

野村东方国际君和 2 号集合资产管理计划说明书

特别提示

为规范资产管理业务的运作，保护投资者合法权益，明确资产管理合同当事人的权利与义务，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国证券法》、《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《运作管理规定》）、《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》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称《内容与格式指引》），和其他有关法律法规，投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立《野村东方国际君和 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（下称“本合同”）。

订立本合同的原则是资产管理合同当事人应遵循平等自愿、诚实信用、公平的原则订立本合同，充分维护本合同各方当事人的合法权益，不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

投资者保证资产管理计划财产的来源及用途合法，并在签订本合同前，已经过了风险承受能力测评，签署了风险揭示书，投资者阅知本合同全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险。

管理人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。管理人对委托资产未来的收益预测仅供投资者参考，不构成管理人保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

托管人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务，但不保证委托资产本金不受损失或取得最低收益。

管理人应对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”）进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表证券投资基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。



第 1 节 基本信息

| 序号 | 项目 | 条款 | | |
|------|--|---|-----|--|
| 1.1 | 计划名称 | 野村东方国际君和 2 号集合资产管理计划 | | |
| 1.2 | 计划类型 | 混合类集合资产管理计划 | | |
| 1.3 | 风险收益特征 | 本计划具有中高风险（R4）特征。 | | |
| 1.4 | 风险承担安排 | 投资者自行承担风险和损失。本计划不以任何形式保本保收益。 | | |
| 1.5 | 管理人 | 野村东方国际证券有限公司 | | |
| 1.6 | 托管人 | 东方证券股份有限公司 | | |
| 1.7 | 投资经理 | <p>本计划的投资经理由管理人指定。</p> <table border="1"> <tr> <td>肖令君</td> <td>中国人民大学硕士。超过 15 年股票市场投资研究工作经历。曾任摩根士丹利亚太区运营部高级经理，未来资产管理公司大消费行业高级分析师，财通证券资产管理有限公司权益投资经理、研究总监、私募投资部高级经理、投资委员会主任。</td> </tr> </table> <p>上述投资经理已取得基金业从业资格，投资经理资格，具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> | 肖令君 | 中国人民大学硕士。超过 15 年股票市场投资研究工作经历。曾任摩根士丹利亚太区运营部高级经理，未来资产管理公司大消费行业高级分析师，财通证券资产管理有限公司权益投资经理、研究总监、私募投资部高级经理、投资委员会主任。 |
| 肖令君 | 中国人民大学硕士。超过 15 年股票市场投资研究工作经历。曾任摩根士丹利亚太区运营部高级经理，未来资产管理公司大消费行业高级分析师，财通证券资产管理有限公司权益投资经理、研究总监、私募投资部高级经理、投资委员会主任。 | | | |
| 1.8 | 投资顾问 | 无 | | |
| 1.9 | 收益分配方式 | 本计划的默认分红方式为现金分红，投资者可以选择现金分红或者红利再投资分红方式 | | |
| 1.10 | 收益分配频率 | 管理人决定资产管理计划收益分配的频率、方式、比例、金额、基准日与发放日； | | |
| 1.11 | 计划存续期限 | 本计划管理期限为自计划成立日起 10 年 | | |
| 1.12 | 初始份额面值 | 人民币 1.00 元 | | |

第 2 节 管理人与托管人情况

| 序号 | 项目 | 条款 | | | | | | | | |
|-------|---------------------------|--|-----|--------------|-----|---------------------------|-------|---------------------------|-------|-----|
| 2.1 | 管理人简况 | <table border="1"> <tr> <td>名称:</td> <td>野村东方国际证券有限公司</td> </tr> <tr> <td>住所:</td> <td>上海市黄浦区淮海中路 381 号中环广场 10 楼</td> </tr> <tr> <td>通信地址:</td> <td>上海市黄浦区淮海中路 381 号中环广场 10 楼</td> </tr> <tr> <td>法人代表:</td> <td>孙冬青</td> </tr> </table> | 名称: | 野村东方国际证券有限公司 | 住所: | 上海市黄浦区淮海中路 381 号中环广场 10 楼 | 通信地址: | 上海市黄浦区淮海中路 381 号中环广场 10 楼 | 法人代表: | 孙冬青 |
| 名称: | 野村东方国际证券有限公司 | | | | | | | | | |
| 住所: | 上海市黄浦区淮海中路 381 号中环广场 10 楼 | | | | | | | | | |
| 通信地址: | 上海市黄浦区淮海中路 381 号中环广场 10 楼 | | | | | | | | | |
| 法人代表: | 孙冬青 | | | | | | | | | |

2.2 托管人简况

| | |
|-------|------------------------------|
| 官方网站: | https://www.nomuraoi-sec.com |
| 联系人: | 冯昉中 |
| 联系电话: | 021 6619 9056 |
| 名称: | 东方证券股份有限公司 |
| 住所: | 上海市黄浦区中山南路 119 号东方证券大厦 |
| 通信地址: | 上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 3 层 |
| 负责人: | 金文忠 |
| 联系人: | 刘东海 |
| 联系电话: | 021-63325888-3399 |

第 3 节 认购事项

| 序号 | 项目 | 条款 |
|-----|------|---|
| 3.1 | 募集机构 | 直销机构（管理人）和代销机构（管理人委托的符合法律法规及监管机构规定的销售机构）（如有）。管理人可根据情况变更或增减募集机构。具体募集机构名单、联系方式以管理人公告为准。 |
| 3.2 | 募集对象 | <p>本资产管理计划仅向符合《运作管理规定》规定的“合格投资者”募集。</p> <p>“合格投资者”指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于本计划不低于人民币 40 万元（不含认购费或参与费）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：</p> <ol style="list-style-type: none"> 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 1,000 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）； |

