

**海通期货-通利未来 FOF 一期集合资产管理计划**  
**投资说明书**  
2022 年 5 月更新



**特别提示:**

本投资说明书依据《私募投资基金监督管理暂行办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》(以下简称《暂行规定》)、《中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局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计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《海通期货-通利未来 FOF 一期集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称《资产管理合同》)及其他有关规定制作, 资产管理人保证本投资说明书的内容真实、准确、完整, 不存在任何虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

投资者承诺以真实身份投资本计划, 保证投资本计划财产的来源及用途合法, 并已阅知本投资说明书和《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。

资产管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 但不保证基金一定盈利, 也不保证最低收益。投资有风险, 投资者认购、参与本计划时应认真阅读本计划的《资产管理合同》。资产管理人的过往业绩不代表未来业绩。

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, 其认购或参与基金份额的行为本身即表明其对《资产管理合同》及本投资说明书的承认和接受。投资者将按照《资产管理合同》、本投资说明书及有关规定享有权利、承担义务。

计划的 基 本 情 况	计划的名称	海通期货-通利未来 FOF 一期集合资产管理计划
	计划的类别	混合类集合资产管理计划
	运作方式	开放式
	存续期限	自本计划成立之日起 10 年, 如本计划存续期届满最后一日为非工作日, 则本计划存续期顺延至下一个工作日。当计划资产全部变现为现金时, 管理人可根据市场情况选择提前终止本计划, 终止前需告知托管人及委托人。本计划存续期满前, 经委托人、管理人及托管人一致同意, 可以展期, 展期时应当符合本计划的成立条件。
	初始销售面值	本计划份额的初始销售面值为 1.0000 元/份。
	初始委托资产	最低初始规模不得低于 1000 万元人民币。
	资产托管人	华泰证券股份有限公司
	注册登记机构	海通期货股份有限公司
管理 人 基 本 信 息	管理人名称	海通期货股份有限公司
	办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 25 楼
	成立时间	1993-03-18
	公司类型	其他股份有限公司(非上市)
计划的分级信息		本计划不分级
计划 的 投 资	投资目标	在严格控制投资风险的前提下, 追求稳健收益。
	投资范围	权益类: 沪深交易所发行上市的股票(含网上网下新股申购)、融资融券、股票型公募基金、港股通; 固定收益类: 交易所或银行间交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债券、公司债、企业债、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、可转换债券、可交换债券、交易所或银行间市场发行的资产支持证券的优先类份额、银行间市场发行及交易的资产支



	<p>持票据、债券回购、债券型公募基金；</p> <p>现金管理类：银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、货币类银行理财产品；</p> <p>商品及金融衍生品类：证券及期货交易所上市的期货和期权品种；</p> <p>资产管理产品类：契约式私募证券投资基金、基金公司及其子公司资产管理计划（非标除外）、证券公司及其子公司资产管理计划（非标除外）、期货公司及其子公司资产管理计划、银行理财产品、混合型公募基金等。</p> <p>本计划底层资产均为标准化资产，如本计划投资资产管理产品，管理人明确告知下层产品的管理人不得投资公募证券投资基金以外的资管产品，同时管理人在投资前将确认其投资标的底层不含资管计划（含私募基金）或其收受益权。管理人应获得下层产品管理人对本计划持有期内不再进行转委托的承诺或约定。</p> <p>资产管理计划改变投向和投资比例的，应当事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。</p> <p><b>特别提示：本计划投资于债券回购。</b></p>
<p><b>所投资资产管理产品的选择标准</b></p>	<p>主要从收益率、波动性、相关性以及稳定性四个方面来评估资管产品的绩效特征，结合管理团队背景情况及策略逻辑，初步筛选资管产品。通过对年化收益率、年化波动率、最大回撤、回撤周期、夏普比率、索提诺比率、市场捕获率以及产品间相关性八个量化指标持续跟踪，长期观察资管产品的运行情况，最终筛选出符合 FOF 配置的子基金。</p>
<p><b>投资策略</b></p>	<p>基于宏观及产业研究分析，将资产配置的问题转换为策略配置或团队配置的问题，并在 FOF 层面采用对冲设计进一步优化投资组合的收益风险比。通过量化指标持续监控子基金的绩效表现、市场风格的变化情况，相应调整配置。</p>
<p><b>预警止损机制</b></p>	<p>为保护资产委托人的利益，本计划将计划份额净值为 0.9000 元设置为预警线，将计划份额净值为 0.8500 元设置为止损线。</p> <p>当管理人估算的计划份额净值低于或等于预警线 0.9000 元时，管理人应主动对本计划所持有的投资标的采取以下风险控制措施：若 T 日收盘后经管理人估算的计划份额净值低于或等于预警线 0.9000 元/份，无论 T+1 日及之后的本计划份额净值是否高于预警线，管理人须于 T+2 日（含）前以传真、邮件、短信或者其他管理人和资产委托人共同认可的方式向本计划份额持有人发出预警通知。</p> <p>当管理人估算的计划份额净值低于或等于止损线 0.8500 元时，管理人于两个工作日内开始止损操作，逐步将持仓的投资标的卖出，在十个工作日内将持仓的投资标的平仓变现。该平仓操作不可逆，在所持全部非现金类资产变现前不可停止。对于已变现部分，根据本合同第二十四条的清算程序对计划进行清算。如遇因持有流通受限证券等原因导致本计划财产无法及时变现的，则变现时间顺延，待全部变现完成之日，管理人进行二次清算。</p> <p>计划的预警和止损由资产管理人负责执行，如资产管理人未按照资产管理合同的约定采取风险控制措施和进行强制止损，由此对计划财产或资产委托人造成的损失，由资产管理人承担。</p> <p><b>托管人复核的计划份额净值低于预警线/止损线的，无论管理人估算的计划份额净值是否低于预警线/止损线，管理人应当按照合同约定进行</b></p>

