

东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划说明书（第三版）

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《运作规定》）、《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划管理合同（第三版）》（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。

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《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《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	东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划
	类型	混合类集合资产管理计划。本计划为基金中基金资产管理计划（FOF）
	管理期限	本集合计划管理期限为自本计划成立之日起 10 年，可展期。
	募集期间	本集合计划自份额发售之日起 60 日内完成集合计划的初始募集活动，具体时间见有关公告。管理人可以根据实际情况提前结束初始募集期。
	封闭期	本计划除开放期（包括临时开放期）外均为封闭期，原则上封闭期内不办理参与、退出业务。
	开放期	本计划成立后，每周第一个交易日为参与开放日，开放申购；每月的最后一个交易日为退出开放日，开放赎回。本计划开放赎回采用预约机制，退出开放日当天不接受赎回申请。委托人应按照本计划合同约定的退出程序，在退出开放日前三个交易日之前提前申请退出。管理

	人有权拒绝委托人对于处于锁定期内份额的退出申请。
临时 开放 期	本计划管理人自有资金参与比例超标或本合同发生变更（或展期）时，管理人有权设置临时开放期，退出管理人自有资金使其参与比例符合本合同约定，保障合同变更异议投资者退出的权利，临时开放期的设置以届时管理人发布的公告为准。
份额 面值	人民币 1.00 元。
最低 金额	单个委托人首次参与的最低金额为人民币 40 万元（不含认购费/申购费） 。对于已经是本计划的持有人，其追加参与资金金额最低为人民币 1 万元 ；将红利再投资本计划的份额不受上述限制。
投 资 范 围、 投 资 比 例 及 投 资 限 制	<p>1、投资范围</p> <p>本资产管理计划属于混合类 FOF 集合资产管理计划，可投资范围如下资产：</p> <p>（1）现金类资产：现金、债券逆回购、银行存款、同业存单、货币市场基金；</p> <p>（2）权益类资产：包括在国务院同意设立的交易场所交易的上市公司股票；</p> <p>（3）固定收益类资产：包括国内依法发行的国债、企业债、公司债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、非公开发行的公司债、永续债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、短期融资券、中期票据、非金融企业债务融资工具；</p> <p>（4）商品及金融衍生品类资产：包括国债期货、股指期货、商品期货、商品期权、上海证券交易所股票期权合约；</p> <p>（5）资产管理产品：包括券商集合资产管理计划、基金公司及其基金子公司发行的资产管理计划、期货公司发行的资产管理计划、保险资产管理计划；还可以投资于证券投资私募基金、公募基金（含封闭式及开放式证券投资基金、ETF、LOF 基金）。</p> <p>（6）参与债券正回购。</p> <p>如法律法规或监管机构新增允许集合资产管理计划投资其他资产，在管理人、委托人和托管人协商一致并签署补充协议后，可以将</p>

新增资产纳入投资范围。

2、集合计划投资组合比例：

(1) 按照穿透原则合并计算，投资于固定收益类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 80%；

(2) 按照穿透原则合并计算，投资于权益类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 80%；

(3) 按照穿透原则合并计算，投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不超过资产管理计划总资产的 80%；

(4) 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合计不低于 80%；

(5) 本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%。本集合计划投资于资产管理产品时，计算本集合计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

本集合计划投资于除公募基金外资产管理产品时，本集合计划按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合法律法规、监管规则的相关规定。

因证券市场波动、上市公司合并、本计划规模变动等资产管理人之外的因素致使本计划投资不符合上述规定的比例，资产管理人应当在 15 个交易日内调整完毕。

上述投资比例和投资限制，如涉及穿透核查或穿透合并计算的，管理人应当于每月初 5 个工作日内通过邮件方式（托管人的邮箱地址为 custody@nbc.cn；custody-audit@nbc.cn）向托管人提供本资产管理计划所投资其他资产管理产品的估值表和净值数据等核查信息，托管人仅根据管理人提供的数据进行复核，并根据管理人提供的数据按月进行投资监督。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。由于底层数据材料的提供频率、脱敏处理、可披露程度等原因导致托管人实际监督范围受限的，由此造成的后果由管理人承担。如本资产管理计划所投资其他资产管理产品披露组合的频率发生变化的，由托管人及管理人协商一致后进行调整。涉及证券投资基金穿透监控的，以最近 1 个季度证券投资基金定期披露的报告为

准。

(3) 投资限制

1) 本集合计划投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。

2) 本集合不投资任何资产管理产品劣后级；

3) 本集合计划投资的资产管理产品不得投资于非标准化债权及非标准化股权类资产。

4) 本集合计划投资于同一资产（同一资产指单只股票/单只债券）的资金不超过本集合计划资产净值的 25%，银行活期存款、国债、中央银行票据等中国证监会认可的投资品种除外。

5) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。

(4) 禁止行为

1) 违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；

2) 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；

3) 直接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域；

4) 向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；

5) 挪用集合计划资产；

6) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；

7) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；

8) 使用集合计划资产进行不必要的交易；

9) 内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；

10) 为其他机构、个人或者的资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道服务；

11) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为；

托管人发现管理人的投资运作不符合本合同约定的投资比例限制时，应当提示管理人及时纠正，管理人收到提示后应及时核对，并以书面形式向托管人进行解释或举证。

	<p>托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。对管理人的违规事项，托管人应报告管理人注册地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会。</p>
<p>投资策略</p>	<p>1、决策依据</p> <p>本计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护集合计划委托人利益作为最高准则，具体决策依据包括：</p> <p>(1) 国家有关法律法规、《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、本合同和说明书等有关法律性文件；</p> <p>(2) 宏观经济走势、财政政策和货币政策的调整及汇率、利率变化趋势；</p> <p>(3) 投资对象预期收益和预期风险的匹配关系。</p> <p>2、决策程序</p> <p>严格、明确的投资流程是本集合计划控制投资风险，进行组合投资的制度保障。本计划采取资产管理总部投资决策小组领导下的投资经理负责制，具体为在资产管理总部投资决策小组对集合计划投资组合做出战略性资产配置等重大决策；投资经理在投资决策小组对投资组合和具体投资品种提出投资建议的前提下，根据资产管理总部投资决策小组的决议进行战术性的投资操作和组合构建，最后，资产管理总部设有风控专员，风控专员对集合计划投资组合进行绩效和风险评估。具体如下：</p> <p>(1) 资产管理总部投资决策小组总体上指导投资管理工作</p> <p>资产管理总部投资决策小组负责对本计划的投资决策进行审核，确保本集合计划不存在重大法律和政策障碍，确保本集合计划可行、有效，并根据市场行情对可能出现风险进行评估，确保本集合计划的安全、合规。</p> <p>资产管理总部投资决策小组由资产管理总部负责人，投资总监及相关投资人员组成，风控专员列席，以及委员认为有必要邀请相关人员。</p> <p>(2) 资产管理总部投资决策小组制定战略性资产配置等重大决策</p> <p>资产管理总部投资决策小组通过定期和不定期的会议，对宏观经</p>