6. 中国证监会视为合格投资者的其他情形。
- 法律法规、监管机构、自律组织对于合格投资者认定将来另有规定的，从其规定。
- 3.3 募集期限
- 本计划初始募集期自本计划份额发售之日起不超过 60 天。开放募集具体时间由管理人届时在官方网站上披露。
- 管理人有权根据认购情况提前结束募集期。管理人决定提前终止募集，并在管理人网站及时公告，即视为履行完毕提前终止募集的程序。管理人发布公告提前结束募集的，本计划自公告之时起不再接受认购申请。
- 3.4 认购程序和确认
1. 募集机构受管理人委托，进行投资者适当性调查，及投资者人数的穿透核查，以确认合格投资者身份和人数；
 2. 投资者在遵守本合同的前提下，在规定的时间和处理规则内进行认购申请，签署本合同，提交相应的文件，办理手续，在指定账户中备足用于认购的货币资金，届时以募集机构的具体规定为准；
 3. 募集机构受理认购申请仅代表该募集机构收到了认购申请，并不表示对该申请的确认，申请是否有效以注册登记机构的确认为准。认购申请采取时间优先、金额优先原则进行确认。投资者于 T 日提交认购申请后，一般可于 T+2 日后在募集机构查询认购确认情况。投资者应当及时查询和确认认购申请的相关信息。
 4. 确认无效的认购申请，募集机构将退还投资者已缴纳的款项。
 5. 认购申请一经受理，不得撤销。
- 3.5 合规投资者人数上限
- 本计划仅向合格投资者募集，并按《运作管理规定》第三条的规定合并计算投资者人数，本计划的合格投资者人数不得超过 200 名。若法律法规将来另有规定的，从其规定。
- 3.6 认购价格
- 本计划认购采用金额申请的方式。认购价格为人民币 1.00 元/份额。
- 3.7 认购费用
- 本计划认购费率为 1.0%，但募集机构有权不时做出豁免或调减收取投资者认购费用的决定。认购费用由投资者承担，在认购资产管理计划份额时由募集机构收取，不列入资产管理计划财产，主要用于因本资产管理计划的市场推广、销售而发生的各项费用。
- 认购费用的计算方法采用外扣法，即：
- $$\text{净认购金额} = \frac{\text{认购金额}}{1 + \text{认购费率}}$$
- $$\text{认购费} = \text{认购金额} - \text{净认购金额}$$
- 认购费用的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入资产管理计划财产。
- 3.8 认购份额的计算
- 本计划采用金额认购的方式，认购份额的计算方法如下：

$$\text{认购份额} = \frac{\text{净认购金额} + \text{募集期利息}}{\text{认购价格}}$$

认购份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入资产管理计划财产。

- 3.9 认购资金的管理及利息处理方式 管理人应当将资产管理计划募集期间投资者的认购资金存入资产管理计划募集结算专用账户，在资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用。投资者的认购参与款项（不含认购费用）加计其在募集期间形成的利息在资产管理合同生效后折算成相应的计划份额归投资者所有，其中利息折算份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。
- 3.10 最低认购金额 本计划最低认购金额为人民币 40 万元，追加认购的最低金额为 1 万元。上述认购金额均为净认购金额，不包含认购费用。认购资金应以人民币货币资金形式交付。
本计划直销清算账户和募集机构委托募集账户（如有）等信息，具体以募集机构网站公示、相关业务办理说明或通知为准。
- 3.11 认购资金支付方式 认购资金应以人民币货币资金形式交付。
- 3.12 认购份额锁定期 投资者认购本计划份额，经注册登记机构确认的认购成功的份额自本计划募集期结束之日起锁定 3 个月，锁定期内管理人有权拒绝投资者对该等份额的退出申请。

第 4 节 计划的成立与备案

| 序号 | 项目 | 条款 |
|-----|--------------|--|
| 4.1 | 计划的成立条件 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 募集金额达到本合同约定的初始募集规模，且不低于人民币 1,000 万元； 2. 投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人； 3. 募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。 |
| 4.2 | 计划成立与备案 | 资产管理计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当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，并在取得验资报告后公告资产管理计划成立，并书面通知资产托管人。管理人应在资产管理计划成立起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。 |
| 4.3 | 计划备案完成前的投资活动 | 资产管理计划在成立后备案完成前，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。 |
| 4.4 | 计划未达到成立条件 | 资产管理计划募集期届满，未达到成立条件的，管理人应当承担的责任： |

的处理

1. 以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
2. 在募集期届满后三十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，具体以注册登记机构记录为准。

第 5 节 参与、退出与转让

| 序号 | 项目 | 条款 |
|-----|----------------|--|
| 5.1 | 参与和退出场所 | <p>本计划运作期间的销售机构：直销机构（管理人）和代销机构（管理人委托的销售机构）（如有）。管理人可根据情况变更或增减资产管理计划的销售机构。具体销售机构名单、联系方式以管理人公告为准。</p> <p>投资者/份额持有人应当在销售机构办理资产管理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资产管理计划份额的参与和退出。</p> |
| 5.2 | 参与和退出开放日 | <p>本计划自成立后每周第一个交易日为开放日（如本周无交易日，则本周不设置开放日），每次开放 1 天。投资者/份额持有人可在本计划的开放日办理资产管理计划份额的参与、退出业务，新参与确认的份额需满足锁定期要求，即自参与的开放日起 3 个月内不得退出，持有期末满足锁定期要求的份额不得退出，具体开放安排以管理人公告为准。</p> <p>若中国证监会会有新的规定，或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，管理人将视情况对上述开放日进行相应的调整并告知投资者。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p> |
| 5.3 | 临时开放日 | <p>在合同变更基于份额持有人利益考虑的情形下或法律法规、监管规定及自律规则发生修订，或者存在其他监管机构允许情形时，管理人有权设置临时退出开放日，临时退出开放日内份额持有人仅可办理退出业务，不得办理参与业务。</p> <p>临时开放日的具体安排以管理人公告为准。</p> |
| 5.4 | 参与的出资方式 | 本计划的参与出资方式以人民币货币资金形式交付。 |
| 5.5 | 参与和退出的方式、价格及程序 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 投资者于存续期首次参与本计划的，应在参与申请前与管理人、托管人签署本合同； 2. 在直销机构参与的投资者参与本计划份额，应在开放日 15:00 点前提交参与申请，在直销机构参与的投资者还应在开放日 15:00 点前将参与资金从在中国境内开立的自有银行账户划转至直销清算账户，份额持有人退出本计划份额，需满足拟退出份额已持有超过 3 个月（按先进先出原则计算），并应在开放日 15:00 点前提交退出申请； 3. 在代销机构处参与的投资者按该销售机构的规定缴付资金； 4. 本计划以开放日收盘后的资产管理计划财产份额净值作为参与、退出份额的价格。 |

5. 投资者参与资产管理计划份额时，遵循“时间优先、金额优先”原则，若接受全部投资者的参与申请，将使本计划的份额持有人人数超过 200 人，则在份额持有人人数不超过 200 人的范围内，提交参与申请在前的优先予以确认，同时提交参与申请的，则参与金额大的优先予以确认。
6. 投资者在提交参与申请时须按照销售机构规定的方式全额支付参与资金，在提交退出申请时须持有足够的资产管理计划份额余额，并且应确保拟退出的份额已持有超过 3 个月（按先进先出原则计算）否则所提交的参与、退出申请无效而不予确认。
7. 在直销机构参与的投资者参与申请可以在参与申请提出之日 15:00 点前撤销，在参与申请提出之日 15:00 点后不得撤销；退出申请可以在退出申请提出之日 15:00 点前撤销，在退出申请提出之日 15:00 点后不得撤销；
8. 在代销机构处参与的投资者按该销售机构的规定提出撤销申请。

销售机构受理参与或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或退出申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对投资者（份额持有人）参与、退出申请的有效性进行确认。