	<p><b>预警或止损。</b></p> <p>资产管理人特别提示：本计划设置 0.85 元为止损线，并不代表资产管理人完成止损后计划份额净值等于 0.85 元，根据资产管理人变现操作的交易执行情况，本计划终止日计划份额净值可能低于 0.85 元。</p>
<b>投资限制与比例</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、投资于资产管理产品的比例不得低于总资产的 80%。</li> <li>2、按照穿透原则合并计算，投资于固定收益类资产、权益类资产、商品及金融衍生品类且任一资产类别的投资比例不超过计划总资产 80%。</li> <li>3、本计划存续期内，计划总资产与净资产的比例不得超过 200%。</li> <li>4、投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 25%；本管理人所管理的全部资产管理计划投资于同一资产的资金不得超过该资产规模的 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。</li> </ol>
<b>投资比例超限的处理方式及流程</b>	<p>资产管理计划存续期间，管理人应当严格按照法律、行政法规、中国证监会规定以及合同约定的投向和比例进行资产管理计划的投资运作。资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，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>
<b>投资禁止行为</b>	<p>管理人不得利用计划财产从事下列行为或进行如下投资运作，若由此造成计划财产、合同当事人及第三方损失的，所有责任由管理人承担：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、承销证券；</li> <li>2、向他人贷款或提供担保；</li> <li>3、从事承担无限责任的投资；</li> <li>4、从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；</li> <li>5、直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；</li> <li>6、与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等；</li> <li>7、法律法规、中国证监会以及本合同规定禁止从事的其他行为。</li> </ol>
<b>建仓期</b>	<p>本计划的建仓期为自产品成立之日起 6 个月。建仓期的投资活动，应当符合资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。</p>
<b>投资的资产组合的流动性与参与、退出安排</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、全部资产投资于标准化资产的集合资产管理计划和中国证监会认可的其他资产管理计划其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%。</li> <li>2、管理人应当确保集合资产管理计划开放退出期内，其资产组合中 7</li> </ol>

		个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%。
	风险收益特征	本计划为【R3】风险等级的产品，适合风险识别、评估、承受能力【C5、C4、C3】级别风险承受能力的普通合格投资者和专业投资者。通过代销机构购买本计划的客户，以代销机构的风险评级结果为准。参与本计划的普通合格投资者和专业投资者必须为满足本计划所适用的法律法规、监管规定、自律规则等规定的合格投资者。
资产管理计划的募集	初始销售期	本计划的初始销售时间为【2020】年【5】月【19】日至【2020】年【5】月【27】。 本计划的初始销售时间由管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定。管理人有权根据本计划销售的实际情况按照相关程序延长或缩短初始销售期，此类变更适用于所有销售机构。延长或缩短初始销售期的相关信息将及时发布通知，即视为履行完毕延长或缩短初始销售期的程序。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。
	销售方式	本计划通过直销机构（管理人）和管理人委托的代销机构进行销售。
	销售对象	本计划仅向符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》规定的合格投资者发售，即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且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。 （1）具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一的个人：家庭金融资产不低于 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）； （6）中国证监会视为合格投资者的其他情形。 投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。 其中所称金融资产包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。家庭金融资产是指家庭金融资产总资产减去全体家庭成员的全部负债。
	份额的认购和持有金额	投资者认购本计划，以人民币货币资金形式交付。本计划不接受现金方式认购，在直销机构认购的投资者须将认购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集账户，在代销机构认购的投资者按代销机构的规定缴付资金。 投资者在初始销售期间的最低认购金额不得低于 40 万元人民币（法律法规或部门规章对认购金额无最低要求的合格投资者不受此限），并可多次认购，初始销售期间每次追加认购金额应不低于 1 万元人民币。最

