构。
	退出的原则	<p>(1) 集合计划各份额的退出采取“未知价”原则，即退出集合计划的价格以集合计划单位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。</p>
	办理方式、程序	<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推广机构规定的手续，向集合计划推广机构提出参与或退出的申请。退出申请，委托人需于 T-5 日前向推广机构提交预约退出材料，管理人有权拒绝未预约退出的退出申请。</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）之后到推广机构取得 T 日退出申请成交确认单。</p>
	退出	委托人的退出申请确认后，退出款项将在 T+5 日内从托管账户

款项划付	划出。
退出费用	本集合计划无退出费。
退出金额的计算方法	<p>委托人在开放日退出本计划，管理人根据计划单位份额净值计算其退出金额。</p> <p>退出金额=退出份额×T日集合计划单位份额净值（扣除业绩报酬及分红后）</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>
收取方式	本集合计划无退出费用，不存在退出费用的收取。
退出的限制与次数	<p>集合计划份额持有人持有的集合计划资产净值高于30万元时，可以选择部分退出集合计划份额，集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于30万元。集合计划份额持有人申请退出集合计划份额时，其持有的集合计划资产净值低于30万元的，必须选择一次性退出全部集合计划份额，集合计划份额持有人没有一次性全部退出持有份额的，管理人将该集合计划份额持有人所持份额做全部退出处理。</p>
单个委托人大额退出	<p>(1) 单个委托人大额退出的认定</p> <p>对单个委托人单日退出份额超过上一工作日计划总份额数的10%时，即视为单个委托人大额退出。如果大额退出情况触发巨额退出条件，按照巨额退出进行认定和处理。</p> <p>(2) 单个委托人大额退出的申请和处理方式</p> <p>委托人必须提前5个工作日直接或通过销售机构向管理人预约申请；大额退出未预约申请，管理人有权拒绝接受其退出申请。</p>
巨额退出	<p>(1) 巨额退出的认定</p> <p>单个开放日，委托人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20%时，即为巨额退出。</p> <p>(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>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：</p> <p>全额退出：当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时，按正常退出程序办理。</p> <p>部分顺延退出：当管理人认为支付委托人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</p>

		<p>比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，委托人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份额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。</p> <p>(3) 告知客户的方式</p> <p>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。</p>
	连续巨额退出	<p>(1) 连续巨额退出的认定</p> <p>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。</p> <p>(2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>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。</p>
	拒绝或暂停退出的情形及处理	<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) 不可抗力的原因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) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，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或其他在说明书、资产管理合同中已载明且中国证监会无异议的特殊情形。</p>
	管理人自有资金参与情况	<p>管理人可选择以自有资金参与本集合计划份额。</p> <p>(1) 自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。</p> <p>(2) 自有资金参与的金额和比例：自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 50%。</p> <p>(3) 自有资金退出的条件：管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于 6 个月。</p>

	<p>(4) 因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限时处理原则及处理措施：因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限时，管理人在满足持有期限要求且约定责任解除后，管理人将在5个工作日内公告退出安排。</p> <p>(5) 信息披露：管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前5个工作日通过管理人网站公告。</p> <p>(6) 自有资金责任承担方式和金额：管理人自有资金参与的享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。</p> <p>(7) 收益分配以管理人的公告为准。</p>
<p>集合计划的预警、止损</p>	<p>无</p>
<p>集合计划的分类、分级</p>	<p>本集合计划不进行分类，亦不进行分级。</p>
<p>利益冲突及关联交易</p>	<p>1、存在或可能存在利益冲突的情形</p> <p>(1) 集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券。</p> <p>(2) 集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。</p> <p>(3) 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参与本集合资产管理计划的，管理人应当向投资者进行披露，对该资产管理计划账户进行监控，并及时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>2、存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率</p> <p>(1) 存在利益冲突的处理方式</p> <p>集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。</p> <p>集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。</p>