5.6 参与和退出申请的确认

1. 管理人在 T+2 日内对 T 日（此处的 T 日指参与开放日）参与申请的有效性进行确认，投资者可在 T+3 日于销售机构处查询其申请是否成功。若参与申请不成功，管理人应在 T+2 日（不含）起 5 个工作日内返还投资者已缴纳的款项（不含期间利息）；
2. 管理人在 T+2 日内对 T 日（此处的 T 日指退出开放日）退出申请的有效性进行确认，若份额持有人退出申请确认成功，管理人应在 T+4 个工作日内将退出款项从托管账户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各销售机构，由销售机构向份额持有人支付。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定办理；
3. 管理人在不损害投资者/份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 10 个工作日告知投资者/份额持有人。管理人网站发布公告即视为履行了告知义务。

5.7 参与和退出的金额限制

在资产管理计划存续期参与开放日，投资者首次参与金额应不低于人民币 40 万元（不含参与费用）且符合合格投资者标准，对于份额持有人在资产管理计划存续期参与开放日追加参与的，追加参与金额不低于 1 万元（不含参与费用）。

份额持有人持有的本计划份额对应的资产净值高于人民币 40 万元时，可以选择全部或部分退出；份额持有人在部分退出后持有的本计划份额对应的资产净值低于人民币 40 万元（不含）的，必须选择一次性退出全部本计划份额，份额持有人没有一次性全部退出所持份额的，管理人应将该份额持有人所持份额做全部退出处理。

5.8 参与和退出的费用

1. 参与费:

本计划参与费率为 1.0%，但销售机构有权不时做出豁免或调减收取投资者参与费用的决定。参与费用由投资者承担，在参与资产管理计划份额时由销售机构收取，不列入资产管理计划财产，主要用于因本资产管理计划的市场推广、销售而发生的各项费用。

2. 退出费:

本计划设置退出费。持有不满 1 周年的份额，退出费率为 1.0%；持有满 1 周年的份额，退出费率为 0%，但销售机构有权不时做出豁免或调减收取份额持有人退出费用的决定。退出费用由投资者承担，在退出资产管理计划份额时由销售机构收取，不列入资产管理计划财产。

5.9 参与份额的计算

参与份额的计算公式如下:

$$\begin{aligned} \text{净参与金额} &= \frac{\text{参与金额}}{1 + \text{参与费率}} \\ \text{参与费} &= \text{参与金额} - \text{净参与金额} \\ \text{参与份额} &= \frac{\text{净参与金额}}{\text{参与价格}} \end{aligned}$$

参与价格为参与开放日本计划的份额净值。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资产管理计划财产。

5.10 退出金额的计算

退出金额的计算公式如下:

$$\begin{aligned} \text{退出总金额} &= \text{退出份额} \times \text{退出价格} \\ \text{退出费} &= \text{退出总金额} \times \text{退出费率} \\ \text{净退出金额} &= \text{退出总金额} - \text{退出费用} - \text{业绩报酬 (如有)} \end{aligned}$$

退出价格为退出开放日/临时开放日本计划的份额净值。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资产管理计划财产。

5.11 巨额退出的认定

单个退出开放日内，本计划净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之余额）超过上一日计划份额总份数的 20%，即认为是发生了巨额退出。

5.12 巨额退出处理方式

当本计划出现巨额退出时，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、部分延期退出、延期支付。

1. **全额退出:**当管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序执行；
2. **部分延期退出:**当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者的退出申请可能对本计划的资产净值造成较大波动时，管理

人在当日接受退出计划份额不低于上一日计划总份额的 20%的前提下, 对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请, 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; 未受理部分, 份额持有人在提交退出申请时可以选择延期退出或取消退出。选择延期退出的, 将自动转入下一个开放日(含临时开放日)继续退出, 直到全部退出为止; 选择取消退出的, 当日未获受理的部分退出申请将被全部撤销。延期的退出申请与下一开放日(含临时开放日)退出申请(如有)一并处理, 无优先权并以下一个开放日(含临时开放日)的资产管理计划财产份额净值为基础计算退出金额, 以此类推, 直到全部退出为止。本计划不就延期退出份额的相应款项计算利息。如份额持有人在提交退出申请时未作明确选择, 份额持有人未能退出部分作自动延期退出处理;

3. **延期支付:**当管理人认为支付份额持有人的退出申请有困难或认为因支付份额持有人的退出申请而进行的财产变现可能会对资产管理计划净值造成较大损害时, 管理人可以选择接受全部的退出申请, 同时延缓支付退出款项, 延缓支付的期限为开放日后 10 个工作日(含)内, 如需额外延缓支付退出款, 管理人可与份额持有人另行约定, 并应以书面或其他形式通知提交退出申请的份额持有人。

5.13 **部分延期退出与延迟支付的通知** 当发生上述部分延期退出或延期支付时, 管理人应在 3 个工作日内在管理人网站公告, 并说明有关处理方法。

5.14 **拒绝投资者的参与申请的情形**

1. 如接受该笔申请, 将导致本份额持有人人数超过 200 人;
2. 当投资者不符合合格投资者的规定, 违反反洗钱、制裁及打击恐怖融资、反贪污贿赂及其他金融犯罪等相关法律法规, 未向资产管理计划销售机构或管理人提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件, 未配合资产管理计划销售机构或管理人进行的尽职调查与反洗钱工作或管理人审核后认为其不合格的其他情形;
3. 本合同约定的管理人可以拒绝投资者参与的其他情形;
4. 法律法规规定或中国证监会规定的及本合同约定的其他情形。

5.15 **暂停投资者的参与申请的情形**

1. 根据市场情况, 管理人无法找到合适的投资标的, 或其他可能对资产管理计划业绩产生负面影响, 从而损害现有份额持有人的利益的情形;
2. 管理人认为会有损于现有份额持有人利益;
3. 发生本合同规定的暂停资产管理计划财产估值的情形;
4. 因不可抗力导致管理人无法受理与处理投资者的参与申请的情形;
5. 本合同约定的管理人可以暂停投资者参与的其他情形;
6. 法律法规规定或中国证监会规定的及本合同约定的其他情形。

管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时, 应当告知投资者。在暂停参与的情形消除时, 管理人应及时恢复参与业务的办理并告知投资者。投资者参与申请被拒绝的, 相关参与款项将无息退还给投资者。