		低认购金额不包含认购费。
	<b>认购费用</b>	本计划无认购费。
	<b>募集期利息的处理方式</b>	<p>管理人应当将计划初始销售期间投资者的资金存入份额登记机构指定的专用账户，份额登记机构应及时将资金转入托管账户，在计划初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。</p> <p>投资者的有效认购款项（不含认购费）在募集账户形成的利息按照同期人民银行活期利率计算在本计划成立后折算为资产管理计划份额归投资者所有，具体以注册登记机构的记录为准。</p>
	<b>认购份额的计算方式</b>	<p>认购份额=（净认购金额+利息）÷面值</p> <p>净认购金额=认购金额-认购费（如有）</p> <p>认购份额保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入计划财产。</p>
<b>资产管理计划的成立与备案</b>	<b>资产管理计划成立的条件</b>	<p>本资产管理计划初始销售期限届满，符合下列条件的，管理人应当按照规定办理资金到账证明和资产管理计划备案手续：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、初始募集规模不低于1000万元，投资者人数不少于2人，且不超过200人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；</li> <li>2、法律法规另有规定的，从其规定。</li> </ol>
	<b>资产管理计划的备案与成立</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、本资产管理计划募集期结束后，将全部募集资金划入托管账户。资产管理人应当自募集金额缴足之日起10个工作日内，委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，取得验资报告后，资产管理人公告资产管理计划成立。管理人以邮件形式向托管人发送《起始运作通知书》，即成立日为本计划的起始运作日。资产托管人的职责自计划成立后开始。</li> <li>2、资产管理人应当在本计划成立之日起5个工作日内，向中国证券投资基金业协会私募基金登记备案系统进行备案，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料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。</li> <li>3、资产管理计划成立后完成备案前不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</li> </ol>
	<b>资产管理计划未达到成立条件的处理方式</b>	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用。</li> <li>2、在初始销售期限届满后30日内返还计划投资者已缴纳的款项，并加计不低于银行同期活期存款利息。</li> </ol>
<b>资产管理计划的参与、退出和转让</b>	<b>参与和退出的场所</b>	<p>本资产管理计划的销售机构包括直销机构（资产管理人）和资产管理人委托的代销机构。</p> <p>资产委托人应当在募集机构办理资产管理计划销售业务的营业场所或按募集机构提供的其他方式办理计划份额的参与和退出。</p> <p>管理人可根据情况变更或增减募集机构，并予以公告。</p>
	<b>参与和退出的开放日和转让时间</b>	<p>本计划锁定期为180天，即自每笔份额认购/参与确认后开始计算起180天（含）内，投资者可在计划开放日根据本合同相关约定参与本计划（每笔参与份额单独计算锁定期），不允许退出；自每笔份额认购/参与确认之日开始计算起180天后，投资者可在本计划开放日根据本合同相关约定参与和/或退出本资产管理计划（每笔认购/参与份额单独计算锁定期），但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定公告</p>

		<p>暂停参与和/或退出时除外。每笔份额认购/参与确认日期以本计划份额登记机构为准。</p> <p>本计划每周五开放申购，每月 15 号开放赎回，如遇节假日顺延。此外，管理人有权根据本计划运作情况设置其他开放日，具体开放日期及开放方案以管理人公告为准。</p> <p>若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，资产管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知资产委托人。资产管理人提前 3 个交易日在网站公告或委托人认可的其他形式告知前述调整事项即视为履行了告知义务。</p> <p>因法律法规、监管规定及自律规则发生修订、本计划合同变更、计划展期时，资产管理人为保障投资者权益，有权设定临时开放期。临时开放期内，投资者只允许退出，不允许申购。临时开放期的具体安排以资产管理人公告为准，届时在资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p>
	<p><b>参与和退出的方式、价格、程序及确认等</b></p>	<p>1、出资方式及参与期限</p> <p>本计划的参与以人民币货币资金形式交付，不接受现金方式参与。在直销机构参与本计划的投资者应在参与有效期内将参与资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集账户，在代销机构参与的投资者按代销机构的规定缴付资金。</p> <p>2、委托人参与本计划时，按照参与申请所对应的开放日的计划份额净值为基准计算计划份额。资产委托人退出计划时，按照退出申请所对应的开放日的计划份额净值计算退出金额。</p> <p>3、“未知价”原则，即计划的参与价格、退出价格以开放日当日收市后计算的计划份额净值为基准进行计算。</p> <p>4、计划参与采用金额申请的方式，计划退出采用份额申请的方式。</p> <p>5、资产委托人退出本计划时，管理人按先进先出的原则，即按资产委托人认购、参与计划份额的先后次序进行顺序退出。</p>
	<p><b>参与和退出申请的确认</b></p>	<p>1、T 日，客户进行参与或退出申请。申请参与的委托人须在开放日【T-5】至【T】日之间向销售机构及其网点提出参与申请，申请退出的委托人应开放日【T-5】至【T】日向资产管理人提出退出申请，并于开放日当日交易时间内（9:00-15:00）通过销售机构发起参与和退出申请，未在该期限内提出的参与或退出申请，资产管理人不予接受。</p> <p>2、在正常情况下，管理人在 T+N（<math>2 \leq N \leq 5</math>，N 由管理人和托管人根据计划运作情况、技术条件支持等情况确认，其中默认 N=2，在计划存续期间资产管理人有权对 N 进行调整，并通知资产委托人和托管人）日对 T 日参与和退出申请的有效性进行确认。若参与不成功，则参与款项退还给委托人。</p> <p>3、资产委托人退出申请确认后，资产管理人将在【T+7】日(包括 T+7 日)内支付退出款项。在发生巨额退出时，款项的支付办法参照本合同有关条款处理。</p> <p>销售机构对参与、退出的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。参与、退出的确认以管理人的确认结果为准。</p>
	<p><b>参与和退出的金额限制</b></p>	<p>委托人首次参与金额应不低于 40 万元人民币（法律法规或部门规章对参与金额无最低要求的合格投资者不受此限），在开放日内追加参与的，</p>

