

计划代码：076420

嘉实金麟添瑞1号集合资产管理计划 计划说明书

资产管理人：嘉实基金管理有限公司

资产托管人：中国工商银行股份有限公司北京市分行

目 录

前言	2
第一节 资产管理计划概况	2
一、资产管理计划的基本情况	2
二、资产管理计划的投资	4
三、资产管理计划的募集	8
四、资产管理计划的参与、退出与转让	11
五、资产管理计划的收益分配	19
六、资产管理计划的费用与税收	19
第二节 资产管理合同主要内容	23
一、当事人的权利与义务	23
二、资产管理计划的成立与备案	30
三、资产管理计划份额的登记	31
四、资产管理计划的财产	32
五、投资指令的发送、确认和执行	35
六、交易及清算交收安排	38
七、越权交易的界定	41
八、资产管理计划的估值和会计核算	43
九、信息披露与报告	49
十、资产管理合同的效力	52
十一、资产管理合同的变更、终止与财产清算	53
十二、违约责任	59
十三、适用法律及争议的处理	60
第三节 资产管理人与资产托管人概况	60
一、资产管理人概况	60
二、资产托管人概况	61
第四节 风险揭示	61
第五节 拟任投资经理简介	70
第六节 销售机构	70
直销机构	70
第七节 销售期间	71

前言

《嘉实金麟添瑞 1 号集合资产管理计划计划说明书》（以下简称“本计划说明书”或“本说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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》”）和其他有关法律法规以及《嘉实金麟添瑞 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）编写。

本说明书阐述了本资产管理计划投资者投资决策有关的全部必要事项，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本说明书。

本资产管理计划根据本说明书所载明资料募集。本说明书由嘉实基金管理有限公司解释。本资产管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本说明书中载明的信息，或对本说明书做出任何解释或者说明。

本说明书根据资产管理合同编写。资产管理计划是约定投资者、资产管理人和资产托管人在资产管理业务过程中的权利、义务及职责的法律文件。投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在资产管理合同存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，该投资者不再是资产管理计划的投资者和资产管理合同的当事人。投资者欲了解投资者的权利、义务，应详细查阅资产管理合同。本说明书和资产管理合同按照中国证监会的要求向中国证券投资基金业协会提请备案，但中国证券投资基金业协会接受本说明书和资产管理合同的备案并不表明其对资产管理计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于资产管理计划没有风险。

除非上下文另有解释或文义另有所指，本说明书及其他资产管理计划文件中的用语与资产管理合同中的同一用语具有相同含义。各用语的具体释义详见资产管理合同第二节“释义”。本说明书与资产管理合同不一致的，以资产管理合同内容为准。

第一节 资产管理计划概况

一、资产管理计划的基本情况

（一）资产管理计划的名称

嘉实金麟添瑞 1 号集合资产管理计划。

（二）资产管理计划的类别

混合类集合资产管理计划。

（三）资产管理计划的运作方式

定期开放式。本计划自成立日起封闭运作直至成立满 1 个月，此后每个星期的第一个工作日对锁定持有期已届满的计划份额开放退出，第二个工作日开放参与；如遇某一星期的工作日不足两天，则该星期不开放且不顺延。本计划存续期内非开放日不开放参与和退出。

本计划成立后，注册登记机构对资产委托人每一笔认购/参与的计划份额分别计算 180 天的“锁定持有期”。其中，认购份额的锁定持有期为自本计划成立日（含）起满 180 天，有效参与份额的锁定持有期为自参与确认日（含）起满 180 天。

（四）资产管理计划的跟踪标的

本计划的跟踪标的为中证指数有限公司编制的中证 500 指数（代码：000905.SH）。

（五）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

投资目标：本计划在追随跟踪标的涨跌幅趋势的基础上，力争为投资者实现投资收益。

主要投资方向及投资比例：

本计划投资于商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值的比例不高于本计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%。

本计划投资于固定收益类资产的投资比例不超过本计划总资产的 100%。

本计划投资于权益类资产的投资比例不超过本计划总资产的 80%。

产品风险等级：根据资产管理人的产品分级标准，本计划属于 R4-中高风险等级的资产管理计划。投资者知悉并同意销售机构在销售过程中可自行确定本计划风险等级并履行适当性匹配义务。

（六）资产管理计划的存续期限

本计划存续期为 10 年，自本资产管理计划成立之日起至 10 个公历年后年度

对应日（如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日）止，但资产管理合同另有约定的除外。具体成立日以管理人届时公告为准。

（七）资产管理计划的最低初始募集规模

本计划成立时资产管理计划财产的初始资产不得低于 1000 万元人民币。

（八）资产管理计划份额的初始募集面值

本计划每份额初始面值为人民币 1.00 元。

（九）资产管理计划的投资者人数限制

本计划的投资者人数不少于 2 人（含 2 人），不超过 200 人。

（十）资产管理计划的估值与核算、信息技术系统等服务机构

本计划注册登记、估值与核算及信息技术系统等服务机构均为嘉实基金管理有限公司。

管理人未委托其他服务机构代为办理本计划的估值与核算、信息技术服务。

（十一）其他

资产管理计划按照面值设定为均等份额，除资产管理合同另有约定外，每份计划份额具有同等的合法权益。

二、资产管理计划的投资

（一）投资目标

本计划在追随跟踪标的涨跌幅趋势的基础上，力争为投资者实现投资收益。

（二）投资范围及比例

资产管理计划的投资范围及比例如下：

1、商品及金融衍生品类资产（投资该类资产的持仓合约价值的比例不高于本计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%）：在证券/期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的股指期货等标准化商品及金融衍生品类资产。