- 5.16 暂停份额持有人的退出申请的情形
1. 交易场所非正常停市；
 2. 非管理人原因导致的计划无法正常运行；
 3. 因不可抗力导致管理人无法支付退出金额情形；
 4. 发生本合同规定的暂停资产管理计划财产估值的情形；
 5. 法律法规规定或中国证监会规定的及本合同约定的其他情形。
- 发生上述情形之一且管理人决定暂停退出的，管理人应当及时通知（在管理人网站进行信息披露）投资者。已接受的退出申请，管理人应当足额支付退出金额；如暂时不能足额支付，应当按单个申请退出的份额持有人经确认的退出金额占所有申请退出的份额持有人经确认的退出总金额的比例将可支付金额公平地分配给申请退出的份额持有人，其余部分将延迟至本计划通过变现资产足以支付未付清部分时支付。
- 在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并及时通知（在管理人网站进行信息披露）投资者。
- 5.17 锁定期份额退出申请的处理
- 对于持有期未满足锁定期要求的份额，管理人有权拒绝份额持有人的退出申请。
- 5.18 计划份额转让
- 在不违反法律法规及监管部门的相关规定的前提下，份额持有人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。转让期间及转让后，本计划投资者人数合计不得超过 200 人。
- 5.19 计划份额的非交易过户
- 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份额持有人账户转移到另一份额持有人账户的行为。非交易过户包括继承、捐赠、司法强制执行以及其他符合规定的情况，对于符合条件的非交易过户的申请按登记结算机构的有关规定办理，非交易过户期间及过户后，本计划投资者人数合计不得超过 200 人。
- 5.20 管理人自有资金的认购/参与方式和比例
- 管理人可以自有资金认购/参与本计划，管理人自有资金参与本计划份额不超过本计划总份额的 15%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时调整达标。管理人每次自有资金参与应提前 5 个工作日告知份额持有人和托管人。
- 5.2 管理人自有资金的收益分配
- 管理人自有资金参与持有的计划份额与其他投资者持有计划份额享有相同的分红和收益权。
- 5.22 管理人自有资金退出的条件
1. 管理人自有资金参与本计划份额的持有期限不少于 6 个月，在符合法律、行政法规等关于自有资金退出规定和本合同约定的情况下，可以与其他投资者同样办理退出业务。
 2. 因资产管理计划规模变动等客观因素导致自有资金参与本计划份额被动超过法律、法规及本合同规定比例上限的，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。
 3. 管理人每次自有资金退出应提前 5 个工作日告知投资者和托管人，告知方式为管理人指定披露网站信息披露。

4. 为应对集合资产管理计划巨额退出以解决流动性风险,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,管理人以其自有资金参与及后续的退出可以不受本条前述约定限制。出现上述情形时,管理人应及时告知投资者和托管人,并向相关派出机构报告。

第 6 节 计划的投资

| 序号 | 项目 | 条款 |
|-----|--------|---|
| 6.1 | 投资目标 | 本计划通过构建由权益类及固定收益类证券组成的投资组合,精选投资标的,以获取合理的超额回报。同时,以降低波动和控制回撤为重要任务,力求稳健的为客户实现资产保值增值的目标。 |
| 6.2 | 业绩比较基准 | 本计划不设业绩比较基准。 |
| 6.3 | 投资方法 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 资产配置:根据管理人内部综合风险评价模型评估、识别本合同约定的投资范围内可投资资产的风险,设立拟投资标的备选库。采用“至上而下”的分析方法,预判投资范围内拟投资标的类别的市场收益率情况,设置绝对收益的目标。在本合同的限制条件下平衡风险与预期收益,根据货币和信用的宽、紧环境研判宏观市场环境所处维度,以此为依据进行大类资产配置; 2. 投资组合的调整:本计划采取积极跟踪市场短期变化,根据市场机会或风险,主动调整预先设置的组合配置比例。 |
| 6.4 | 投资范围 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 权益类:包括沪、深交易所依法发行上市的股票及存托凭证(含一级(新股申购)、二级市场,创业板、科创板)、港股通标的股票、公开募集股票型证券投资基金、公开募集混合型证券投资基金; 2. 固定收益类资产:指依法在银行间市场和/或交易所市场上市交易的国债、中央银行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、金融债券(含政策性金融债)、企业债券、公司债券(含可转换公司债券、可交换公司债券、项目收益债、非公开发行公司债)、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、国际机构债券、公开募集债券型证券投资基金,以及用于现金管理的货币市场基金、同业存单、现金、银行存款,债券逆回购; 3. 金融衍生品类资产:指依法在交易所市场交易的股指期货、股指期权、交易所 ETF 期权、国债期货; 4. 公开募集基础设施证券投资基金; 5. 债券正回购。 |
| 6.5 | 特别揭示 | 本计划将参与证券回购。 |
| 6.6 | 投资比例 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 投资于权益类资产占资产管理计划资产总值的比例低于 80%(不含); |

2. 投资于固定收益类资产占资产管理计划资产总值的比例低于 80%（不含）；
3. 投资于金融衍生品账户权益占资产管理计划总资产的比例不高于 20%（含）；
4. 投资于 ST 股票（依市值计算）占资产管理计划资产总值的比例不高于 5%（含）（不含退市整理期）；
5. 投资于港股通标的股票（依市值计算）占资产管理计划资产总值的比例不高于 50%（含）；
6. 公开募集基础设施证券投资基金（依市值计算）占资产管理计划总资产的比例低于 20%（不含）。

本计划投资于资产管理产品的，计算本计划财产的资产总值时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

6.7 投资比例超限处理

1. 本计划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管理人之外的因素致使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本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起的 15 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，管理人应及时向中国证监会派出机构报告。
2. 本计划终止前，管理人有权对资产管理计划财产所投资证券进行变现，因此造成投资比例不符合法律法规或者本合同规定的，不视为投资比例超限。

6.8 投资限制

本资产管理计划财产严格按照《管理办法》、自律规则、其他有关规定，及本合同约定的投资范围进行投资，其中：

1. 本计划的总资产不得超过本资产管理计划净资产的 140%；
2. 债券正回购融入资金余额不得超过上一日资产净值的 40%，债券逆回购不得超过上一日计划资产净值的 100%。中国证监会另有规定的除外；
3. 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%，全部资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%，银行活期存款、国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债等中国证监会认可的投资品种除外；
4. 本计划参与股票、可转债、可交换债等发行申购时，本资产管理计划所申报的金额不得超过本资产管理计划的总资产，本资产管理计划所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；
5. 本计划持有一家上市公司的股票，其投资比例必须小于该股票总股本的 5%（港股除外）；
6. 资产管理人管理的全部资产管理计划持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

7. 本计划不得投资于主体评级低于 AA 的信用债（无主体评级按照债项评级确定，中债资信不纳入参考）；本计划投资的短期融资券、超短期融资券的主体评级不得低于 AA，且债项评级（如有）不得低于 A-1；
8. 开放退出期内，本计划资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%；
9. 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计划资产净值的 20%。
10. 法律法规及监管部门规定的其它投资限制。