	<p>追加金额应不低于 1 万元人民币。</p> <p>当资产委托人持有的计划份额资产净值高于合格投资者最低参与金额，委托人可以选择全部或部分退出资产管理计划份额；选择部分退出资产管理计划份额的，资产委托人在退出后持有的计划份额资产净值不得低于合格投资者最低参与金额。当资产管理人发现资产委托人申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于合格投资者最低参与金额，资产管理人有权适当减少该委托人的退出金额，以保证部分退出申请确认后委托人持有的计划资产净值不低于合格投资者最低参与金额。当资产委托人持有的计划份额资产净值低于合格投资者最低参与金额时，需要退出计划的，资产委托人必须选择一次性全部退出资产管理计划。</p>
<b>参与和退出的费用</b>	<p>1、参与费用 本计划无参与费。</p> <p>2、退出费用 本计划无退出费。</p>
<b>参与份额与退出金额的计算方式</b>	<p>1、参与份额计算 参与份额=净参与金额÷参与价格 净参与金额=参与金额-参与费（如有） 参与价格为参与申请所对应的开放日当日的计划份额净值。</p> <p>参与份额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入计划财产。</p> <p>2、退出金额计算 退出金额=退出份额×退出价格-管理人业绩报酬（如有）-退出费（如有） 退出价格为退出申请所对应的开放日当日的计划份额净值。 退出金额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入计划财产。</p>
<b>参与资金的利息处理方式</b>	投资者的参与款项（不含参与费用）于开放期在募集账户形成的利息不计入资产管理计划，也不折算为投资者的份额。
<b>巨额退出的认定及处理方式、延期支付及延期退出的情形和处理方式</b>	<p>1、巨额退出的认定和处理方式</p> <p>（1）巨额退出的认定 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）超过上一工作日本计划总份额数的 10%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 发生巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退： 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。 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本计划总份额 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比例，确定当日受理的退出份额；委托人未能退出部分，除委托人在提交退出申请时明确作出不参加顺延下一个工作日退出的表示外，自动转为下一个工作日退出处理。</p>

	<p>延缓办理退出部分按照延缓办理日单位净值，逐日支付退出款项，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> <p>2、连续巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(1) 连续巨额退出的认定</p> <p>如果本计划连续 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>本计划发生连续巨额退出，管理人可暂停接受退出申请，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>
<p><b>拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理</b></p>	<p>1、在如下情况下，资产管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：</p> <p>(1) 如接受该申请，将导致本计划资产委托人超过 200 人。</p> <p>(2) 根据市场情况，资产管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对资产管理计划业绩产生负面影响，从而损害现有资产管理计划资产委托人的利益的情形。</p> <p>(3) 因资产管理计划收益分配、或资产管理计划内某个或某些证券进行权益分派等原因，使资产管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有资产管理计划资产委托人利益的。</p> <p>(4) 资产管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他资产管理计划资产委托人利益的。</p> <p>(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>资产管理人决定拒绝接受某些资产委托人的参与申请时，参与款项将退回资产委托人账户。</p> <p>2、在如下情况下，资产管理人可以暂停投资者的参与：</p> <p>(1) 因不可抗力导致无法受理资产委托人的参与申请。</p> <p>(2) 证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。</p> <p>(3) 本计划的证券/期货经纪商没有或未及时发送交易清算数据或对账数据、发送的交易清算数据或对账数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日计划资产净值的情形；</p> <p>(4) 对于没有或未及时获取场外交易数据或场外行情数据、场外交易数据或场外行情数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日计划资产净值的情形；</p> <p>(5) 发生本资产管理合同规定的暂停资产管理计划资产估值情况。</p> <p>(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>资产管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知资产委托人。在暂停参与的情形消除时，资产管理人应及时恢复参与业务的办理并告知资产委托人。</p> <p>3、在如下情况下，资产管理人可以暂停接受资产委托人的退出申请：</p> <p>(1) 因不可抗力导致资产管理人无法支付退出款项。</p> <p>(2) 证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日</p>