2、固定收益类资产（投资比例不超过本计划总资产的 100%）：国债、政策性金融债、银行存款、同业存单、货币基金、同业存单指数基金、债券回购、债券型公募基金及法律法规或监管机构允许的其他固定收益类金融产品。

3、权益类资产（投资比例不超过本计划总资产的 80%）：股票型公开募集证券投资基金、混合型公开募集证券投资基金、股票型 ETF 基金、混合型 ETF 基金、

股票型 LOF 基金、混合型 LOF 基金和指数增强基金等权益类投资标的。

资产管理计划完成备案前不得开展投资活动，但可以现金管理为目的，投资于银行活期存款、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。投资者认可本资产管理计划成立后、完成备案前可投资资产管理人管理的货币市场基金。

如资产管理合同存续期内市场出现新的投资品种，在法律法规、监管机构允许的前提下，经全体投资者、资产托管人、资产管理人一致同意，可纳入投资范围。

本计划可投资于债券回购，资产委托人应充分理解并接受本计划投资债券回购所带来的信用风险、流动性风险、利率风险及交收违约后结算公司对质押券处置等风险。

（三）投资比例超限的处理方式及流程

发生被动超标情形时，资产管理人应按照资产管理合同关于被动超标的约定处理。

（四）风险收益特征

根据资产管理人的产品分级标准，本计划属于 R4-中高风险等级的资产管理计划。本计划的收益表现主要取决于本计划跟踪标的及投资标的在本计划存续期间的表现。资产管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益或委托财产本金不受损失，以及限定投资损失金额或比例。

（五）业绩比较基准及确定依据

本计划无业绩比较基准。

（六）投资策略、决策依据、决策程序、投资管理方法和标准

1、投资策略

（1）场内衍生品类资产投资策略：本计划可选择中证 500 指数股指期货进行投资，策略利用股指期货合约与跟踪标的存在的基差，基于股指期货合约价格与指数点位的收敛机制，对市场走势、衍生品合约的风险及投资时机进行评估后，选择升贴水情况相对有利的期货合约标的进行投资。

（2）证券投资基金投资策略：本计划将优先考虑符合以下条件的基金品种：基金管理人的股权结构合理及管理层稳定，内控机制健全；基金管理人拥有高水

准的投资研究团队及严谨的投资决策流程；旗下基金的综合表现良好且稳定；基金经理投资管理经验丰富、过往业绩良好且较为稳定；基金资产配置、行业配置集中度较为合理。

（3）固定收益类资产投资策略：本计划将依据流动性安排对固定收益类资产进行投资。资产管理人通过采取合理措施，挑选适当的交易对手，管理交易对手方风险。

除法律法规另有规定外，经资产管理合同当事人之间协商一致可对投资策略进行变更，变更投资策略应以书面形式做出。投资策略变更应为调整投资组合及资产托管人调整监督事项等留出必要的时间。

若本计划存续期内因监管机构对资产管理计划的投资比例限制等变更导致资产管理合同约定的投资策略无法继续适用，管理人有权根据届时法律法规及监管要求做出调整并进行公告，无需取得投资者同意。

2、投资决策依据

（1）国家有关法律、法规和资产管理合同的有关规定。依法决策是本计划进行投资的前提；

（2）投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是本计划维护投资者利益的重要保障。

3、投资决策程序

本计划投资业务采取投资决策委员会（下称“投委会”）领导下的投资经理负责制。投委会为管理人投资管理的最高决策机制，负责确定大类资产配置及重大投资方案；投资总监在投委会授权范围内审阅投资组合及决定投资的其他重大事项，审批投资经理的投资建议；投资经理在授权范围内构建和调整投资组合。风险管理人员参与整个投资决策流程，防范和控制可能出现的相关风险。

4、投资管理的方法和标准

本计划由固定收益类资产、商品及金融衍生品类资产和权益类资产构成投资组合，具体投资标的、投资比例及交易对手在法律法规及资产管理合同约定范围内由投资经理筛选、交易人员执行，综合市场及监管要求等多方面因素确定。

资产管理人将根据本计划投资目标，结合法律法规、监管要求及市场变化，对投资管理方法和标准进行调整和优化。

（七）投资限制

1、本计划不得违反资产管理合同中投资范围的规定。

2、本计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

3、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。

4、本计划投资于其他资产管理产品的，所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。

5、本计划的总资产不得超过计划净资产的 200%。

6、本计划投资单一期货合约占该合约市场总持仓量不超过 10%，单个交易日交易量不超过上一交易日市场总交易量的 10%。

若法律法规或监管部门取消上述限制或另有规定的，履行适当程序后，本计划投资可不受上述规定限制。

发生被动超标情形时，资产管理人应按照资产管理合同关于被动超标的约定处理。

（八）投资禁止

本计划的投资禁止行为包括：

1、承销证券；

2、违反规定向他人贷款或者提供担保；

3、从事承担无限责任的投资；

4、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

5、直接投资于商业银行信贷资产；

6、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；

7、直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止投资的行业或领域；

8、法律法规禁止的其他行为。

（九）投资政策的变更

因法律法规及监管机关做出的强制性要求而必须变更投资政策的,可由管理人和托管人双方协商一致进行变更,并由管理人进行公告。除前述情形外,经全体投资者与资产管理人、资产托管人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作出。投资政策变更应为资产管理人及资产托管人留出必要、合理的调整时间。