本计划评级机构不含中债资信评估有限责任公司，评级结果取最新。

6.9 投资策略

本计划基于对中国经济和 A 股市场长期看好的基本判断，采用自上而下的资产配置与自下而上的选股相结合的策略，构建投资组合。本集合计划审慎判断市场整体估值水平和行业景气度，甄选优质成长个股，匹配组合的整体估值水平与市场风险收益比，通过持有来获取时间价值，实现投资目标。

1. 股票投资策略

- a) 自上而下的资产配置策略：根据宏观经济、政策环境、资金供求、市场估值水平以及经济运行周期的变化，进行积极的战略性大类资产配置。大类资产配置过程中重点把握：对宏观经济总量与结构发展趋势以及宏观经济指标的分析判断；全方位的行业景气度研究和比较；对股票、债券市场性价比和隐含报酬率的评估、分析等因素；
- b) 个股选择策略：管理人秉承价值投资理念，深入分析企业的内在价值增长潜力，识别公司长期增长的驱动因素，把握公司的可持续竞争优势。主要投资对象为行业竞争格局不断改善、财务基础稳固、竞争优势确定以及具备持续增长潜力的公司。利用 SWOT 和波特五力模型，从行业环境、竞争格局、内外部压力、财务指标、公司治理等多个方面，对公司进行投资价值评估，制定相应策略；
- c) 左侧交易、逆向投资的交易策略：本计划以绝对收益为投资导向，不追随市场情绪，严格按照既定投资框架选择标的，秉承价值投资理念，讲求每一笔投资的性价比和风险收益比。根据市场、个股状况和资金供求水平，采用逆向投资、低估买入持有、高估卖出等交易策略，围绕企业的内在价值进行布局，力争企业赚取长期增长以及市场错误定价的收益；
- d) 对于 IPO 打新、港股、海外存托凭证投资等证券类别，本计划将在深入研究的基础上，通过定性分析、定量分析等方式，筛选相应的存托凭证投资标的，力求控制风险、实现收益。

2. 固定收益类资产投资策略

- a) 债券投资策略：本计划将依据宏观经济发展态势、央行货币政策以及债券市场供需情况来判断短期利率走势，并以此为基础进行债券类属配置、调整债券组合久期。主要考察的因素有：GDP 增长率、CPI、货币供应增长率及利率政策、信贷政策等。个券选择方面，管理人将在充分考虑债券到期收益率、流动性指标和信用风险级别的基础上，选择合适的品种进入债券池。到期收益率是评价债券投资价值的基本指标，本计划将选择同久期品种中到期收益率排名靠前的债券。考察流动性指标时，本计划将选择买卖价差小、交易量大、换手率高等流动性较好的品种进行投资。考察信用风险评级时，央票、国债与金融债视为无信用风险品种；对于企业债和公司债，管理人将重点分析发行人的债务结构、盈利状况、现金流状况以及募集资金投向对发行人未来财务状况的影响，同时结合对担保人信用等级的评估，以确定债券的信用风险，回避高风险品种。
- b) 货币市场基金投资策略：本计划通过分析货币市场基金的业绩、规模、流动性（赎回到帐时间）、基金经理的从业经验等指标来挑选合适的品种作为投资标的。从收益性考虑，本计划将优先投资过往业绩较好、基金经理从业经验丰富的货币市场基金，同时通过持续跟踪投资标的的运行状况，以适时动态调整投资组合。从流通性考虑，本计划将优先投资规模较大、赎回到帐时间较短的货币市场基金，同时采取分散投资策略，避免大规模退出时触发基金巨额退出条款。
- c) 债券型证券投资基金投资策略：本计划将投资市场上的纯债基金和一级债基。对开放式基金，本计划将主要从基金历史业绩、管理团队稳定性、基金规模以及基金资产投资组合四个方面进行考察，力求分享优秀基金管理人的投资成果。对于封闭式基金，本计划还将重点考察基金到期日和折价率，以获取封闭式基金价值回归带来的收益。
- d) 回购策略：资产管理计划在基础组合的基础上，使用基础组合持有的债券进行回购融入短期资金滚动操作，投资于收益率高于融资成本的其它获利机会。
- e) 可转/交债投资策略：管理人将积极把握新上市可交换债券的申购收益、二级市场机会以及偏股型和平衡型可交换债的战略结构性投资机遇，适度把握可交换债券回售、赎回、修正相关条款博弈变化所带来的投资机会及套利机会，选择具有吸引力标的进行配置。

3. 股指期货投资策略

资产管理计划使用的股指期货投资策略主要用于调节权益投资的风险敞口，快速调整投资组合资产配置比例，以及寻找套利机会。子策略包括风格轮动、套利策略、套期保值、投机交易等。

4. 国债期货的投资策略

资产管理计划参与国债期货的主要目的是套期保值和套利，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。管理人将根据不同的市场行情动态管理国债期货合约数量，在控制风险的前提下萃取收益。

5. 期权投资策略

本计划投资期权的主要目的是回避市场风险和实施套利策略。期权套利是一个较为标准的投资策略，牵涉到同时买卖不同的认购期权、认沽期权、以及对应的现货或期货。管理人通过匹配期权组合价值与现货（或期货）组合价值来构造一个无风险投资组合，在到期日或更早赚取其中价差。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。

6. 存托凭证投资策略

本计划将积极关注、深入分析并论证存托凭证的投资机会，通过综合分析行业景气度、行业竞争格局、公司基本面、公司治理状况、公司估值水平、公司业务持续性和盈利确定性等多方面因素，并结合市场未来走势等判断，精选存托凭证。

6.10 投资禁止行为

1. 承销证券；
2. 直接投资于商业银行信贷资产；
3. 违反规定向他人贷款或提供担保；
4. 违规为地方政府及其部门提供融资，要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；
5. 直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外）；
6. 从事承担无限责任的投资；
7. 利用资产管理计划财产为资产管理计划持有人之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送；
8. 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；
9. 法律法规以及本合同规定禁止从事的其他行为。

6.11 建仓期

本计划的建仓期为自计划成立之日起不超过 6 个月。建仓期的投资活动，应当符合本计划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、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除外。建仓期结束后，管理人应当使本计划的投资组合的投向和比例符合以上约定。