	<p>资产管理计划财产净值。</p> <p>(3) 本计划的证券/期货经纪商没有或未及时发送交易清算数据或对账数据、发送的交易清算数据或对账数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日计划资产净值的情形；</p> <p>(4) 对于没有或未及时获取场外交易数据或场外行情数据、场外交易数据或场外行情数据不完整或有误，导致无法或未能及时计算当日计划资产净值的情形；</p> <p>(5) 发生本资产管理合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情况。</p> <p>(6) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一的，资产管理人应当及时告知资产委托人。已接受的退出申请，资产管理人应当足额支付；如暂时不能足额支付，应当按单个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受的退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续开放日予以支付。</p> <p>在暂停退出的情况消除时，资产管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知资产委托人。</p> <p>4、暂停资产管理计划的参与、退出时，资产管理人应按规定告知资产委托人。</p> <p>5、暂停参与或退出期间结束，资产管理计划重新开放时，资产管理人应按规定告知资产委托人。</p>
<b>资产管理计划份额的转让</b>	<p>本计划委托人可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式按规定办理集合资产管理计划份额转让业务，份额转让应遵守交易所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续，管理人应当核查并确认计划份额受让人为合格投资者且计划份额转让后投资者人数符合《运作管理规定》及本合同的约定。受让人首次参与本计划的，应与管理人、托管人签订本资产管理合同。</p>
<b>资产管理计划份额的非交易过户</b>	<p>非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的资产管理计划份额按照一定的规则从某一委托人账户转移到另一委托人账户的行为。非交易过户包括继承、捐赠、司法执行以及份额登记机构认可、符合法律法规的其他类型。办理非交易过户必须提供计划份额登记机构要求提供的相关资料，接收划转的主体必须是依法可以持有本计划份额的合格投资者。</p> <p>继承是指资产委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承；捐赠指资产委托人将其合法持有的计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将资产委托人持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。办理非交易过户必须提供计划份额登记机构要求提供的相关资料，对于符合条件的非交易过户申请按计划份额登记机构的规定办理，并按计划份额登记机构规定的标准收费。</p>
<b>资产管理计划份额的冻结与解冻</b>	<p>本资产管理计划的份额冻结与解冻只包括人民法院、人民检察院、公安机关及其他国家有权机构依法要求的计划份额冻结与解冻事项，以及计划份额登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。</p>
<b>资产管理人以自有资金参与资产管理计划的条件、方式、金额、</b>	<p>1、认购、参与条件</p> <p>资产管理人以自有资金参与本资产管理计划的持有期限不得少于6个月，参与、退出时，应当提前5个工作日告知资产委托人和资产托管人。</p>

	<b>比例以及管理人自有资金退出的条件</b>	<p>资产管理人以自有资金参与本资产管理计划的份额不得超过该计划总份额的 20%。资产管理人及其附属机构以自有资金参与本资产管理计划的份额合计不得超过该计划总份额的 50%。因本资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，管理人应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时调整达标。</p> <p>2、认购、参与、退出方式 资产管理人或其资产管理子公司的自有资金和董事、监事、高级管理人员、从业人员及其配偶，参与本计划的，其认购、参与、退出方式应遵循本合同有关条款规定。</p> <p>3、自有资金责任承担方式和金额 管理人自有资金参与的份额与其他委托人持有的同类份额享有相同的权利和义务。</p>
<b>计划财产的估值</b>	<b>估值目的</b>	计划财产估值目的是客观、准确地反映计划财产的价值，并为计划份额退出提供计价依据。
	<b>估值对象</b>	本计划所拥有的期货、股票、债券、权证、基金、其他衍生工具和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。
	<b>估值时间</b>	资产管理人与资产托管人对每个交易日的计划财产进行估值，T+2 日完成 T 日的估值。估值核对日为每周第二个交易日，核对上周最后一个交易日的估值结果。如遇收益分配基准日、计划开放日、计划终止日，则需对收益分配基准日、计划开放日和计划终止日的估值结果进行核对。另外，管理人向托管人协商后，可要求对其他交易日的估值结果进行核对。
	<b>估值方法</b>	<p>本计划按以下方式进行估值：</p> <p>(1) 证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>A、交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>B、交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考第三方机构、监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>C、交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含截止最近交易日的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p>

D、交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

A、送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值。

B、首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

C、首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的收盘价估值。

D、非公开发行有明确锁定期的股票，按以下方法估值：

如果估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价低于非公开发行股票初始取得成本时，可采用在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价作为估值日该非公开发行股票的价值；

如果估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价高于非公开发行股票初始取得成本时，可按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV = C + (P - C) \times \frac{D_l - D_r}{D_l}$$

其中：FV 为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值；C 为该非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得成本做相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价； $D_l$  为该非公开发行有明确锁定

期的股票锁定期所含的交易所的交易天数； $D_r$  为估值日剩余锁定期，

即估值日至锁定期结束所含的交易所的交易天数（不含估值日当天）。

(3) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，主要采用第三方机构提供的估值价格和估值技术。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。

(4) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。其他基金按最近交易日的计划份额净值估值。场外交易的货币基金以成本估值，每日按前一交易日的万份收益计提红利。

(6) 期货以估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的，从其规定。

(7) 计划持有的衍生工具等其他有价证券，上市交易的按估值日的结算价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的结算价估值；未上市交易的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的有价证券，采用估值技术确定公允