济形势、利率走势、微观经济运行环境和证券市场走势等进行综合分析，确定集合计划的下一阶段的资产配置比例，即权益类、固定收益类、基金、现金等的投资比例；根据产品的风险收益特征，对投资经理提出的投资策略和投资方案进行审核、批复；制定其他重大投资决策。

(3) 投资经理在对资产管理总部投资决策小组出具的研究报告和投资建议深入探讨的基础上，进行战术性组合配置及优化。

资产管理总部投资决策小组在对不同资产的研究基础上，按照一定的定价、估值标准等情况，出具宏观经济分析、投资策略、股票、债券分析等各类报告和投资建议，筛选出预期收益较好的证券，为投资经理提供决策依据。

投资经理在遵守投资决策小组制定的战略性配置原则的前提下，确定战术性的投资策略，包括通过研究当时的市场、利率政策、利率环境、行业和股票情况、具体债券的动态变化情况，通过对投资池内的证券进行检验，考虑其的流动性、相关市场信息等，根据资产配置原则和市场风险分析，构建投资组合。制定证券投资的具体操作方案，并运用现代的组合管理技术，提高投资组合的风险回报率。

(4) 资产管理总部风控专员进行风险监控及绩效评估

资产管理总部设有风控专员，风控专员对集合计划的日常运作进行风险监控和绩效评估。具体内容包括：一方面，对集合计划运作过程中各风险指标进行日常监控与管理，跟踪投资组合风险和流动性风险等指标，提出风险控制意见。另一方面，对集合计划的市场风险和流动性风险等因素做好定期的压力测试。集合计划管理人在确保投资者利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理流程做出调整。

3、投资管理的方法和标准

(1) 资产配置策略

管理人在深入的研究分析基础上，根据市场情况和可投资品种的含量，综合市场资金面走向、各类资产的收益率水平、流动性特征等，确定各类资产的配置比例。

(2) 固定收益类资产投资策略

①利率品种的投资策略：产品对国债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后，对债券的期限结构进行分析，选择合适的期限结构的配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。

②债券回购投资策略：基于对资金面走势的判断，选择回购品种和期限。若在判断资金面趋于宽松的情况下，优先进行相对较长期限逆回购配置；反之，则进行相对较短期限逆回购操作。

③信用品种的投资策略：管理人通过建立“内部信用评级体系”对市场公开发行的短期融资券、中期票据、企业债、公司债等信用品种进行研究和筛选，形成信用债券投资备选库。在此基础上，结合本集合计划的投资与配置需要，通过对到期收益率、剩余期限、流动性特征等进行分析比较，挑选适当的信用品种进行投资。

(3) 权益类资产投资策略

本计划针对权益类资产将坚持行业配置与个股选择相结合的策略。管理人将动态监测行业投资价值的变化，使行业资产配置效率优于行业平均。在个股方面，将结合投资经理以及研究团队依托内外部研究资源对公司的成长性、治理结构、行业地位等基本面做出的综合分析，挑选出符合标准的具有较高成长潜力的股票进行投资。对于权益类资金，将根据对基金公司、基金投资特点、基金经理管理能力等因素综合判断，以选择出长期业绩优良的基金进行投资。另外，可以阶段性根据行业和个股的判断选择与当时市场环境相匹配的基金进行波段操作。

(4) 资管产品投资策略

本计划对各类资产管理产品进行精选，从收益-风险平衡、历史情景压力测试、投资经理个人特征三个维度评价资产管理机构的超额收益创造能力，选取策略和管理能力优秀的资产管理机构发行的资产管

理产品。

(5) 现金类管理工具投资策略

本集合计划将投资于现金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金、债券逆回购、到期日在1年内（含1年）的央行票据等高流动性短期金融产品等现金类资产来保障资产的安全性和流动性。

(6) 金融衍生品投资策略

① 股指期货对冲策略

本集合计划投资股指期货的主要目的是回避市场风险和实施套利策略。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益或获取低风险套利收益。另外，管理人在控制风险的前提下也会进行少量的投机交易，以更好地提高产品收益。

② 套期保值策略

在符合一定条件的市场环境中，有必要审慎灵活地综合运用金融衍生品进行套期保值交易来对冲系统性风险、降低投资组合波动性并提高资金管理效率。套期时将综合考虑：1) 交易品种的流动性；2) 交易品种与现货市场的相关度；3) 通过金融衍生品进行套期保值交易的必要性；4) 套期保值交易的综合成本，来判断是否进行套期保值交易或套期保值的合理对冲比率。

③ 套利交易策略

期现套利策略：当现货价格与期货的合理价格产生偏差，而此偏差又大于投资者同时参与现货市场和期货市场的交易成本时，投资者就可以进行跨现货市场和期货市场之间的套利交易，以赚取风险较小的利润。

跨期限套利策略：当同一品种的不同期限合约之间的差价暂时性偏离正常价差水平时，可以通过买入某一期限的合约同时卖出另一期限的合约，待合约价差回归到正常价差水平时再同时进行反向交易，从而获取套利收益。（3）**跨品种套利**是指在买入或卖出某种合约的同时，卖出或买入相关的另一种合约，当两者的差价收缩或扩大至一定