第 7 节 计划的费用

| 序号 | 项目 | 条款 |
|-----|-------------|---|
| 7.1 | 资产管理业务费用的种类 | <p>本资产管理计划运营涉及费用包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 管理人收取的固定管理费； 2. 托管人收取的托管费； 3. 管理人依据本合同收取的业绩报酬； 4. 资产管理计划相关账户的开立及维护费用； 5. 投资证券、证券投资基金等产生的交易费用； 6. 资产管理计划投资产生的增值税及附加税； 7. 资产管理计划成立后与资产管理计划有关的会计师费、审计费、律师费、仲裁费、诉讼费、保全费； 8. 资产管理计划成立后的资产管理计划信息披露费用； 9. 资产管理计划财产的银行汇划费用； 10. 按照法律法规及本合同的约定可以在资产管理计划财产中列支的其他费用。 |
| 7.2 | 管理费 | <p>管理费指支付给管理人的报酬，分为以资产管理计划财产净值作为计算基数按日以约定的管理费率提取的固定管理费，与以资产管理计划财产增值额作为计算基数的浮动管理费。为避免歧义，以下所述管理费特指固定管理费，浮动管理费称为业绩报酬。</p> <p>固定管理费：费率为 1.5%/年，按每年 365 日，每日计提，按季支付。计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的固定管理费。</p> <p>固定管理费计算公式：</p> $H = E \times 1.5\% \div 365$ <p>H 为每日应计提的固定管理费</p> <p>E 为前一日的资产管理计划财产净值</p> <p>固定管理费首日计提时，以本资产管理计划成立时的资产管理计划规模为计提基准。</p> |
| 7.3 | 托管费 | <p>托管费指支付给托管人的报酬。就托管人为资产管理计划所提供的托管服务，在其提供服务的期限内支付基于资产管理计划财产净值的托管费。本资产管理计划的托管费，费率为 0.01%/年，按每年 365 日，每日计提，逐日累计至每季季末，按季支付。计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的托管费。</p> <p>托管费计算公式：</p> $H = E \times 0.01\% \div 365$ |

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的资产管理计划财产净值

托管费首日计提时,以本资产管理计划成立时的资产管理计划规模为计提基准。

- 7.4 业绩报酬 以资产管理计划财产增值额作为计算基数的浮动管理费,按以下规定计提。
- 7.5 业绩报酬提取原则 本计划的管理人有权决定就投资者每笔认购/参与的资产管理计划份额,就超过业绩报酬计提基准部分按约定比例收取业绩报酬。业绩报酬计提基准日分别为退出申请日、收益分配登记日和计划终止日。业绩报酬提取时点为退出确认日、收益分配确认日、计划终止确认日。
- 资产管理计划业绩报酬计提按资产管理计划份额“先进先出”的原则计算,即按照资产管理计划份额认购/参与的先后次序进行顺序退出的方式确定该笔投资的认购/参与和退出的份额与对应的金额,且仅在资产管理计划财产分配金额中扣除,当分配金额低于应提取的业绩报酬时,业绩报酬以分配金额为限。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。
- 7.6 业绩报酬提取的频率 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份额,或资产管理计划财产清算时,管理人按本合同的约定提取业绩报酬的,不受前述提取频率的限制。
- 7.7 业绩报酬计算期间 对于本计划投资者每笔认购/参与的份额而言,业绩报酬计算期间始于上一个成功计提的业绩报酬计提基准日次日,止于业绩报酬计提基准日。若上一个成功计提的业绩报酬计提基准日不存在,则:
1. 若该笔资产管理计划份额通过认购进入本计划,则以资产管理计划成立日为该笔份额的上一个成功计提的业绩报酬计提基准日;
 2. 若该笔资产管理计划份额通过参与进入本计划,以该笔资产管理计划份额参与本计划的开放日为该笔份额的一个成功计提的业绩报酬计提基准日。
- 7.8 业绩报酬计提基准与计提比例
1. 本计划的业绩报酬计提基准为 5% (年化);
 2. 本计划业绩报酬计提比例为资产管理计划份额的期间收益超过同期业绩报酬计提基准部分的 20%。
- 7.9 业绩报酬计算方法 管理人就每笔业绩报酬计算期间对资产管理计划份额收益进行收益率的测算,若该笔份额取得的经单利年化后的收益率超过业绩报酬计提基准,则超出的部分经折算回业绩报酬计算期间的期间收益率,基于资产管理计划份额在上一个业绩报酬计提日的净值按照业绩报酬计提比例计算出该笔资产管理计划份额应计提的业绩报酬。
1. 期间收益率的计算公式:

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

R 为业绩报酬计算期间资产管理计划份额经年化后的收益率；

P_1^* 为业绩报酬计提日资产管理计划份额的单位累计净值；

P_0^* 为上一业绩报酬计提日资产管理计划份额的单位累计净值；

P_0 为上一业绩报酬计提日资产管理计划份额的单位净值；

D 为业绩报酬计算期间的天数除以 365 天。

2. 业绩报酬计提公式如下：

| 年化收益率 (R) | 计提比例 | 业绩报酬 (I) |
|--------------|------|--|
| $R \leq 5\%$ | 0 | 0 |
| $R > 5\%$ | 20% | $I = [(R - 5\%) \times 20\%] \times A \times S \times D$ |

其中：

R 为业绩报酬计算期间该笔份额经年化后的收益率；

I 为对于该笔份额，管理人应计提的业绩报酬；

A 为上一个业绩报酬计提日本计划单位净值；

S 为业绩报酬计算期间该笔份额对应的份额数量；

D 为业绩报酬计算期间的天数除以 365 天；

业绩报酬提取程序

业绩报酬由管理人计算，托管人不承担复核义务，对于符合业绩报酬提取原则的部分，管理人于业绩报酬计算期之后的 5 个工作日内向托管人发送业绩报酬支付指令，托管人依据指令从资产管理计划财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。

7.10 计划的税收

1. 为避免歧义，本合同项下的价款和价外费用均包含增值税及附加税费，但当事人另有约定的除外。
2. 本计划运作涉及的相关税收由投资者承担。根据现行的中国税收征收规定，资产管理计划投资运营过程中发生的增值税应税行为，以资产管理计划管理人作为增值税纳税主体缴纳。本合同各方特别约定，管理人将根据现行有效的税收法规及解释履行对本计划纳税义务的代扣代缴。履行此类纳税责任或义务将导致资产管理计划财产净值降低。若相关税务法律、法规或实施细则发生变化，则经修订的税务法

律、法规和实施细则相应适用。

3. 本计划运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按中国税收法律法规执行。投资者应根据相关法律法规自行缴纳或为其最终投资者代扣代缴税费。
4. 尽管已有前款规定,本计划、管理人保留根据现行或未来中国税收法律法规及解释的规定为投资者代扣代缴任何税收(如适用)的权利(包括这些税收法律法规及解释可能溯及既往的情况)。若本计划、管理人有义务根据现行或未来中国税收法律法规及解释的规定为投资者代扣代缴任何税费,投资者应当对全部各类税费或税务负责,包括就其投资于本计划相关义务施加的任何罚款或罚金,并且应当赔偿管理人就此遭受的任何损失和费用。本计划、管理人保留自投资者的账户中扣除相当于前述纳税义务和税费(包括管理人遭受的罚款或罚金以及损失或费用)款项的权利。如投资者的账户不足以支付此类款项,则不足部分由投资者偿还遭受损失的一方。
5. 本计划应承担的相关税收由托管人根据管理人指令自托管账户划付至管理人账户并由管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