	<p>价值。</p> <p>(8) 债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。</p> <p>(9) 银行存款、债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收、应付利息，在结息日以实收、实付利息入账。</p> <p>(10) 中小企业私募债按照成本估值。</p> <p>(11) 对于投资的基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、私募投资基金等场外产品（以下简称“标的产品”），按如下方式进行估值：</p> <p>①如管理人在上述标的产品权益确认日提供了权益确认原始凭证，则在确认日当天以原始凭证为依据入账；如管理人无法在权益确认日提供上述产品的权益确认原始凭证，则在原始凭证提供日进行确认，并不再对以往账务进行追溯调整，由此造成的估值偏差由管理人承担相关责任；</p> <p>②如果上述产品有份额净值的，以管理人按照净值提供频率提供的标的产品最新份额净值进行估值，如果管理人没有按照净值提供频率提供最新份额净值的，则以最近一次提供的份额净值估值，由此造成的估值偏差由管理人承担相关责任；</p> <p>③如果不属于上述情况的，则资产管理人应向资产托管人提供标的产品的估值方法和估值数据，并确保提供数据的真实、完整和有效。</p> <p>(12) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，管理人可根据具体情况制定估值方法，并将估值方法提供给托管人进行估值。如管理人认为上述估值方法不合适，可就相关估值方法进行修改，并将修改后的方法提前通知托管人进行估值。</p> <p>(13) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p> <p>资产管理计划估值核算需要的相关信息，包括但不限于场外交易信息和场外行情信息，如果托管人无法获得相关估值数据，则由管理人负责提供，并对数据准确性、完整性和及时性负责。</p> <p>如管理人或托管人发现估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护资产委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。根据有关法律法规，计划资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，以管理人对计划资产净值的计算结果为准。</p>
<p><b>估值程序</b></p>	<p>计划日常估值由管理人进行，根据相关法律法规，管理人可以委托第三方外包机构办理资产管理计划的估值。管理人或其委托的第三方完成估值后，将估值结果以书面形式或者双方认可的其他形式送至托管人，托管人按法律法规、本合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，复核无误后在管理人发送的书面估值结果上加盖业务章或者双方认可的其他形式返回给管理人或其委托的第三方；月末、年中和年末估值复核与资产管理计划会计账目的核对同时进行。</p> <p>在法律法规和中国证监会允许的情况下，管理人与托管人可以各自委托</p>

	<p>第三方机构进行计划资产估值，但不改变管理人与托管人对计划资产估值各自承担的责任。</p>
<p><b>估值差错的处理与调整</b></p>	<p>管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保计划资产估值的准确性、及时性。当计划净值发生计算错误超过计划净值 0.5%时，视为估值错误。</p> <p>本合同的当事人应按照以下约定处理：</p> <p>(1) 估值错误类型</p> <p>本计划运作过程中，如果由于管理人、托管人、交易所、计划份额登记机构、销售机构或计划投资者自身的过错造成估值错误，导致其他当事人遭受损失的，按如下估值错误处理原则和处理程序执行。</p> <p>上述估值错误的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等。</p> <p>自然灾害、突发事件、以及因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，由于不可抗力造成资产委托人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。</p> <p>(2) 估值错误处理原则</p> <p>A、如管理人或托管人发现计划资产估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定，导致计划净值发生计算错误超过计划净值的 0.5%时，应立即通知双方，共同查明原因，协商解决；</p> <p>B、估值错误的责任人应当对由于该估值错误遭受损失的直接当事人的直接损失承担赔偿责任；估值错误的责任人对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对估值错误的有关直接当事人负责，不对第三方负责；</p> <p>C、因估值错误而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务；</p> <p>D、估值错误调整采用尽量恢复至假设未发生估值错误的正确情形的方式；</p> <p>E、管理人和托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以管理人计算结果为准；</p> <p>F、管理人按本合同约定的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为计划资产估值错误处理；</p> <p>G、按法律法规规定的其他原则处理估值错误。</p> <p>(3) 估值错误处理程序</p> <p>估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：</p> <p>A、计划份额净值计算出现错误时，管理人应当立即予以纠正，通报托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；</p> <p>B、当计划净值发生计算错误超过计划净值的 0.5%时，查明估值错误发生的原因，根据当事人协商的方法对因估值错误造成的损失进行评估；</p> <p>C、根据估值错误处理原则或当事人协商的方法，对估值错误进行处理；</p> <p>D、前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。</p>
<p><b>暂停估值的情形</b></p>	<p>(1) 计划投资所涉及的交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>(2) 因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估计划财</p>