	<p>程度时，平仓了结的交易方式。套利技术基于定价理论、统计决策理论、博弈论、统计模式识别技术、事件序列分析方法、计量经济建模、现代计算方法等知识，是一种多学科的综合投资技术。</p> <p>④投机策略</p> <p>利用期货、期权的高杠杆特点，参与市场的波段操作，以期获得更高的收益。捕捉趋势，通过趋势指标，判断当前市场趋势，然后顺势建立头寸。</p> <p>4、投资策略的变更</p> <p>经委托人、管理人之间协商一致可对投资政策进行变更，变更投资政策应以书面形式做出并通知托管人。投资政策变更应为调整投资组合留出必要的时间。</p>
集合计划分级	本集合计划不设置分级。
风险收益特征	本集合计划的产品风险等级为 R4，仅适合向风险承受能力为 C4 及以上的合格投资者和所有符合中国证监会规定的专业投资者。委托人承诺并确认自身风险承受能力符合本集合计划的要求，自愿承担参与本集合计划投资所产生的全部风险。
预警和止损	本集合计划运行预警线为 0.75 元、止损线为 0.70 元。
适合推广对象	<p>本计划的产品风险等级为 R4，仅适合向风险承受能力为 C4 及以上的合格投资者和所有符合中国证监会规定的专业投资者推介。委托人承诺并确认自身风险承受能力符合本计划的要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。</p> <p>合格投资者指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额（金额按照《指导意见》等相关法律法规要求确定）且符合下列条件的自然人、法人或其他组织：</p> <p>（一）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，</p>

		<p>或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；</p> <p>(二) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；</p> <p>(三) 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；</p> <p>(四) 基本养老保险、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>(五) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p>
当 事 人	管 理 人	<p>东方财富证券股份有限公司</p> <p>法定代表人：戴彦</p> <p>住所：上海市宛平南路 88 号金座</p> <p>通讯地址：上海市宛平南路 88 号金座</p> <p>邮政编码：200032</p> <p>联系人：张敏</p> <p>联系电话：021-23586802</p>
	托 管 人	<p>宁波银行股份有限公司</p> <p>法定代表人：陆华裕</p> <p>通信地址：宁波市鄞州区宁东路 345 号</p> <p>邮政编码：315000</p> <p>公司网站：www.nbcb.cn</p> <p>联系电话：0574-83895886</p> <p>联系人：徐银央</p>
	投 资 顾 问	无
	委 托	<p>1、委托人的权利</p> <p>(1) 分享集合计划财产收益；</p>

<p>人 的 权 利 和 义 务</p>	<p>(2)按照法律法规及本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;</p> <p>(3)按照本合同及说明书的约定,参与和退出集合计划,转让集合计划份额;</p> <p>(4)按持有份额取得集合计划清算后的剩余资产;</p> <p>(5)因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的,有权得到赔偿;</p> <p>(6)根据本合同的约定,参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会,行使相关职权;</p> <p>(7)监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况;</p> <p>(8)法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及说明书约定的其他权利。</p> <p>2、委托人的义务</p> <p>(1)委托人应认真阅读本合同及说明书,保证以真实身份参与集合计划,并承诺委托资金的来源及用途合法,向管理人或销售机构如实提供财务状况及投资意愿等基本情况;不得使用贷款、发行债券等筹集的资金参与集合计划;</p> <p>(2)委托人应积极配合管理人或销售机构对委托人、实际投资者(如有)及最终资金来源的审查,不得非法汇集他人资金参与本计划;</p> <p>(3)及时、全面、准确地向管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等情况,保守商业秘密,不得泄露资产投资计划、投资意向等;在向管理人、托管人提供的各种资料、信息发生变更时,应当在2个工作日内书面通知管理人、销售机构、托管人。</p> <p>(4)按照本合同及说明书约定缴纳委托资金,承担本合同约定的管理费、托管费、税费和其他费用;</p> <p>(5)按照本合同及说明书约定承担集合计划的投资风险和损失;</p> <p>(6)不得违规转让其所拥有的集合计划份额;</p> <p>(7)委托人应当以自己的名义开立资金账户,办理指定手续,用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。委托人承诺在本合同有效期内,不得撤销该账户,并妥善保管账户资料;</p> <p>(8)接受合格投资者认定程序,如实填写风险识别能力和风险承担能</p>
--	---

		<p>力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；</p> <p>(9) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；</p> <p>(10) 认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(11) 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；</p> <p>(12) 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；</p> <p>(13) 向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；</p> <p>(14) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；</p> <p>(15) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；</p> <p>(16) 法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及说明书约定的其他义务。</p>
	销售机构	<p>东方财富证券股份有限公司以及其他具有基金销售资格并与管理人签订代销协议的销售机构。</p>
集	办理时间	<p>(1) 初始募集期参与</p> <p>在初始募集期内，投资者在工作日内可以参与本计划。本计划的初始募集期最长不超过 60 天。如本集合计划在初始募集期内参与金额达到 1000 万元且委托人不少于 2 人时，管理人可提前终止初始募集期。</p> <p>(2) 存续期参与</p> <p>本集合计划存续期间，投资者可在参与开放期办理参与事宜。</p>
	办理场所	<p>销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的参与。</p>

合 计 划 的 参 与	参与 费	<p>(1) 参与费率</p> <p>认购费：初始募集期参与集合计划的参与费率为【1%】； 申购费：开放期参与集合计划的参与费率为【1%】。</p> <p>本计划的参与费采取【前端】收取模式。</p> <p>(2) 参与份额的计算方法</p> <p>参与本计划的参与费用【价外】收取，收费模式为【前端】收费模式（即参与集合计划时缴纳）。委托人的参与金额包括参与费用和净参与金额。参与金额在初始募集期间形成的利息归委托人所有，具体份额以注册与过户登记人的记录为准。参与份额的计算方式如下：</p> <p>净参与金额=参与金额÷（1+参与费率）</p> <p>参与费用=参与金额-净参与金额</p> <p>1) 初始募集期参与份额的计算：</p> <p>参与份额=（净参与金额+参与金额在初始募集期内产生的利息）/集合计划份额面值。</p> <p>2) 存续期参与份额的计算：</p> <p>参与份额=净参与金额/参与申请日份额单位净值。</p> <p>参与费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；参与金额在初始募集期内产生的利息按银行活期存款利率计算；参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的误差计入本集合计划资产损益。</p> <p>委托人多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。</p>
	参与 资金 利息	<p>委托人的参与资金在初始募集期产生的利息将折算为计划份额归委托人所有。</p>
集 合	办理 时间	<p>本集合计划存续期间，投资者可在退出开放期办理退出事宜。</p>
	办理 场所	<p>销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的退出。</p>
	退出	<p>委托人每次退出份额与退出次数无限制，退出后持有的集合计划份额</p>