	<p>集合计划投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意本集合计划将进行上述关联交易。管理人从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益，且应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>集合计划份额持有人不得因本集合计划投资收益劣于集合计划管理人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向集合计划管理人或集合计划托管人提出任何损失或损害补偿的要求。</p> <p>(2) 发生利益冲突情形信息披露的方式</p> <p>本集合计划发生利益冲突情形的信息披露将严格按照《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他规定进行。</p> <p>本集合计划包含利益冲突情形的定期报告和临时报告等有关集合计划的信息将在管理人网站上披露，委托人可随时查阅。</p> <p>管理人网站：www.sczq.com.cn</p> <p>(3) 发生利益冲突情形信息披露的内容和时间</p> <p>1、定期报告</p> <p>定期报告包括集合计划份额净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、年度审计报告。</p> <p>发生利益冲突情形需在集合计划的资产管理季度（年度）报告进行信息披露。</p> <p>2、临时报告</p> <p>本集合计划运用受托管理资产从事关联交易的，应当于签订交易协议后 10 个工作日内（无交易协议的，自事项发生之日起 10 个工作日内），按照规定在管理人网站发布信息披露公告。</p> <p>本集合计划未聘请投资顾问，不存在与投资顾问之间存在利益冲突情形。</p>
<p>集合计划成立的条件、日期</p>	<p>集合计划的参与资金总额（含参与费）不低于 1000 万元人民币且其委托人的人数为 2 人（含）以上，并经管理人聘请的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后，管理人宣布本集合计划成立。</p> <p>集合计划设立完成前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。</p>
<p>集合计划设立失败</p>	<p>集合计划初始募集期结束，在集合计划初始募集资金总额（不含参与费）低于中国证监会规定的集合资产管理计划最低募集规模（即人民币 1000 万元）或委托人的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败。管理人需以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并将已认购资金及银行同期活期存款利息在初始募集期结束后 30 日内退还集合计划委托人。</p>
<p>集合计划</p>	<p>1、条件：本集合计划公告成立。</p>

<p>开始运作的条件和日期</p>	<p>2、日期：本集合计划自成立之日起开始运作。</p> <p>管理人发起设立集合资产管理计划后 5 日内，应当将发起设立情况报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送证券公司住所地所在地中国证监会派出机构。</p>	
<p>集合计划份额转让</p>	<p>集合计划存续期间，经管理人同意后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集合资产管理计划份额，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。</p> <p>转让后，持有资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。受让方首次参与集合计划，应满足合格投资者的条件。转让完成之日，受让人即自动成为本合同当事人，享有合同项下相关权利义务。</p>	
<p>费用、业绩报酬</p>	<p>费用种类</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1、管理人的管理费和业绩报酬 2、托管人的托管费 3、证券交易费用 4、证券账户开户费 5、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用 6、本集合计划成立后的会计师费和律师费 7、按照国家有关规定可以列入的其他费用
	<p>集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p>	<ol style="list-style-type: none"> 1、托管人托管费计提和支付： 本集合计划托管人托管费按前一自然日集合计划资产净值的 0.05% 年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div 365$ H 为每日应支付的托管费； E 为前一自然日集合计划资产净值。 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划款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。 2、管理人管理费计提和支付： 本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为 0.7%。计算方法如下： $H = E \times 0.7\% \div 365$ H 为每日应计提的集合计划管理费 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划款指

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。

3、业绩报酬的计提和支付：

(1) 管理人核算业绩报酬的原则：

在本集合计划存续过程中，业绩报酬计提日可以为本集合计划收益分配日（以管理人的分红公告为准）、投资者退出时、计划开放日、临时开放日或本集合计划终止日。以上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日）至本次业绩报酬计提日的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准，按照业绩报酬计提基准以上部分的 60%提取业绩报酬，具体提取方式如下：

$$R = \frac{A - B}{C} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

其中，A 为业绩报酬计提日的累计单位净值；

B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；

C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为上一业绩报酬计提日与本次业绩报酬计提日间隔天数。若管理人于某个业绩报酬计提日未实际计提业绩报酬（即业绩报酬为 0），则该日仍然作为管理人下一次业绩报酬计提起始日。

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬计提方法
R ≥ 业绩报酬计提基准	60%	H = 【R - 业绩报酬计提基准】 × 60% × C × F × D / 365
R < 业绩报酬计提基准	0	H = 0

注：F 为提取业绩报酬的份额

由于涉及注册登记数据，由管理人计算，托管人不承担复核责任。

管理人收取业绩报酬按委托人参与份额计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

管理人业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，但因投资者退出集合计划提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