第 8 节 信息披露

| 序号 | 项目 | 条款 |
|-----|------|---|
| 8.1 | 净值报告 | 本计划存续期内管理人于每周前三个工作日内在管理人网站上公布上周末最后一个工作日份额净值。 |
| 8.2 | 季度报告 | <p>管理人每季度向投资者提供资产管理计划季度报告,对报告期内资产管理计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易等做出说明。资产管理计划季度报告由管理人编制,托管人在收到季度报告后 7 个工作日内完成复核,并将复核结果书面通知管理人。托管人复核内容为季度报告中的财务数据(托管人无复核义务的数据除外)。上述报告由管理人于每季度截止日后一个月内向投资者披露。</p> <p>季度报告的内容,包括但不限于下列信息:</p> <ol style="list-style-type: none"> 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. 资产管理计划支付的固定管理费、托管费、业绩报酬等费用,包括计提基准、计提方式和支付方式; 7. 资产管理计划投资收益分配情况; |

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；
9. 中国证监会规定的其他事项。

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。

8.3 年度报告

管理人每年度向投资者提供一次准确、完整的资产管理计划年度报告，对报告期内资产管理计划财产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易等做出说明。资产管理计划年度报告由管理人编制，托管人在收到年度报告后 1 个月内完成复核，并将复核结果书面通知管理人。托管人复核内容为年度报告中的财务数据（本合同约定的托管人无复核义务的数据除外）。上述报告由管理人于每年度截止日后四个月内向投资者披露。

年度报告的内容，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、业绩报酬等费用，包括计提基准、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年度报告。

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。

为避免歧义，管理人向投资者提供的上述报告，不包括反映本计划交易过程的交易明细及交易凭证等信息。

8.4 临时报告

资产管理计划存续期间，发生对本计划持续运营、投资者利益、资产管理计划财产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起五日内向投资者披露；

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。

8.5 报告提供方式

采用下列一种或多种方式向投资者提供报告

1. 电子邮件：如投资者留有电子邮件的联系方式，管理人可通过电子邮件发送相关披露信息；
2. 管理人网站：管理人可通过管理人网站（<https://www.nomuraoi-sec.com/>）向投资者提供报告和信息查询，内容包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告、本计划运作的重要通知；
3. 管理人指定的其他信息披露途径或方式：管理人可通过管理人指定的其他信息披露途径或方式向投资者提供报告和信息查询，内容包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告、本计划运作的重要通知等；
4. 其他中国证监会以及证券投资基金业协会规定的信息披露途径或方式。

第 9 节 合同变更、终止与清算

| 序号 | 项目 | 条款 |
|-----|---------|--|
| 9.1 | 合同变更的条件 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券投资基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订，或相关监管机构或自律组织对本集合计划备案补正意见的要求涉及到合同修改； 2. 因以下事由，投资者签署本合同，认购/参与本计划，即视为资产管理计划投资者同意，由管理人全权处理本计划合同的变更事宜： <ol style="list-style-type: none"> 1) 对本资产管理计划认购、参与、退出、资产管理计划份额转让和非交易过户业务规则（包括但不限于总规模、单个投资者首次认购、参与金额、每次参与金额及持有本资产管理计划总金额限制、锁定期等）进行调整； 2) 调低管理人的固定管理费费率，调低业绩报酬提取比例； 3) 调低参与费退出费参与费、退出费的费率； 4) 按照法律法规或本合同规定，管理人有权变更本合同的其他情形。 3. 对投资者利益无实质性不利影响或修改不涉及本资产管理计划投资者权利义务关系的合同修改； 4. 除上述第 1 至 3 款的规定外，因其他原因需要变更本合同的，经全体投资者、管理人和托管人协商一致后，可对资产管理合同内容进行变更，本合同另有约定的除外。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。 |
| 9.2 | 合同变更程序 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 因上述合同变更的条件 1 的原因变更本合同的，经管理人与托管人协商一致后，可以对本计划合同与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，或根据相关监管机构或自律组织备案补正意见 |

的要求对本合同进行修改,更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定。变更后的资产管理合同由管理人于管理人网站披露,披露满 5 个工作日,且管理人通过官方网站向投资者宣布合同变更生效,此次资产管理合同的变更生效;

2. 因上述合同变更的条件 2 的原因变更合同的,管理人将变更事项以书面形式于管理人网站披露,披露满 5 个工作日,且管理人通过官方网站向投资者宣布合同变更生效,此次资产管理合同的变更生效。管理人于本次合同变更生效日当日以发送合同变更生效公告扫描件的方式通知托管人;
3. 因上述合同变更的条件 3 变更本合同的,由管理人和托管人书面协商一致后处理本资产管理计划合同的变更事宜,但管理人有权自行决定变更的事项除外。管理人将变更事项以书面形式于管理人网站披露,披露满 5 个工作日,且管理人通过官方网站向投资者宣布合同变更生效,此次资产管理合同的变更生效;
4. 因前款合同变更的条件 4 的原因变更合同的,为保护投资者权益,由管理人和托管人事先书面达成一致后,于管理人网站向投资者信息披露,并且管理人须在信息披露后 5 个工作日内以书面或者通过管理人网站(由管理人决定)向本计划投资者发送或者刊登合同变更征询意见函,投资者应在合同变更征询意见函指定的日期内按指定的形式回复书面意见,管理人采取如下权利保障措施及安排:
 - 1) 投资者不同意变更的,管理人保障其退出权利,投资者应在征询意见函发出后的 5 个工作日内或最近一个开放日按照管理人届时具体安排提出退出本计划的申请;
 - 2) 投资者不同意变更且逾期未申请退出的,则管理人有权在征询意见函中说明的意见回复期届满后将其持有的全部资产管理计划份额强制退出本计划(退出价格为强制退出当日资产管理计划财产份额净值),由此发生的相关税费、或有损失由该投资者自行承担;
 - 3) 投资者在征询意见函规定期限内未回复意见且逾期未退出的,视同该投资者同意本合同此次变更,管理人不再另行通知;
 - 4) 投资者回复意见不明确的,则视为该投资者不同意合同变更,按照以上 1)、2) 投资者不同意变更的方式处理。

合同变更征询意见函规定的回复期届满,管理人已履行完成对投资者的权利保障措施与安排,且管理人宣布此次合同变更生效之日起生效。管理人于本次合同变更生效日当日以发送合同变更生效公告扫描件的方式通知托管人。

9.3 管理人和托管人的更换程序

当发生“(1)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、宣告破产,资产管理计划由其他管理人承接;(2)托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,资产管理计划由其他托管人承接”情形时,管理人和托管人的更换程序如下:

1. 管理人的更换程序

- 1) 经全体投资者协商一致，可选择符合条件的其他管理人承接本计划项下管理人相关权利义务。
- 2) 原管理人应做出处理资产管理计划事务的报告，并向新任管理人办理资产管理计划事务的移交手续；新任管理人应与托管人核对资产管理计划财产资产总值和资产净值。
- 3) 管理人更换后，应按其要求替换或删除资产管理计划名称中原管理人名称的字样，并对合同进行变更。