(十) 建仓期

本计划建仓期为本计划备案完成之日起6个月。

建仓期结束后,本计划的资产组合应当符合法律法规、中国证监会规定和资产管理合同约定的投资范围和投资比例。

(十一)管理人将按照法律法规及资产管理合同约定确保本计划所投资的资产组合流动性与本计划退出安排相匹配,并按照法律法规及资产管理合同约定在开放期保持适当比例的现金或者其他高流动性金融资产,且限制流动性受限资产投资比例。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资产管理计划资产净值的20%。本计划开放期内资产组合中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%。

三、资产管理计划的募集

(一) 资产管理计划的募集期限、募集方式、募集对象

1、募集期限

本资产管理计划的初始募集期间自资产管理计划份额首次发售之日起最长不超过60日。具体时间由资产管理人根据相关法律法规以及资产管理合同的规定确定,并在计划说明书或相关公告中披露。

资产管理人有权根据资产管理计划初始募集的实际情况按照相关程序提前终止或延长初始募集,但初始募集期限自资产管理计划份额首次发售之日起最长不超过60日,此类变更适用于所有销售机构。资产管理人在其官方网站发布相关公告即视为履行完毕提前终止或延长初始募集的程序。资产管理人发布公告提前结束初始募集的,本资产管理计划自公告中载明的时间起不再接受认购申请。

2、募集方式

本资产管理计划通过销售机构进行募集。具体销售机构名单、联系方式以本资产管理计划的计划说明书或相关公告为准。

3、募集对象

具备相应风险识别能力和风险承受能力,投资于本资产管理计划不低于本计划最低认购金额且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织:

(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 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。

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。

(二) 资产管理计划的最低认购金额和支付方式

认购资金应以人民币现金形式通过投资者指定账户交付至销售机构募集账户。

资产管理计划采取全额缴款认购的方式。投资者在初始募集期间的净认购金额不得低于 40 万元人民币(不含认购费用),并可多次认购,初始募集期间追加认购金额单笔不低于 1 元(不含认购费用)。

(三) 资产管理计划份额的认购费用

1、本计划不收取认购费用,即认购费率为 0。

2、初始销售期间利息的处理方式

资产委托人的认购款项在初始销售期间产生的利息(简称为“认购利息”)将折算为相应的资产管理计划份额归资产委托人所有,其中认购利息的具体金额以资产管理计划注册登记机构的记录为准。

3、认购份额及认购费用的计算方法如下：

净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额

认购份额=（净认购金额+认购期利息）/1.00 元/份

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，由此误差产生的损益计入资产管理计划财产。

资产委托人应保证对计划份额的初始认购金额不低于 40 万元。

（四）初始募集期间的认购程序

1、资产管理人可自行办理资产管理计划的募集，也可以由合作的其他销售机构进行募集。其他销售机构募集的，由该等销售机构按照法律法规和监管要求完成投资者尽职调查工作。投资者应当配合资产管理人及相关销售机构的尽职调查。

2、认购程序。投资者办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守资产管理合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

3、认购申请的确认。

销售机构受理认购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认购申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认并且资产管理合同生效为准。认购申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，即不同时间提交的申请，对申请时间在先的申请予以确认；相同时间提交的申请，对金额较大的申请予以确认。申请是否有效应以注册登记机构的确认并且本计划成立为准。注册登记机构有权就该确认原则制定细则，投资者应予遵守，以确保本计划成立时本资产管理计划的有效认购人数不超过 200 人。投资者应在资产管理合同生效后到其认购本计划份额的销售机构营业网点或根据销售机构提供的其他方式查询最终确认情况和有效认购份额。

认购申请一经受理，非经注册登记机构认可不得撤销。

（五）初始认购资金的管理及利息处理方式

资产管理人应当将资产管理计划初始募集期间客户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。投资者的认购资金（不含认购费用）在初始募集期间发生的利息收入按银行活期

存款利率（税后）计算。该利息收入在初始募集期间结束后折合成计划份额，归投资者所有。利息转份额的数量以注册登记机构的记录为准。

（六）投资者可分别向管理人、销售机构查询本资产管理计划募集结算专用账户和销售机构募集账户。

（七）终止募集的特别情形

如本计划募集期内发生拟投资标的急剧变化或相关政策变更，进而导致资产管理人判断投资目标和投资策略可能存在差异过大或无法实现的风险，则资产管理人有权终止本计划募集并予以公告。在此情形下，投资者的认购资金将退回其指定账户。

四、资产管理计划的参与、退出与转让

（一）参与和/或退出场所

本资产管理计划参与和/或退出场所为资产管理人及销售机构的营业场所，或按销售机构提供的其他方式办理参与和/或退出。具体销售机构名单、联系方式以本资产管理计划说明书或相关公告为准。资产管理人可根据业务需要增加、变更销售机构，通过在资产管理人网站公告的形式进行通知。

（二）参与和/或退出的开放日和时间

本计划自成立日起封闭运作直至成立满 1 个月，此后每个星期的第一个工作日对锁定持有期已届满的计划份额开放退出，第二个工作日开放参与；如遇某一星期的工作日不足两天，则该星期不开放且不顺延。本计划存续期内非开放日不开放参与和退出。

本计划成立后，注册登记机构对资产委托人每一笔认购/参与的计划份额分别计算 180 天的“锁定持有期”。其中，认购份额的锁定持有期为自本计划成立日（含）起满 180 天，有效参与份额的锁定持有期为自参与确认日（含）起满 180 天。

开放日参与和/或退出业务的办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所同时开放交易的时间。如投资者在开放日办理时间之外提出参与和/或退出申请，则该申请无效。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/期货交易所交易时间变更或其他资产管理人认为不利于本计划投资等特殊情况下，资产管理人将视情况对前述开放日及开放参与和/或退出安排进行相应的调整并告