(2) 业绩报酬的支付

每个自然季度起 10 个工作日内或产品终止时，管理人有权全额提取当期计提的业绩报酬，具体以管理人安排和计算为准。支付时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时，支付日期顺延。

业绩报酬的计算和复核由管理人完成。托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。

		<p>4、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。</p> <p>5、审计费用： 本集合计划的年度审计费用，按管理人与会计师事务所确定的金额，审计费用按年度一次性计提。</p> <p>6、注册登记费： 本集合计划成立后的注册登记费用由计划承担，收费标准按照中国证券登记结算有限责任公司公布费率执行，管理人在收到缴费通知单后按照份额登记机构要求进行费用支付。</p> <p>7、其他费用： 本集合计划成立后的信息披露费用、会计师费、律师费和银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由管理人本着保护委托人利益的原则，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。</p>
	不列入集合计划费用的项目	集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关的费用，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的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	收益构成	收益包括:集合计划投资所得债券利息、红利、股息、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。
	可供分配利润	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。
	分配条件、原则	<p>(1) 每一集合计划份额享有同等的收益分配权，若收益分配基准日可供分配利润大于0,管理人可以视情况选择进行收益分配；</p> <p>(2) 在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，由管理人拟定分红方案进行收益分配，分配比例不超过收益分配基准日全部可分配利润的100%；</p> <p>(3) 集合计划收益分配日的每份额净值减去每份额分红金额后不能低于集合计划份额面值；</p> <p>(4) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；</p>

	收益分配方案的确定与披露	本集合计划收益分配方案由管理人拟定，由管理人报告委托人。管理人应在指定网站提前公告收益分配方案。
	分配方式	本集合计划的分红方式为现金分红，管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令将收益分配划入注册登记机构，注册登记机构将收益分配款划入相应推广机构结算备付金账户，由推广机构划入委托人的交易账户，现金红利扣除管理人业绩报酬后在 T+7 日内划转到委托人的交易账户。
集合计划展期		<p>1、展期的条件</p> <p>(1) 在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反《集合资产管理合同》、《说明书》的约定；</p> <p>(2) 展期没有损害委托人利益的情形；</p> <p>(3) 托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；</p> <p>(4) 展期后符合本集合计划的成立条件；</p> <p>(5) 中国证监会规定的其他条件。</p> <p>2、展期的安排</p> <p>(1) 通知展期的时间</p> <p>在集合计划到期前 7 个月。</p> <p>(2) 通知展期的方式</p> <p>管理人拟定展期方案，经托管人确定后，管理人将通过管理人网站、邮件或者短信等方式通知委托人。</p> <p>(3) 委托人回复的方式</p> <p>委托人应当在 5 个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确意见。</p> <p>3、委托人不同意展期的处理办法</p> <p>若委托人明确表示不同意展期，委托人有权在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续。若不同意展期的委托人未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续，管理人将对此类委托人进行强制退出。委托人回复意见不明确或不回复意见的，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。</p> <p>4、展期的实现</p> <p>如果同意集合计划展期的委托人户数不少于 2 户，则集合计划存续期将依法展期；如果同意本集合计划展期的各委托人户数低于 2 户则集合计划到期终止，将按照《集合资产管理计划管理合同》等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。</p>
终		(一) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：

止 和 清 算	<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，而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，而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，而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，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的；</p> <p>5、在不违反法律法规规定不损害委托人权益的前提下，经管理人认为有必要终止集合计划的，经全体投资者、管理人和托管人协商一致，可提前终止集合计划；</p> <p>6、集合计划存续期间，持续5个工作日投资者少于2人；</p> <p>7、资产管理计划存续期届满且不展期；</p> <p>8、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；</p> <p>9、不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；</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>(二) 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、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>4、清算结束后15个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户；</p> <p>5、清算结束后15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；</p> <p>6、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</p>
------------------	--

	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本合同的约定，以货币形式全部分配给委托人。
特别说明	本说明书是集合资产管理合同的重要组成部分，与管理合同具有同等法律效力。本说明书如与《管理合同》不一致，以《管理合同》为准。