计划的退出	限制	资产净值应大于或等于 40 万元人民币。如其该笔退出完成后剩余持有的集合计划份额资产净值低于 40 万元人民币时,则管理人自动将该委托人持有的全部剩余份额退还给委托人。								
退出金额及赎回费的计算		<p>1、退出费用： 申请退出本集合计划时须按退出份额的持有期限缴纳退出费，具体退出费率如下：</p> <table border="1" data-bbox="467 566 1305 741"> <thead> <tr> <th>份额持有期限 (D)</th> <th>退出费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$0 \leq D < 180$ 个自然日</td> <td>2%</td> </tr> <tr> <td>$180 \leq D < 360$ 个自然日</td> <td>1%</td> </tr> <tr> <td>$D \geq 360$ 个自然日</td> <td>0%</td> </tr> </tbody> </table> <p>退出费用由投资者承担，不计入资产管理计划财产。</p> <p>2、退出金额的计算方法 可退出金额 = 退出份额 × T 日集合计划份额净值 - 管理人业绩报酬 (如有) 退出费用 = 可退出金额 × 退出费率 退出净额 = 退出金额 - 退出费用 退出费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；退出净额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此产生的误差计入本集合计划资产损益。 委托人多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。</p>	份额持有期限 (D)	退出费率	$0 \leq D < 180$ 个自然日	2%	$180 \leq D < 360$ 个自然日	1%	$D \geq 360$ 个自然日	0%
份额持有期限 (D)	退出费率									
$0 \leq D < 180$ 个自然日	2%									
$180 \leq D < 360$ 个自然日	1%									
$D \geq 360$ 个自然日	0%									
管理人自有资金参与		<p>(一) 管理人自有资金参与情况 在满足《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》和本合同以及其他有关规定对自有资金参与的规定的的前提下，管理人可自主决定以自有资金参与集合计划。</p> <p>(二) 管理人自有资金参与、退出的条件和期限 在同时满足以下条件时，管理人自有资金可以参与、退出本集合计划： 1、管理人以自有资金参与集合计划的份额持有期限不得少于 6 个月； 2、管理人在存续期内以自有资金参与、退出集合计划时，应当提前 5 个工作日告知委托人和资产托管机构。 但为应对巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，</p>								

但需事后及时告知委托人和托管人。

(三) 自有资金参与的方式、比例与金额

管理人可以自有资金参与本集合计划，参与比例不得超过集合计划总份额（含管理人自有资金参与份额）的 16%；管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。因集合计划规模变动等客观因素导致管理人以自有资金参与本集合计划的总份额被动超过集合计划总份额的 16%，或管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计被动超过本计划总份额的 50%，管理人或管理人及其附属机构应及时退出部分或全部参与份额直至符合中国证监会规定及本合同约定。

(四) 管理人自有资金参与部分的收益分配

管理人自有资金参与份额与委托人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责任。

(五) 信息披露

管理人以自有资金参与和退出时，管理人应当提前 5 个工作日在管理人网站向委托人及托管人披露。

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，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出本计划可不受上述限制，但应及时告知委托人和托管人，并向管理人所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

(六) 风险揭示

1、管理人以自有资金参与本集合计划的份额，与其他委托人持有的同类份额享有同等权益、承担相同风险，且不对集合计划委托人承担任何补偿责任，也不对其他委托人的本金和收益构成承诺或担保。请投资者注意投资风险。

2、管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响集合计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注集合计划规模变动情况，控制流动性风险。

集合计划成立应当具备下列条件：

<p>集合计划成立的条件、时间</p>	<p>1、募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；</p> <p>2、初始募集规模不低于1000万元；</p> <p>3、委托人不少于2人（含）且不超过200人（含）；</p> <p>4、符合中国证监会规定以及本合同约定的其他条件。</p> <p>在集合计划募集金额缴足之日起十个工作日内，经管理人聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本计划进行验资并出具验资报告后，管理人公告集合计划成立。</p> <p>本集合计划成立的时间为管理人根据《管理办法》及相关法规规定发布集合计划成立公告的日期。</p> <p>在集合资产管理计划初始募集期间，管理人和销售机构必须将初始募集期间客户的资金存入注册与过户登记人开立的专门账户。在集合计划成立前，任何人不得动用集合资产管理计划的资金。</p>
<p>集合计划设立失败（本金及利息返还方式）</p>	<p>集合计划初始募集期结束，集合计划未达到上述集合计划成立条件的，或发生使集合计划无法设立的不可抗力事件，集合计划设立失败。</p> <p>本集合计划不成立时，管理人应当承担下列责任：</p> <p>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</p> <p>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。计息期间及利息金额以本计划注册与过户登记人的记录为准。</p>
<p>集合计划份额转让</p>	<p>本集合计划不接受份额转让，若开通份额转让功能，将以公告为准。如若开通份额转让功能，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，转让后投资者仍然持有计划份额的，其所持本计划资产净值应不低于 40 万元。</p> <p>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>
<p>费用</p>	<p>1、管理人的固定管理费</p>