知资产委托人。资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

（三）临时开放期

资产管理合同变更的，为保障投资者选择退出本资产管理计划的权利，资产管理人有权设置临时开放期接受投资者退出，并对相关后续事项作出公平、合理的安排。临时开放期的具体安排以资产管理人公告为准，届时通过资产管理人网站发布公告即视为资产管理人履行了告知义务。

（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认

1、“未知价”原则，即资产管理计划的参与和退出价格以受理申请当日收市后计算的资产管理计划份额净值为基准进行计算。

2、资产管理计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

3、投资者办理参与和/或退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守资产管理合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

4、开放日当日的参与和/或退出申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。在遵守法律法规及资产管理合同规定的前提下，销售机构另有规定的，以各销售机构的具体规定为准。

5、参与和退出申请的确认。销售机构受理参与和/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和/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参与、退出申请的有效性进行确认。投资者 T 日提交的参与和/或退出申请，正常情况下注册登记机构在 T+2 日对该申请的有效性进行确认。投资者于 T 日提交申请后，一般可于 T+3 日向销售机构查询最终确认情况。因申请不符合资产管理人、销售机构、注册登记机构的规定而不予确认所造成的损失，由投资者自行承担。投资者应及时查询、行使合法权利，因投资者怠于行使权利而造成的损失，由投资者自行承担。

投资者退出资产管理计划时，资产管理人按先进先出的原则，份额确认日期在前的计划份额先退出，确认日期在后的计划份额后退出，以确定所适用的退出费率（如有）及业绩报酬（如有）。

注册登记机构有权就上述确认规则制定细则，资产委托人应予遵守。

本计划存续期内，如任一开放日（T 日）的退出申请确认后，将导致本计划

剩余资产委托人人数少于 2 人（不含 2 人）的，管理人有权拒绝该开放日的全部退出申请，本计划进入清算程序。对 T 日提出退出申请的资产委托人暂不支付退出款项，该等退出申请涉及的委托财产与本计划其他资产一并按照资产管理合同约定的清算程序进行处理和分配。

6、参与和/或退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式；若资金在规定时间内未全额到账，则参与不成功，为无效申请，已交付的款项将退回至投资者指定账户。投资者退出申请确认后，资产管理人应按规定向投资者支付退出款项，退出款项自受理投资者有效退出申请之日起不超过 7 个工作日划往投资者指定账户。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按资产管理合同和有关法律法规规定办理。

7、资产管理人在不损害投资者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 1 个工作日告知投资者。资产管理人在其官方网站发布公告即视为履行了告知义务。

8、参与的申请方式

未持有资产管理计划份额的投资者参与本计划，必须与资产管理人和资产托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式足额缴纳参与款项。参与的具体金额和份额以注册登记机构的确认结果为准。

已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划开放日追加购买资产管理计划份额时，无需重新签署资产管理合同，应提交的文件以销售机构的规定为准。

（五）参与和退出的金额限制

1、参与的金额限制

投资者在资产管理计划开放日购买资产管理计划份额的，应符合合格投资者标准，且参与金额应满足资产管理计划最低参与金额限制，首次购买金额应不低于 40 万元（不含参与费用）。在开放日追加参与的，每次追加参与金额单笔不低于 1 元（不含参与费用）。

2、退出的金额限制

投资者持有的已满锁定持有期的计划份额方可申请退出，未满锁定持有期的计划份额不得申请退出。

当投资者持有的计划份额资产净值高于 40 万元人民币时，投资者可以选择

全部或部分份额退出资产管理计划。选择全部份额退出资产管理计划的，其持有的全部计划份额应均已届满相应锁定持有期。选择部分份额退出资产管理计划的，该部分退出份额应已届满相应锁定持有期；同时，投资者在退出后持有的计划份额的资产净值应当不低于 40 万元人民币，如确认退出申请后投资者持有的计划份额的资产净值将低于 40 万元人民币的，注册登记机构有权对该投资者的全部份额进行强制赎回，以保证投资者一次性全部退出资产管理计划。

当投资者持有的计划份额的资产净值低于或等于 40 万元人民币时，投资者仅可针对已满锁定持有期的计划份额申请退出，在此情形下注册登记机构有权对该投资者的全部份额进行强制赎回，以保证投资者一次性全部退出资产管理计划。

资产管理人可根据市场情况及本计划投资运作情况，调整退出规则及对退出份额的数量限制，资产管理人进行前述调整应提前 1 个工作日告知投资者。资产管理人在其官方网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

（六）参与费用及参与份额的计算方式

本计划不收取参与费用，即参与费率为 0。

本计划参与份额的计算方法如下：

$$\text{参与份额} = \text{参与金额} / \text{T 日资产管理计划份额净值}$$

其中，参与份额的计算按照四舍五入法保留到小数点后第 2 位，由此误差产生的损益归入资产管理计划财产。

（七）退出费用及退出金额的计算方式

本计划不收取退出费用，即退出费率为 0。

本计划退出金额的计算方法如下：

$$\text{退出总额} = \text{退出份额} \times \text{受理申请当日 (T 日) 收市后计算的资产管理计划份额净值}$$

$$\text{退出金额} = (\text{退出份额} \times \text{T 日资产管理计划份额净值} - \text{退出份额的业绩报酬 (如有)}) \times (1 - \text{退出费率})$$