		<p>产价值时；</p> <p>(3) 占计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而管理人为保障计划投资者的利益，决定延迟估值的情形；</p> <p>(4) 中国证监会认定的其他情形。</p>
	<b>资产管理计划财产的会计核算</b>	<p>1、管理人为本计划的会计责任方；</p> <p>2、计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；计划首次募集的会计年度按如下原则：如果《资产管理合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；</p> <p>3、计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；</p> <p>4、会计制度执行国家有关会计制度；</p> <p>5、本计划独立建账、独立核算；</p> <p>6、管理人及托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制计划会计报表。</p> <p>7、托管人应定期与管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。</p>
<b>计划的费用与税收</b>	<b>管理费</b>	<p>本计划的年管理费率为 0.5%。计算方法如下：</p> $H = E \times 0.5\% \div N$ <p>H：每日应计提的管理费</p> <p>E：前一日的计划资产净值</p> <p>N：当年天数</p> <p>本计划的管理费自计划成立日次日起，每日计提，按季支付给管理人。资产管理人每自然季前十五个工作日向资产托管人发送上季度的资产管理计划管理费划款指令，经资产托管人复核后于划款指令约定日期从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</p>
	<b>托管费</b>	<p>本计划的年托管费率为 0.025%。计算方法如下：</p> $H = E \times 0.025\% \div N$ <p>H：每日应计提的托管费</p> <p>E：前一日的计划资产净值</p> <p>N：当年天数</p> <p>本计划的托管费自计划成立日次日起，每日计提，按季支付给托管人。资产管理人每自然季前十五个工作日向资产托管人发送上季度的资产管理计划托管费划款指令，经资产托管人复核后于划款指令约定日期从资产管理计划财产中一次性划付，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</p>
	<b>业绩报酬</b>	<p>(1) 业绩报酬提取原则</p> <p>a) 采用单个投资者单笔投资年化收益差额法，对计划份额持有人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p>b) 本计划的业绩报酬计提日为退出日、收益分配日、计划终止日。当计划份额持有人每笔所持份额在持有期的年化收益率大于 8% 时，分别计算每笔份额在上一成功计提日至本次计提日持有期间的年化收益率 (r)，对超出 8% 的持有期差额收益按 15% 比例进行计提。计提频率不得超过每 6 个月一次，因计划终止，不受前述提取频率的限制。</p> <p>c) 在收益分配、计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从拟分配收益和</p>

	<p>清算资产中扣除。</p> <p>(2) 业绩报酬提取的方法</p> <p>每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬成功计提日到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。年化收益率的计算公式如下：</p> $r = \frac{P_1 - P_0}{P_0^*} \times 100\% \times \frac{\text{当年天数}}{T}$ <p><math>P_1</math>为本次业绩报酬计提日的份额累计净值；  <math>P_0</math>为某笔份额上个业绩报酬成功计提日（首次计提时，则为认购或参与日）的份额累计净值；  <math>P_0^*</math>为某笔份额上个业绩报酬成功计提日（首次计提时，则为认购或参与日）的份额单位净值；  <math>T</math>为上一个成功业绩报酬计提日(含)到本次业绩报酬计提日（不含）的天数；  <math>r</math>为某笔份额在业绩报酬计提期间的年化收益率。</p> <p>管理人业绩报酬计提如下：</p>									
	<table border="1" style="width:100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width:33%;">年化收益率（r）</th> <th style="width:33%;">计提比例</th> <th style="width:33%;">业绩报酬（R）的计提公式</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align:center;"><math>r \leq 8\%</math></td> <td style="text-align:center;">0</td> <td style="text-align:center;"><math>R = 0</math></td> </tr> <tr> <td style="text-align:center;"><math>r &gt; 8\%</math></td> <td style="text-align:center;">15%</td> <td style="text-align:center;"><math>R = (r - 8\%) \times 15\% \times P_0^* \times S \times T</math> <div style="text-align:right;"><math>\div \text{当年天数}</math></div></td> </tr> </tbody> </table>	年化收益率（r）	计提比例	业绩报酬（R）的计提公式	$r \leq 8\%$	0	$R = 0$	$r > 8\%$	15%	$R = (r - 8\%) \times 15\% \times P_0^* \times S \times T$ <div style="text-align:right;"><math>\div \text{当年天数}</math></div>
年化收益率（r）	计提比例	业绩报酬（R）的计提公式								
$r \leq 8\%$	0	$R = 0$								
$r > 8\%$	15%	$R = (r - 8\%) \times 15\% \times P_0^* \times S \times T$ <div style="text-align:right;"><math>\div \text{当年天数}</math></div>								
	<p><math>R</math>为某笔份额<math>S</math>应计提的业绩报酬，计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入；  <math>S</math>为计提业绩报酬对应的某笔份额数。</p> <p>(3) 业绩报酬支付</p> <p>上述业绩报酬在计划份额退出、收益分配及计划终止清算后 10 个工作日内，由计划托管人根据资产管理人出具的划款指令支付给资产管理人。</p>									
<p><b>其他费用的计提方法</b></p>	<p>资产管理计划银行资金账户发生的银行结算费用等银行费用以及证券账户等开户费用，由托管人直接从资金账户中扣划，无须管理人出具指令。</p> <p>资产管理计划运作期间投资所发生的交易手续费、印花税等有关证券交易税费，作为交易成本直接扣除。</p> <p>资产管理计划存续期间发生的信息披露费、与资产管理计划相关的律师费和会计师费、以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据有关法规及相应协议的规定，按照管理人的指令，按费用实际支出金额从资产管理计划资产中支付，列入资产管理计划费用。</p>									
<p><b>不列入计划业务费用的项目</b></p>	<p>1、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，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。</p>									