费用、报酬	种类 (计 提 标 准、方 法、支 付 方 式)	<p>本计划应给付管理人固定管理费。</p> <p>管理人的固定管理费按前一日委托资产净值的 1%的年费率计提，具体计算方法如下：</p> $H = E \times 1\% \div 365$ <p>H 为每日应计提的固定管理费； E 为前一日集合计划资产净值。</p> <p>管理人的固定管理费每日计提，逐日累计，每自然季度支付一次。经资产管理人和资产托管人核对后，由资产托管人根据管理人的划款指令于每个自然季度的次月首日起五个工作日之内从委托资产中一次性支付给资产管理人。若因法定节假日、休息日，或战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则顺延至情形消除后的首个工作日支付。</p> <p>管理费收款账户： 户名：东方财富证券股份有限公司 账号：033212 087820 00158 开户银行：农行上海大柏树支行 大额支付号：103290015043</p> <p>2、托管人的托管费</p> <p>本计划应给付托管人托管费，资产托管费按前一日委托资产净值的 0.02%的年费率计提，具体计算方法如下：</p> $H = E \times 0.02\% \div 365$ <p>H 为每日应计提的； E 为前一日集合计划资产净值。</p> <p>托管人的托管费每日计提，逐日累计，每自然季度支付一次，由托管人于下一个自然季度首日起5个工作日内依据管理人划款指令从本计划资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>托管费收款账户： 开户名称：资产托管费待划转 开户行：宁波银行股份有限公司</p>
--------------	---	--

账号：11070126102000013

支付行号：313332082914

3、证券交易费用

本计划应按规定比例在发生证券交易时计提并支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金、基金（含公募基金、证券投资私募基金、资产管理计划）申购赎回费等税费，作为交易成本从本计划资产中直接扣除。

本计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已扣除证券结算风险基金），其费率由管理人根据有关政策法规确定，并在发生证券交易时按每笔成交金额计提。在每季度首日起 10 个工作日内支付给提供交易单元的券商。

4、集合计划注册登记费用

集合计划注册登记费用按有关规定列支。

5、与本计划相关的审计费；

在存续期间发生的集合计划审计费用，在合理期间内摊销计入集合计划。

本计划的年度审计费，按与会计师事务所签订协议所规定的金额，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。

6、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、托管账户的账户维护费用、注册与过户登记人收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用、在存续期间及资产变现期间发生的集合计划信息披露费用、律师费、诉讼费、仲裁费、公证费、评估费、鉴定费和其他形式的资产处置和变现费，以及如果国家有关规定调整可以列入的其他费用在集合计划费用中按有关规定列支。

银行结算费用，在结算完成后一次计入集合计划费用。

银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间一次性计入费用。

开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、托管账户

	<p>的账户维护费用、注册与过户登记人收取的相关费用、在存续期间及资产变现期间发生的集合计划信息披露费用、律师费、诉讼费、仲裁费、公证费、评估费、鉴定费和其他形式的资产处置和变现费在发生时一次计入集合计划费用。</p> <p>管理人应根据银行间费用相关法律法规及本合同约定，将账户开户、结算管理等各项费用列入或摊入当期委托财产运作费用，经管理人和托管人核对无误后，由管理人授权后划付，管理人收到托管人通知后一个月内未授权划付的，由托管人从委托资产中扣划，无须管理人出具指令。委托人和管理人在此申明已了解委托资产投资会产生的银行间费用，并确保账户中有足够资金用于银行间费用的支付，如因托管账户中的资金不足以支付银行间费用影响到指令的执行，托管人不承担由此产生的损失和责任。如委托资产未起始运作，由管理人在收到托管人的缴费通知后完成支付，托管人不承担垫付费用义务。与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。</p> <p>上述计划费用中第4至6项费用由管理人根据相关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付。</p>
不列入计划费用的项目	<p>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，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，以及处理与本计划运作无关的事项发生的费用等不列入本计划费用。</p>
	<p>管理人和托管人与委托人协商一致后，可根据市场发展情况调整管理费率、托管费率、费用支付时间及方式。若根据本合同约定本合同提前终止的，则按资产托管实际天数计算管理费和托管费，并于本计划的期限届满之日支付管理人及托管人应收未收的管理费和托管费。</p>
税收支出	<p>委托资产运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。</p> <p>针对法律法规的变化，管理人将按照相关法律法规要求执行。委</p>

	<p>托资产运作过程中涉及各纳税主体，其纳税义务按税收法律法规执行。在委托财产管理、运用及处分过程中依法发生的税费，如法律法规规定由资产管理人代扣代缴的，资产管理人有权代扣代缴。如法律法规规定本计划运营过程中发生的增值税应税行为等应税行为，以本计划管理人为增值税纳税人，除本计划已列明的资产管理业务费用产生的税费由各收款方自行缴纳外，管理人有权以计划财产予以缴纳，且无需事先征得委托人的同意，委托人不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。</p>
<p>管理人提取业绩报酬</p>	<p>在管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）计提日，管理人有权收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”），管理人将根据委托人持有的每笔委托份额期间收益率（R）情况收取业绩报酬。存续期间经委托人及托管人同意，管理人可根据市场情况调整业绩报酬计提基准。业绩报酬提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的60%。</p> <p>1、管理人收取业绩报酬的规则：</p> <p>（1）符合业绩报酬计提标准时，在业绩报酬计提日计提业绩报酬，提取频率不超过每6个月一次。（因投资者退出资产管理计划，管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。）</p> <p>（2）管理人将在以下三类业绩报酬计提日提取管理人业绩报酬： ①集合计划分红日；②委托人退出日和计划终止日；③固定时点提取：每自然年度的6月10日为固定业绩报酬计提日（如遇法定节假日则顺延至下一个交易日，本计划的固定业绩报酬计提日非本计划的开放日）；</p> <p>（3）集合计划分红日为业绩报酬的计提日，在集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。</p> <p>（4）委托人的退出日为业绩报酬的计提日，委托人退出（包括开放期退出和集合计划终止时退出）本计划时提取业绩报酬的，业绩报酬从委托人退出资金或清算资金中扣除。</p> <p>（5）固定时点为业绩报酬的计提日，以扣减份额的方式提取，管理人于业绩报酬计提日计算每一份额持有人每笔参与份额对应业绩报酬，以业绩报酬计提日计划份额净值为基数，折算得到需调减的委托</p>

人份额；具体为：第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬对应的应扣减份额=本计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的业绩报酬÷本计提日基金份额单位净值