其中，退出金额的计算按照四舍五入法保留到小数点后 2 位，由此误差产生的损益计入资产管理计划财产。

（八）拒绝或暂停参与、退出的情形及处理

1、发生以下情况之一的，资产管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：

(1) 如接受该申请, 将导致本计划资产委托人超过 200 人。

(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, 从而损害现有资产委托人的利益的情形。

(3) 如接受该申请, 将导致本计划资产总规模超过资产管理合同约定的上限 (如有)。

(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委托人利益的。

(5) 不可抗力导致本计划无法正常运作。

(6) 发生资产管理合同规定的暂停计划资产估值情况。

(7) 法律法规、监管机构及交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定拒绝接受某些投资者的参与申请时, 参与款项 (无利息) 将退回投资者指定账户。

2、发生以下情况之一的, 资产管理人可以暂停接受投资者的参与申请:

(1) 因不可抗力导致无法受理资产委托人的参与申请。

(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。

(3) 发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值情况和暂停接受参与申请的情形。

(4) 法律法规、监管机构及交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时, 应当告知投资者。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投资者。

3、发生以下情况之一的, 资产管理人可以暂停接受投资者的退出申请或延期支付退出款项:

(1) 因不可抗力导致资产管理人无法支付退出款项;

(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;

(3) 发生资产管理合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情况;

(4) 发生巨额退出;

(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且资产管理人决定暂停接受退出时, 资产管理人应当及时

告知投资者。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投资者。发生上述情形之一且资产管理人决定延期支付退出款项时，资产管理人应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第（4）项所述情形，按资产管理合同的相关条款处理。

（九）参与资金的利息处理方式

本计划参与资金划入托管账户前不计算活期利息。

（十）巨额退出的认定及处理方式

1、巨额退出的认定

单个开放日中，本资产管理计划需处理的净退出申请总份额（退出申请份额总数扣除参与申请份额总数后的余额）超过本资产管理计划上一工作日资产管理计划总份额的 10% 时，即构成巨额退出。

2、巨额退出的处理方式

出现巨额退出时，资产管理人可以根据本资产管理计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分延期退出。

（1）接受全额退出：当资产管理人认为有能力兑付投资者的全部退出申请时，按正常退出程序执行。

（2）部分延期退出：当全额兑付投资者的退出申请有困难，或兑付投资者的退出申请进行的资产变现可能使资产管理计划资产净值发生较大波动时，资产管理人可在该工作日接受部分退出申请，其余部分的退出申请在后续工作日予以受理。对于当日接受的退出申请，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；对于需要部分延期办理的退出申请，除投资者在提交退出申请时明确做出不参加顺延至下一个工作日退出的表示外，自动转为下一个工作日继续退出，退出价格为下一个工作日的资产管理计划份额净值，以此类推，直到全部退出为止。部分退出导致投资者持有的计划资产净值低于 40 万元人民币的，优先适用前文关于退出金额限制的相关规定，再适用本节的约定。发生部分延期退出时，资产管理人可以适当延长退出款项的支付时间，延长期限以资产管理人届时发布的公告为准。

（3）巨额退出的通知：当发生巨额退出并部分延期退出时，资产管理人应当在 5 个交易日内通知投资者，并说明有关处理方法；同时资产管理人应当按照

法律法规、监管机构、自律组织的规定及时履行报告义务。

(4) 出现巨额退出时，如资产管理人认为有必要，可暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过 5 个工作日。出现巨额退出并暂停接受退出申请或延缓支付退出款项时，资产管理人应当在 3 个交易日内通知投资者，并说明有关处理方法；同时资产管理人应当按照法律法规、监管规则的规定及时履行报告义务。

(十一) 参与和退出的资金清算

1、T 日，投资者进行参与或退出申请，资产管理人和资产托管人分别在 T+1 日计算资产管理计划财产净值，并进行核对；资产管理人向注册登记机构发送资产管理计划份额净值。

2、T+2 日下午 14:00 前，注册登记机构根据 T 日资产管理计划份额净值计算参与份额或退出金额，更新投资者数据库；并将确认的参与或退出汇总数据向资产管理人传送，资产管理人将参与或退出汇总数据传送资产托管人。资产管理人、资产托管人根据确认数据进行账务处理。

3、资产管理人应开立并管理专门用于办理资产管理计划参与和退出款项清算的“清算账户”。资产管理计划资金账户与清算账户间的资金清算遵循“全额清算、净额交收”的原则。

4、资产管理计划参与和退出款项采用轧差交收的结算方式，参与款和退出款原则上 T+3 日交收，净额原则上最晚不迟于交收日 16:00 前在资产管理人开立的清算账户和托管账户之间交收。

5、如果当日为净应收款，资产托管人应及时查收资金是否到账；对于未准时到账的资金，资产托管人应及时通知资产管理人划付。如果当日为净应付款，资产托管人应根据资产管理人的指令及时进行划付；对于未准时划付的资金，资产管理人应及时通知资产托管人划付，由此产生的责任应由资产托管人承担。

6、注册登记机构应将每个开放日的参与或退出汇总数据传送给资产管理人，资产管理人将参与或退出汇总数据传送给资产托管人。资产管理人或注册登记机构应对传递的数据真实性负责。资产托管人应及时查收参与资金的到账情况，并根据资产管理人指令及时划付退出款项。

(十二) 份额转让

在条件允许的情况下，在本计划存续期间，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,向符合条件的合格投资者转让其持有的本资产管理计划份额,份额转让应遵守交易场所及/或注册登记机构及管理人相关规定及要求,并按规定办理份额变更登记手续。转让后,持有本资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过 200 人。资产管理人应当在本资产管理计划份额转让前,对受让人的合格投资者身份和资产管理计划的投资者人数进行合规性审查。受让方首次参与本资产管理计划的,应当先与资产管理人、资产托管人签订资产管理合同。