2. 托管人的更换程序

- 1) 经全体投资者及管理人协商一致，可选择符合条件的其他托管人承接本计划项下托管人相关权利义务。
- 2) 原托管人应做出处理资产管理计划事务的报告，并与新任托管人进行资产管理计划资产托管事务的移交手续；新任托管人应与管理人核对资产管理计划财产总值和净值。
- 3) 合同变更后，投资者、管理人和新任托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

9.4 计划的展期

1. 展期的条件

- 1) 资产管理计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和资产管理合同的约定；
- 2) 资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；
- 3) 展期符合资产管理计划的成立条件；
- 4) 中国证监会规定的其他条件。

2. 展期的方式

在法律、法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会允许的范围内以及不损害拒绝参与计划展期的投资者利益的前提下，管理人可以按合同变更的方式就展期事宜向投资者征询意见。为保护投资者权益，管理人应当为拒绝参与本计划展期的投资者提供妥善、合理的权利保障措施及安排。

3. 展期的程序

按照合同变更程序的规定办理。

9.5 计划终止的情形

下列任意情形出现，本计划终止：

1. 资产管理计划存续期届满且不展期；
2. 经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；
3. 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解算、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；
4. 托管人被依法撤销基金托管资格或依法解散、被撤销、被宣告破产，

且在六个月内没有新的托管人承接；

5. 持续五个工作日，投资者少于 2 人（不含）的；
6. 本资产管理计划资产净值低于人民币一千万元，且管理人决定终止本资产管理计划（为免歧义，本资产管理计划资产净值低于人民币一千万元的情况下，本资产管理计划并不必然终止，届时管理人可酌情决定是否终止本资产管理计划）；
7. 未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
8. 法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

管理人应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，前述情形(7)除外。

9.6 计划财产清算

本计划在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划财产清算的有关事项。

9.7 清算小组

1. 本计划财产清算小组成员由管理人、托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员；
2. 本计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

9.8 清算程序

1. 本计划终止情形发生后，由清算小组统一接管资产管理计划财产；
2. 根据资产管理计划财产的情况确定清算期限；
3. 对资产管理计划财产进行清理和确认；
4. 对资产管理计划财产进行估价和变现；
5. 管理人制作除末次清算外各次清算的清算方案（若进行二次或多次清算的）、末次清算报告并经托管人复核其中财务数据（本合同约定的托管人无复核义务的数据除外）；
6. 若进行二次或多次清算的，对除末次清算外的清算分配，根据各次清算方案将已变现资产进行分配；
7. 管理人将除末次清算外各次清算的清算方案（若进行二次或多次清算的）、末次清算报告报相关监管机构并公告；
8. 对资产管理计划剩余财产进行分配。

本计划终止后，资产管理计划财产中仍持有可流通非现金资产的，在 5 个交易日内（含计划终止日当日）由管理人进行强制变现处理；资产管理计划财产中持有的流通受限证券，如未到期回购、未上市新股等，自限制条件解除日起（含解除当日）3 个交易日内完成变现。未变现资产于清算期间损益由全体投资者享有或承担。

9.9 清算费用

清算费用是指清算小组进行资产管理计划财产清算过程中发生的合理费用，清算费用优先从资产管理计划财产中支付。清算费用包括但不限于：

1. 聘请律师以及其他工作人员等所发生的报酬（若有）；

2. 资产管理计划资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
3. 信息披露所发生的费用；
4. 仲裁、保全等维护资产管理计划财产利益所发生的费用；
5. 其他与清算事项有关的费用。

清算期间，本计划仍需收取管理费、托管费。

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外，所有清算费用由管理人向托管人出具指令，由托管人根据管理人符合本合同约定的指令办理支付。

9.10 清算剩余财产清偿顺序 资产管理计划财产清算剩余财产按下列顺序依次清偿：

1. 支付清算费用；
2. 交纳所欠税款；
3. 清偿计划债务（包括但不限于固定管理费、托管费、业绩报酬（如有）等）；
4. 按投资者持有的计划份额比例进行分配。

清算剩余财产未按本款 1 至 3 项约定清偿前，不分配给投资者。

9.11 账册保管 资产管理计划财产清算账册及文件由管理人自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年。

第 10 节 关联交易与利益冲突

1. 本资产管理计划存在的或可能存在的利益冲突的关联交易，包括但不限于：

管理人或将资产管理计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他关联方发行或者承销期内承销的证券将构成关联交易。

投资者签署本合同，认购/参与本资产管理计划份额，即视为已经充分理解并同意上述关联交易。

2. 管理人运用资产管理计划财产从事关联交易，事后应及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露；若从事其他重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并应当提供充分证据证明未损害投资者利益，事后应及时、全面、客观的向投资者和托管人进行临时报告的披露，并向中国证监会相关派出机构报告，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，还应在季报、年报中予以披露。

管理人保证其本身及其关联方将遵循公平、公正原则，平等对待所管理的所有投资产品，并保证不会在这些投资产品之间人为地故意输送利益，公平处理管理的其他投资产品与本资产管理计划的利益冲突。在发生该等利益冲突时，管理人应当视具体利益冲突情形选择在向投资者的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对投资者利益的影响等。但是，管理人并不保证本计划在投资收益或投资风险方面会优于所管理的投资范围与本计划存在重叠和交叉的其他投资产品。管理人管理的其他投资产品的投资损失或投资收益未达预期并不意味着本计划不会出现投资损失或投资收益未达预期的类似情况。投资者不得因为本计划投资收益劣于管理人管理的其他类似投资产品，而向管理人提出任何

损失或损害补偿的要求。

第 11 节 投资者的权利与义务

| 序号 | 项目 | 条款 |
|------|--------|---|
| 11.1 | 投资者的权利 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 分享资产管理计划财产收益； 2. 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产； 3. 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额； 4. 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； 5. 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况； 6. 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。 |
| 11.2 | 投资者的义务 | <ol style="list-style-type: none"> 1. 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； 2. 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受能力问卷，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； 3. 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； 4. 认真阅读并签署风险揭示书； 5. 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； 6. 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； 7. 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； 8. 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为； 9. 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； 10. 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动； |

11. 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

第 12 节 风险揭示与特别说明

| 序号 | 项目 | 条款 |
|------|--------|--------------------------------|
| 12.1 | 投资风险揭示 | 详见《野村东方国际君和 2 号集合资产管理计划风险揭示书》 |
| 12.2 | 特别说明 | 本说明书作为本合同的重要组成部分，与本合同具有同等法律效力。 |

管理人：野村东方国际证券有限公司
(公章)

2022年7月13日