(6) 业绩报酬收取对象为本计划的所有参与份额，具体提取方法见下述“2、业绩报酬计提标准”。

2、业绩报酬的计提标准：

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，委托人初始募集期参与的以集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期参与的以委托人参与确认当日为上一个业绩报酬计提日。如本集合计划存续期由于变更合同条款且涉及业绩报酬计提日调整的，以管理人届时的调整公告为准）到本次业绩报酬计提日的持有其未扣除业绩报酬的期间年化收益率（R），作为计提业绩报酬的基准。管理人提取业绩报酬按持有期末扣除业绩报酬的年化收益率（R）设置计提比例标准。

业绩报酬的具体计算及支付如下：

$$R = \frac{P_1^* - P_0^*}{P_0 \times D} \times 365 \times 100\%$$

$$\text{管理人业绩报酬 } Y = \begin{cases} 0, & \text{当 } R \leq 10\% \text{ 时} \\ (R - 10\%) \times 10\% \times G \times D / 365, & \text{当 } R > 10\% \text{ 时} \end{cases}$$

其中：

R 为本计划的收益率；

P_1^* 为本计划业绩报酬计提日的单位累计净值；

P_0^* 为本计划上一业绩报酬计提日的单位累计净值；

P_0 为本计划上一业绩报酬计提日的单位净值；

Y 为管理人应计提的业绩报酬；

G 为本计划委托人在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额；

D 为本计划上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的

		<p>天数；</p> <p>业绩报酬的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此带来的收益和损失归入计划资产。本计划于计划分红日（如有）、资产委托人退出日或本计划终止清算日计提业绩报酬。本计划于计划分红日（如有）、资产委托人退出日或本计划终止清算日计提业绩报酬。</p> <p>3、业绩报酬支付</p> <p>由于业绩报酬计算涉及注册登记数据，管理人业绩报酬的计算工作由管理人完成。业绩报酬在业绩报酬计提日计提并支付，由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人据此计提应付管理人业绩报酬。由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人应在收到指令的五个工作日内从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，支付日期顺延。管理人收取业绩报酬的账户同上述收取管理人的管理费账户。</p> <p>业绩报酬计提基准是基于本集合计划投资范围、配置策略及相应投资品种的投资研究做出的综合评估，仅供委托人参考，业绩报酬计提基准限用于计算管理人业绩报酬，并不是管理人对本集合计划产品业绩做出的承诺和保证，也不构成管理人对委托人保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。</p>
收益分配	收益的构成	<p>本计划收益包括：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。本计划净收益为本计划收益扣除按照有关规定及本合同约定可以在收益中扣除的费用后的余额。本计划存在日净收益为负值的可能。</p>
	可供分配利润	<p>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。</p>
	收益分配的条件	<p>当集合计划单位净值不低于1且有可分配收益时，管理人可以进行收益分配。</p>

收益分配原则	<ol style="list-style-type: none"> 1、每份集合计划份额享有同等分配权； 2、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配； 3、如果投资当期出现净亏损，则不进行收益分配； 4、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值； 5、在符合有关分红条件的前提下，管理人可根据本集合计划特点自行决定收益分配时间基准、次数、比例和时间等； 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。
收益分配对象	<p>分红权益登记日（在管理人公布的分配方案中确定）所有参与本集合计划的委托人。只有在分红权益登记日（不包括本分红权益登记日）前购入的计划份额，并在权益登记日当天登记在册的份额才有资格参加分红。</p>
收益分配时间	<p>在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，管理人可自行决定收益分配的时间。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、分红权益登记日：每次收益分配前，管理人在管理人网站上发布收益分配方案，在方案中确定分红权益登记日（R日）； 2、除息日：每次收益分配前，管理人在管理人网站上发布收益分配方案，在方案中确定除息日； 3、如委托人选择现金分红，现金红利于R+7日内划入委托人指定账户； 4、如委托人选择红利再投资，现金红利折算的集合计划份额按除息日当天净值转成相应的集合计划份额。红利再投资份额于R+3日内确认。
收益分配方式	<ol style="list-style-type: none"> 1、委托人可以选择收益分配方式为两种：现金分红和红利再投资； 2、委托人获得的现金分红或红利再投资份额保留到小数点后两位，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； 3、委托人未作选择的，按现金分红方式分配。如果选择红利再投资方式的，分红资金将按红利登记日的份额净值转成相应的份额。同一投资人持有的集合计划份额只能选择一种分红方式，如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，则注册登记机构将以投资人最后一

	<p>次选择的分红方式为准；</p> <p>4、除分红权益登记日外，委托人可在计划存续期内选择变更收益分配的方式；</p> <p>5、T日申购的计划份额不享有当日分红权益，自下一工作日起享有分红权益；T日赎回的计划份额享有当日分红权益，自下一工作日起不享有分红权益。</p>
收益分配比例	年度收益分配比例由管理人决定，具体详见分红公告。
收益分配的内容	收益分配方案须载明收益范围、净收益、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。
收益分配方案的确定与报告	本集合计划收益分配方案由管理人拟定，经托管人核实后由管理人报告委托人。管理人至少在R-5工作日之前（R为权益登记日）将收益分配方案向委托人公告。最终收益分配方案以管理人在管理人网站上披露的分红公告为准。
收益分配中发生的费用	收益分配选择红利再投资的，红利再投资的份额免收参与费；收益分配时发生的银行转账等手续费用由委托人自行承担，与收益分配、退出计划的相关税收按照国家有关规定处理。
收益分配的程 序	<p>1、管理人计算集合计划的可分配收益</p> <p>2、管理人确定分配红利的金额、时间</p> <p>管理人考虑集合计划的投资策略、现金流量和客户需求，在满足本部分规定的条件下确定收益分配的具体金额和具体时间。</p> <p>3、管理人制定收益分配方案</p> <p>收益分配方案包括集合计划可以分配的金额、分配的登记日（分</p>