资产管理人有权在不违反法律法规规定的前提下,制定资产管理计划份额转让的相关操作规定,投资者应当按照该等操作规定进行份额转让。

(十三) 非交易过户认定及处理方式

1、资产管理人及注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中:

“继承”是指投资者死亡,其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“捐赠”是指投资者将其合法持有的计划份额捐赠给公益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投资者持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2、办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 1 个月内办理;申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

(十四) 资产管理人自有资金参与

资产管理人以自有资金投资所持的本计划份额,与投资者所持的份额享有同等权益、承担同等风险。

资产管理人的自有资金参与本计划持有期限不得少于六个月。参与、退出时,应当提前 5 个工作日告知投资者和资产托管人。

资产管理人的自有资金参与本计划的份额不得超过计划总份额的 20%。资产管理人及其下设机构(含员工)以自有资金参与本计划的份额合计不得超过计划总份额的 50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超限的,资产管理人应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时完成调整。

(十五) 管理人应定期将资产管理计划投资者变更情况报送基金业协会。

五、资产管理计划的收益分配

本计划存续期内不进行收益分配。

六、资产管理计划的费用与税收

（一）资产管理业务费用的种类

- 1、资产管理人的管理费（包括固定管理费和业绩报酬）。
- 2、资产托管人的托管费。
- 3、银行账户的资金结算汇划费、账户维护费等银行手续费。
- 4、开立计划相关账户需要支付的费用。
- 5、本计划的证券交易、期货交易及开户费用（包括但不限于经手费、印花
税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的
费用等）。
- 6、本计划成立后与计划财产相关的信息披露费、会计师费、律师费、仲裁
费和诉讼费等。
- 7、资产管理人因管理、运营资产管理计划发生的税费（包括但不限于增值
税及相应的附加税费等）。
- 8、按照国家有关规定和资产管理合同约定，可以在本计划财产中列支的其
他费用。

（二）费用计提方法、计提标准和支付方式

1、资产管理人的管理费

资产管理计划的管理费分为固定管理费和业绩报酬两部分。固定管理费和业
绩报酬的计算方法分别如下：

（1）固定管理费

每日计提的固定管理费=前一日的计划财产净值×年固定管理费率/当年天
数。

其中，年固定管理费率为 1.50%。

本计划的固定管理费自资产管理计划成立日起开始计算，每日计提，按自然
季度支付。资产管理人向资产托管人发送划款指令，资产托管人复核后于下季初
五个工作日之内，从资产管理计划财产中列支一次性支付给资产管理人。若因不

可抗力或持有的资产管理计划财产无法及时变现致使无法按时支付的,则在不可抗力或无法变现的情形消除后的首个工作日支付。资产管理合同终止(包括提前或延期)后,依据清算程序支付尚未支付的固定管理费。

(2) 业绩报酬

在资产委托人全部或部分退出资产管理计划或资产管理计划终止时,资产管理人按资产委托人每笔退出份额或计划终止时所持有份额在相应期间超额收益的 15%收取业绩报酬。具体计算方法如下:

$$\text{业绩报酬} = \text{MAX} [S_i \times [(NAV1-NAV0) / NAV0' - B \times T/365] \times 15\%, 0]$$

其中:

S_i 为资产委托人每笔退出份额或计划终止时所持有份额所对应的认购或参与时的净资产;

$NAV0$ 为资产委托人每笔退出份额或计划终止时所持有份额所对应的认购或参与时的份额累计净值;

$NAV1$ 为退出开放日或计划终止日的计划份额累计净值;

$NAV0'$ 为资产委托人每笔退出份额或计划终止时所持有份额所对应的认购或参与时的份额净值;

T 为资产委托人每笔退出份额或计划终止时所持有份额对应的自本计划成立日(含)或参与确认日(含)至退出确认日(不含)或计划终止日(不含)之间的自然日持有天数;

B 为资产管理计划业绩报酬计提基准(年化), $B=6\%$ 。

业绩报酬由注册登记机构负责计算,资产托管人不承担复核义务,资产管理人向资产托管人发送划款指令,由资产托管人从资产管理计划财产中支付给管理人。

资产委托人确认并充分了解,本计划的业绩报酬计提基准仅是资产管理人收取业绩报酬的计提标准而非预期收益率,不构成资产管理人或资产托管人对委托财产本金不受损失及收益预期、收益状况的任何承诺或保证。

资产管理人指定收取管理费的银行账户为:

户名: 嘉实基金管理有限公司

账号: 1001184209013353260

开户银行：工行上海证券大厦支行

2、资产托管人的资产托管费

本计划的托管费按前一日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下：

资产管理计划财产的年托管费率为 0.01%；

每日计提的托管费=前一日的计划财产净值×年托管费率/当年天数。

本计划的托管费自资产管理计划成立日起开始计算，每日计提，按自然季度支付。资产管理人向资产托管人发送划款指令，资产托管人复核后于下季初五个工作日内，从资产管理计划财产中一次性支付给资产托管人。若因不可抗力或持有的资产管理计划财产无法及时变现致使无法按时支付的，则在不可抗力或无法变现的情形消除后的首个工作日支付。资产管理合同终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付尚未支付的托管费。

资产托管人指定收取托管费的银行账户为：

户名：其他应付款手续费收入-分行专用（资产托管业务收入）

开户行：中国工商银行北京市分行

账号：0200099811200160173

3、上述“（一）资产管理业务费用的种类”中 3 到 8 项费用由资产托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期资产管理计划财产运作费用。