		<p>2、资产管理计划成立前发生的费用（包括但不限于推广费用、律师费、会计师费和信息披露费用），以及存续期间发生的与募集有关的费用，不得列入资产管理计划费用。</p> <p>3、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。</p>
	<b>费率的调整</b>	<p>资产管理人与资产托管人协商一致，可下调管理费率和托管费率。</p> <p>对上述费率的调整生效后，资产管理人按照本合同的约定向资产委托人披露变更的具体内容。</p>
	<b>税收</b>	<p>委托人所取得收益的应缴税款由委托人自行申报及缴纳，管理人不承担就委托人在本资管业务中收益缴纳税款的义务。本计划运作过程中涉及的其他纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。</p> <p>增值税费自计划成立次日起，每自然日按照管理人提交的计税方案和实际交易结果计提，按月支付。由管理人在下月初十五个工作日内向资产托管人发送计划增值税费划款指令，资产托管人复核后于划款指令约定日期从计划财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。资产管理人应确保托管账户资金足额，费用扣划后，资产管理人应进行核对，并按相关规定及时申报缴纳增值税，如发现数据不符，及时联系资产托管人协商解决。</p>
<b>收益分配</b>	<b>利润构成</b>	<p>资产管理计划利润指计划利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入扣除相关费用后的余额，资产管理计划已实现收益指计划利润减去公允价值变动损益后的余额。</p>
	<b>可供分配利润</b>	<p>资产管理计划可供分配利润指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）资产负债表中计划未分配利润。</p>
	<b>收益分配原则</b>	<p>1、在符合有关计划收益分配条件的前提下，管理人有权决定是否对计划进行收益分配，收益分配的比例亦由管理人决定。</p> <p>2、本计划由管理人决定收益分配基准日及收益分配发放日。</p> <p>3、本计划存续期内，委托人可选择现金分红或者将收益转换为份额的方式进行，默认方式为现金分红。委托人需要变更分红方式的，应通过书面方式告知管理人。</p> <p>4、计划收益分配后计划份额净值不能低于面值；即计划收益分配基准日的计划份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>5、每一计划份额享有同等分配权；</p> <p>6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>
	<b>收益分配方案</b>	<p>计划收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</p>
	<b>收益分配方案的确定、公告与实施</b>	<p>本计划收益分配方案由管理人拟定，并由托管人复核，以约定的形式通知资产委托人。</p>
<b>信息披露与报告</b>	<b>披露报告</b>	<p>(1) 净值报告</p> <p>管理人每周将经托管人复核的上周最后一个交易日的计划份额净值以各方认可的形式提交资产委托人；同时管理人应当在本合同、说明书或等信息披露文件上载明计划份额参与、退出价格的计算方式及有关参与、退出费率，并保证投资人能够在销售机构查阅或者复制前述信息资料。</p> <p>(2) 季度报告</p>



		<p>资产管理人应当在每季度结束之日起 1 个月内，编制完成计划季度报告并经资产托管人复核后，向资产委托人披露包括但不限于以下信息：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1) 管理人履职报告；</li> <li>2) 托管人履职报告；</li> <li>3) 资产管理计划投资表现；</li> <li>4) 资产管理计划投资组合报告；</li> <li>5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；</li> <li>6) 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；</li> <li>7) 资产管理计划投资收益分配情况；</li> <li>8) 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；</li> <li>9) 中国证监会规定的其他事项。</li> </ol> <p>资产管理合同生效不足 3 个月以及存续期间不足 3 个月的，资产管理人可以不编制当期季度报告。</p> <p>（3）年度报告</p> <p>管理人应当在每年度结束之日起四个月内，编制完成年度报告并经托管人复核，向资产委托人披露包括但不限于下列信息：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1) 管理人履职报告；</li> <li>2) 托管人履职报告；</li> <li>3) 资产管理计划投资表现；</li> <li>4) 资产管理计划投资组合报告；</li> <li>5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；</li> <li>6) 资产管理计划财务会计报告；</li> <li>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；</li> <li>8) 资产管理计划投资收益分配情况；</li> <li>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；</li> <li>10) 中国证监会规定的其他事项。</li> </ol> <p>集合资产管理计划年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格的会计师事务所审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。</p> <p>计划成立不足 3 个月以及存续期间不足 3 个月的，管理人可以不编制当期年度报告。如基金业协会制定了相关信息披露规则，则从其规则执行。</p> <p>（4）临时报告</p> <p>本计划存续期间，发生对计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件，资产管理人必须按照法律法规和中国证监会的有关规定，在事件发生之日起五日内向投资者披露。</p>
	<p><b>信息查询方式</b></p>	<p>管理人有权采用下列一种或多种方式向资产委托人提供报告或进行相关通知。</p> <p>（1）传真、电子邮件或短信</p> <p>如资产委托人留有传真号、电子邮箱或手机号等联系方式，管理人可通过传真、电子邮件或短信等方式将报告信息告知资产委托人。</p> <p>（2）邮寄服务</p> <p>管理人可向资产委托人邮寄年度报告等有关本计划的信息。资产委托人</p>

		<p>在销售机构留存的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，资产委托人应当及时以书面方式或以管理人规定的其他方式通知管理人。</p> <p>(3) 管理人网站</p> <p>管理人通过管理人网站向资产委托人提供报告和信息查询，内容包括净值报告等。</p>
<p>计划 代销 机构</p>	<p>若有，详见公司公告。</p>	