	<p>红权益登记日) 和除息日、分配方式及其选择和修改、现金分红划款时间、红利再投资的确认日等, 至少提前 5 个工作日公告。</p> <p>4、计算分配金额</p> <p>管理人在除息日按当日可分配金额计算最终分红数额。</p> <p>5、管理人通知委托人</p> <p>管理人确定收益分配方案并经托管人确认后, 将收益分配方案在管理人网站上公布。最终收益分配方案以管理人网站上公布的分红公告为准。</p> <p>6、实施分配方案</p> <p>委托人选择现金分红方式的, 管理人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指定账户。托管人仅依据合同约定及管理人指令, 对收益分配方案中的收益范围、分配方式、分配金额等要素进行核对。若划至推广机构统一分配, 托管人对于收益分配方案的复核内容仅限于对收益分配的总金额进行复核, 对于在不同投资者之间分配的金额、分配顺序不承担复核义务, 托管管理人不对应对向受益人划转资金本息的及时性、准确性负责。</p> <p>委托人选择红利再投资的, 管理人于 R+3 日内将转换份额计入委托人所持份额总额。</p>
<p>风险 承担 安排</p>	<p>管理人、托管人确认, 已向委托人说明本集合计划的风险, 并不保证委托人资产本金不受损失或者取得最低收益; 委托人确认, 已充分理解本合同的内容, 并自行承担风险和损失。</p>
<p>信息披露</p>	<p>本计划的信息披露将严格按照《证券期货投资者适当性管理办法》、《基金募集机构投资者适当性管理实施指引(试行)》、《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》等相关法律法规的规定及本合同、计划说明书的约定进行。</p> <p>(一) 定期报告</p> <p>包括集合计划单位净值、集合计划季度(年度)报告、年度审计报告。</p> <p>1、集合计划单位净值。</p>

本计划实行净值化管理，净值的生成应当符合企业会计准则的规定，及时反映基础金融资产的收益和风险。本计划成立后，在存续期内管理人每周在管理人网站上公告经过托管人审核的上周最后一个工作日的集合计划单位净值、累计单位净值。期间如遇节假日顺延至下一工作日。

2、集合计划的季度报告。

管理人、托管人在每季度向委托人提供一次准确、完整的季度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况，包括但不限于：管理人履职报告；托管人履职报告；资产管理计划投资表现；资产管理计划投资组合报告；资产管理计划运用杠杆情况（如有）；资产管理计划投资收益分配情况；投资经理变更（如有）、投资管理人及管理人关联方管理的产品的情况（如有）、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项（如有）；资产管理计划支付的管理费、托管费、所投资资产管理产品产生的费用（如有）、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；中国证监会规定的其他事项。集合计划季度报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站公告，并由管理人报送中国证券投资基金业协会及管理人中国证监会相关派出机构。管理人应当在上述信息披露时限内将当期管理报告提供给托管人复核，并给托管人预留足够的复核时间，同时托管人应当办理与资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人和托管人可以不编制当期的季度报告。

3、集合计划的年度报告。

管理人、托管人在每年度向委托人提供一次准确、完整的年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况，包括但不限于：管理人履职报告；托管人履职报告；资产管理计划投资表现；资产管理计划投资组合报告；资产管理计划资产负债情况；资产管理计划财务会计报告；资产管理计划运用杠杆情况（如有）；资产管理计划投资收益分配情况；投资经理变更（如有）、投资管理人及管理人关联方管理的产品的情况（如有）、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项（如有）；资产管理计划支付的管理费、托管费、所投资资产管理产品产生的费

用（如有）、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；中国证监会规定的其他事项。集合计划年度报告应于每年度结束之日起四个月内通过管理人网站公告，并由管理人报送中国证券投资基金业协会及管理人注册地中国证监会派出机构。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人和托管人可以不编制当期的年度报告。

4、年度审计报告。

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起四个月内将审计报告报送中国证券投资基金业协会及管理人注册地中国证监会派出机构。

（二）临时报告

本计划在运作过程中发生下列法律法规规定或者本合同约定可能影响委托人利益的重大事项时，管理人应当在事项发生之日起五日内向委托人披露，披露方式可采用管理人网站披露或其他电子/书面形式的披露，并向管理人注册地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。临时报告的情形包括但不限于：

1、集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资经理发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生**重大影响的事项**；

- 2、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；
- 3、发生巨额退出并延期支付；
- 4、集合计划终止和清算；
- 5、集合计划资产的估值错误导致错误偏差达到计划资产净值的0.5%；
- 6、管理人以自有资金参与和退出；
- 7、合同的补充、修改与变更；
- 8、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- 9、负责本计划的代理销售机构发生变更；
- 10、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业

	<p>务资格；</p> <p>11、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>12、其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。</p> <p>当本计划出现本合同“风险揭示及其相应风险防范措施”部分中的有关情形时，集合计划管理人必须按照法律、法规及中国证监会的有关规定，在知晓该情形之日起两个工作日内在管理人网站上公布。</p> <p>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资产管理计划，应向投资者充分披露。</p> <p>(三) 委托人查阅</p> <p>集合计划说明书、集合资产管理合同文本和推介材料存放在各推介场所，委托人可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。对委托人按上述方式所获得的文件及其复印件，管理人和托管人保证与所通告的内容完全一致。</p> <p>(四) 信息披露方式</p> <p>集合资产管理定期报告及其他临时通告等信息披露文件放置于管理人网站，供委托人查阅。</p>
<p>集合计划的展期</p>	<p>(一) 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、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定以及本合同的约定；</p> <p>2、展期没有损害投资者利益的情形；</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、中国证监会规定的其他条件。</p> <p>集合资产管理计划展期的，应当符合集合资产管理计划的成立条件。</p> <p>(二) 展期的程序与期限</p> <p>1、展期的程序：</p> <p>(1) 展期的公告</p> <p>集合计划符合展期条件拟展期时，管理人于集合计划到期前3个月</p>