（三）不列入资产管理计划财产费用的项目

1、资产管理人和资产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，以及处理与本资产管理计划财产运作无关的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。

2、资产管理计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不得在资产管理计划财产中列支。

3、其他根据相关法律法规及中国证监会、基金业协会的有关规定不得列入本计划费用的项目。

（四）资产管理人和资产托管人与投资者协商一致后，可根据市场发展情况调整资产固定管理费率、资产托管费率及业绩报酬（如有）计提标准并履行相应备案报告义务，但调低相关费率无需投资者同意。

（五）税收

投资者同意，本计划财产运作过程中如发生增值税应税行为，相应的增值税及其附加税费等相关税负由本计划财产承担。

上述增值税及其附加税费由资产托管人根据与资产管理人核对一致的计划财产估值数据，从本计划财产中一次性支付至资产管理人账户。税款扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，应及时联系资产托管人协商解决。上述增值税及其附加税费由资产管理人依据税务部门要求完成相关税款申报缴纳。

本计划终止后，如本计划财产不足以偿付上述税费，或者资产管理人被税务机关要求补缴由本计划财产增值税应税行为而形成的应由本计划财产承担的增值税及其附加税费等相关税负的，资产管理人有权向投资者就补缴金额进行追索。

本计划运作过程中涉及除增值税及其附加税费以外的各纳税主体、扣缴主体，其纳税义务、扣缴义务按国家税收法律法规执行。投资者必须自行缴纳的税收，由投资者负责，资产管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

如本计划财产所适用的税收征管法律法规及具体执行方式由于国家相关税收政策、资产管理人主管税务机关指导意见、中国证监会相关规定、行业指引、自律规则及有关政策调整而发生变化，资产管理人经与资产托管人协商一致并由资产管理人提前通知投资者后，可直接对本资产管理合同中涉及的相关内容进行修改和调整。

资产管理人如要求资产托管人开具托管费增值税发票的，应先在资产托管人处办理客户信息登记，登记信息包括资产管理人全称、纳税人识别号或社会信用代码、地址、电话、开户银行和账号。资产管理人应确保提供给资产托管人的相关信息真实、准确和完整，并按照资产托管人要求提供相关证明资料，具体要求由资产托管人通过网点通知或网站公告等发布。

资产管理人自行领取增值税发票的，需向资产托管人提供加盖印章的授权委托书，指定领取人，并明确领取人身份证号等信息，由指定领取人凭身份证原件领取增值税发票；指定领取人发生变更的，资产管理人需重新向资产托管人出具加盖印章的授权委托书。资产管理人选择邮寄方式收取增值税发票的，还应提供准确无误且可送达的邮寄信息，若邮寄信息发生变更的，应及时书面通知资产托

管人。

因自然灾害、政府行为、社会异常事件等不可抗力或税务机关原因导致资产托管人不能及时开具增值税发票的，资产托管人有权延迟开票，并不承担任何责任。

增值税发票被资产管理人领取后或资产托管人交由第三方邮递后发生发票丢失、破损或逾期等非资产托管人原因，导致资产管理人无法收到增值税发票相应联次或逾期无法抵扣的，资产托管人不负责赔偿资产管理人相关经济损失。

由于发生销售退回、应税服务中止或开票有误、抵扣联、发票联均无法认证等情形，需要开具增值税红字专用发票的，根据相关法律、法规及政策性文件规定需要由资产管理人向税务机关提交《开具红字增值税专用发票信息表》的，应由资产管理人向税务机关提交《开具红字增值税专用发票信息表》，待税务机关审核并通知资产托管人后，资产托管人开具红字增值税专用发票。

如资产管理合同确定的协议价格为含税价格，在合同履行期间，如遇国家税率调整，资产托管人有权根据国家税率变化调整资产管理合同约定价格。

第二节 资产管理合同主要内容

一、当事人的权利与义务

（一）投资者

1、投资者基本情况

签署资产管理合同且资产管理合同正式生效的投资者即为资产管理合同的投资者。投资者的详细情况在合同签署页列示。

2、投资者的权利

资产管理计划设定为均等份额，除资产管理合同另有约定外，每份计划份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，投资者的权利包括但不限于：

- （1）按照资产管理合同的约定分享资产管理计划财产收益；
- （2）取得清算后的剩余资产管理计划财产；
- （3）按照资产管理合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；

(4) 按照法律法规及资产管理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) 基于资产管理合同约定的投资者可获取的信息，监督资产管理人及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况；

(6) 法律法规及资产管理合同规定的其他权利。

3、投资者的义务

根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，投资者的义务包括但不限于：

(1) 认真阅读并遵守资产管理合同，保证委托财产的来源及用途符合法律法规及资产管理合同有关规定，不得损害国家、社会公共利益和他人合法权益；

(2) 接受合格投资者尽职调查安排，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，按照基金业协会的要求提供投资者的信息资料；投资者以其管理的资产管理产品投资于本资产管理计划的，应确保该产品的所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者且委托财产来源合法合规，并提供基金业协会要求的该产品所有投资者的信息资料；投资者承诺投资本计划不存在违反监管要求的产品嵌套、规避投资范围、杠杆约束等监管要求的违法违规行为；

(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认购/参与款项，承担资产管理合同约定的固定管理费、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) 配合销售机构完成投资者适当性、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱、反恐怖融资、受益所有人识别等监管机关规定的工作，向销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，并在上述文件和资料发生变更时，及