	<p>且不少于1个月期间内在管理人指定网站上公告，管理人将同时公告集合计划的具体展期方案。</p> <p>(2) 委托人答复</p> <p>管理人应在上述公告后15个工作日内通过管理人指定网站或以书面或电子邮件等方式将展期相关事宜通知委托人，征求委托人意见，委托人应根据管理人指定网站公告要求在规定的期限内明确意见。若委托人同意本集合计划展期，则委托人应根据管理人指定网站公告要求在规定的期限内重新签订资产管理合同。截至存续期届满日，委托人未给出明确答复的，视为不同意展期。</p> <p>(3) 不同意展期的委托人所持有份额的处理办法</p> <p>展期经管理人指定网站公告和书面通知委托人后，不同意展期的委托人，管理人保障委托人到期合法终止合同的权利，管理人将在本集合计划原存续期届满之日将该部分委托人份额全部退出，并分配收益。</p> <p>(4) 展期的成立</p> <p>存续期满，集合计划符合展期条件，并且同意本集合计划展期的委托人不少于2人，管理人将在存续期满后10个工作日之内公告本集合计划展期成立。</p> <p>(5) 展期的失败</p> <p>若集合计划展期失败，本集合计划将进入清算终止程序。</p> <p>2、展期的期限：管理人应在公告具体展期方案时确定展期的具体期限。</p> <p>(三) 展期情况备案</p> <p>本集合计划展期后5个工作日内，管理人将展期情况公告并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送注册地中国证监会派出机构。</p>
<p>利益冲突及关联交易</p>	<p>(一) 集合计划存在或可能存在的利益冲突情形</p> <p>本集合计划存在或可能存在利益冲突情形包括但不限于：</p> <p>1、管理人或将本计划资产投资于管理人、托管人及其控股股东、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，或者从事其他重大关联交易；</p> <p>2、管理人或将本计划资产投资于管理人、管理人关联方所设立的</p>

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、实际控制人或其他关联方均有权参与本计划；

5、管理人或将本计划投资于由管理人、托管人提供专业服务（包括但不限于作为投资顾问、财务顾问等）的金融产品；

6、其他可能产生利益冲突的情形。

（二）利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容及披露频率

管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，采取有效措施，做好充分的信息披露和利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范和管控可能的利益冲突。公平对待全体投资者，实现在公司、股东和员工个人的利益与投资者利益发生冲突时，优先保障投资者的利益，不同投资者之间的利益发生冲突时，公平对待不同投资者。

如发生利益冲突，管理人将按照内部规定处理，确保公平对待投资者，不损害投资者权益并及时向投资者披露。管理人运用受托管理资产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。

投资者在此同意并授权管理人可以将本合同项下的本计划财产投资于管理人、托管人及其控股股东、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，或者从事其他重大关联交易。管理人应于交易完成后5个工作日内通过管理人网站以公告方式告知委托人和托管人，并及时将关联交易结果向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。但如因托管人未按本合同约定向管理人提供其关联方名单以及相关的证券名单而导致管理人未向委托人履行告知和披露义务的，管理人不承担任何责任。

特别的，投资者在此同意并授权管理人可以将本合同项下的本计划财产部分或全部投资于由管理人、托管人、及其关联方（及其子公司等关联方）发行的金融产品，以及由管理人、托管人提供专业服务（包

	括但不限于作为投资顾问、财务顾问等)的金融产品。同时,投资者知晓并同意本资产管理计划投资的金融产品可能投资于管理人、托管人承销的各类证券。
风险揭示	参见管理合同“第【32】部分”或本集合计划风险揭示书。
终止和清算	<p>(一) 集合计划的终止</p> <p>集合计划的终止是指由于法定或者约定情形的出现,管理人终止运营并清算集合计划资产后,将集合计划剩余资产按一定标准返还给委托人,最终注销该集合计划的行为。</p> <p>本计划终止时,管理人和托管人应该遵照中国证监会相关规定或指示,采取必要和适当的措施,在扣除管理费、业绩报酬(如有)、托管费等费用后,将清算后的剩余资产,按照委托人持有集合计划份额占集合计划总份额的比例,以货币的形式分配给委托人。</p> <p>如果因任何原因托管人退出本计划或不能履行有关义务,管理人应立即寻找其他有资格的托管人进行替代,管理人应在尽可能短的时间内与新的托管人签署托管协议,并完成有关法律手续以确保新的托管人承担本计划项下的有关托管义务。委托人和管理人在此期间应继续履行本合同项下的有关义务。</p> <p>(二) 集合计划应当终止的情形</p> <p>如出现下列情形之一,本计划应当终止:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、集合计划存续期届满且未展期的; 2、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产,且在六个月内没有新的管理人承接; 3、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产,且在六个月内没有新的托管人承接; 4、存续期间,持续5个工作日投资者少于2人; 5、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的; 6、不可抗力的发生导致本计划不能存续; 7、发生资产管理合同约定的应当终止的情形;

- 8、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- 9、法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况；
- 10、管理人根据本集合计划实际运营状况，认为有必要提前终止本计划的其他情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报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，前述第8项约定的情形除外。

(三) 集合计划的清算

1、管理人自集合计划终止之日起5个工作日内发起成立集合计划清算小组，集合计划清算小组成员由管理人和托管人组成，集合计划清算小组可以聘用必要的工作人员，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定负责集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配，依法进行必要的民事活动等清算工作；

2、清算过程中发生可能影响委托人合同权益的重大事项的，清算小组应当在重大事项发生或应当知道重大事项发生之日起5日内将相关情况在管理人网站上公布；

3、清算报告由管理人在清算结束后5个工作日内报告中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人注册地中国证监会派出机构，并在管理人网站公布清算报告；

4、清算结束后30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（如有）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本合同的约定以货币资金的形式全部分派给委托人；

5、本计划清算完毕后，托管人应按照规定注销集合计划的托管账户、专用证券账户和资金账户等投资账户，管理人应给与必要的配合；

6、若本计划在终止之日有未能流通变现的证券，清算小组可对此制定二次清算方案，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。本计划因委托财产流动性受限等

	<p>原因延期清算的，管理人应当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>(四) 清算程序</p> <p>清算小组应按以下程序进行：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、计划终止后，对计划资产进行清理和确认； 2、对资产进行评估和变现； 3、将清算报告向中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人注册地中国证监会派出机构； 4、将清算报告在管理人网站公布； 5、对资产进行分配。按照本部分“(三) 集合计划的清算”的规定分配和返还资产。 <p>(五) 清算费用</p> <p>清算费用是指清算小组在进行资产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用优先从清算资产中支付。</p> <p>(六) 清算账册及文件的保存</p> <p>集合资产管理计划清算账册及有关文件由管理人按相关法律法规规定年限妥善保存，保存期不少于二十年。</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>