时提交变更后的相关文件与资料；

(8) 不得违反资产管理合同的约定干涉资产管理人的投资管理行为；

(9) 不得从事任何有损资产管理计划及其他投资者、资产管理人及资产管理人管理的其他资产、资产托管人及资产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，但法律法规、资产管理合同或监管机构另有要求，或出于审计、法律咨询等目的向聘请的专业顾问进行披露的除外；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) 及时通过资产管理人公司网站（www.jsfund.cn）登录个人账户查询相关公告，并关注资产管理人以其他合理方式向投资者发送的本计划信息；

(12) 理解并同意承担资产管理计划财产的投资、运作、托管面临资产管理合同之第二十二节“风险揭示”以及风险揭示书中列举的各类风险；

(13) 通过其指定账户进行认购、参与、退出资产管理计划的财产划拨，接收计划收益分配及清算资金划拨等，非按资产管理合同约定申请变更并经管理人同意，不得擅自修改该指定账户；

(14) 法律法规和资产管理合同规定的其他义务。

(二) 资产管理人

1、资产管理人的基本情况

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼

09-14 单元

法定代表人：经雷

联系人：嘉实基金客户运营部

通讯地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

联系电话：400-600-8800

2、资产管理人的权利

根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，资产管理人的

权利包括但不限于：

- （1）按照资产管理合同的约定，独立管理和运用资产管理计划财产；
- （2）依照资产管理合同的约定，及时、足额获得资产管理人固定管理费和业绩报酬（如有）；
- （3）以维护资产管理计划财产利益为原则，行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；
- （4）根据资产管理合同及其他有关规定，监督资产托管人；对于资产托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及基金业协会；
- （5）自行提供或者委托经中国证监会、基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务并确定相关费用，对其行为进行必要的监督和检查；
- （6）以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利（如需）；
- （7）在不违反法律法规规定的前提下，制订、修改有关资产管理计划认购、参与、退出、收益分配等方面的业务规则，有权根据市场情况对本资产管理计划的总规模、单个投资者首次参与金额、每次参与金额及持有的本计划总额限制进行调整；
- （8）有权对投资者进行尽职调查，要求投资者提供相关证明文件、资料，并要求投资者在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料；
- （9）选择、更换律师事务所、会计师事务所或其他为资产管理计划提供服务的外部机构并确定相关费用；
- （10）法律法规及资产管理合同规定的其他权利。

3、资产管理人的义务

根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，资产管理人的义务包括但不限于：

- （1）依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；

- (2) 按照监管机构及基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；
- (3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；
- (4) 自行或要求销售机构对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；
- (5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示已合理知晓的相关风险；
- (6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；
- (7) 建立健全内部管理制度，保证本计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、资产管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，分别投资；
- (8) 除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，不得为资产管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产；
- (9) 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，但法律法规、资产管理合同另有规定或有权机关另有要求，或出于审计、法律咨询等目的向聘请的专业顾问进行披露的除外；
- (10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- (11) 除法律法规或资产管理合同另有规定外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；
- (12) 按照资产管理合同的约定接受投资者和资产托管人的监督；
- (13) 以资产管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (14) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；
- (15) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和资产管理合同的约定；
- (16) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；
- (17) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审

计；

(18) 按照资产管理合同约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(19) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，向基金业协会备案，并抄报证监会相关派出机构；

(20) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(21) 建立并保存投资者名单；

(22) 组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(23) 按照法律法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册、妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(24) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、基金业协会并通知托管人和投资者；

(25) 法律法规和资产管理合同规定的其他义务。

(三) 资产托管人

1、资产托管人的基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司北京市分行

住所：北京市西城区南大街 2 号天银大厦 B 座

负责人或授权代表：周小斌

联系人：王哲

通讯地址：北京市西城区月坛南街 1 号院 5 号楼 0802 房间

联系电话：010-63958537

2、资产托管人的权利

根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，资产托管人的权利包括但不限于：

(1) 按照资产管理合同的约定，依法保管资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同的约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；

(3) 法律法规和资产管理合同规定的其他权利。

3、资产托管人的义务

根据《基金法》、《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，资产托管人的义务包括但不限于：

- (1) 安全保管资产管理计划财产；
- (2) 除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为资产托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；
- (3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；
- (4) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- (5) 按规定开设和注销委托财产的托管账户、证券账户、期货账户等投资所需账户；
- (6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；
- (7) 办理与资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项；
- (8) 根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见；
- (9) 编制托管年度报告，并向基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；
- (10) 按照法律法规要求和资产管理合同的约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 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，但法律法规、资产管理合同另有规定或有权机关另有要求，或出于审计、法律咨询等目的向聘请的专业顾问进行披露的除外；
- (12) 根据法律法规和中国证监会的规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；
- (13) 监督资产管理人的投资运作，发现资产管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和基金业协会；
- (14) 设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、

合格的熟悉资产托管业务的专职人员，负责财产托管事宜；

(15) 法律法规和资产管理合同规定的其它义务。

二、资产管理计划的成立与备案

(一) 资产管理计划成立的条件

- 1、募集过程符合法律法规和中国证监会的规定；
- 2、初始募集规模不低于 1000 万元；
- 3、投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人；
- 4、符合中国证监会规定以及资产管理合同约定的其他条件。

(二) 资产管理计划的成立与备案

初始募集期限届满，符合资产管理计划成立条件的，资产管理人应当自募集资金缴足之日起 10 个工作日内聘请符合《证券法》规定的会计师事务所进行验资，并出具验资报告。本资产管理计划取得验资报告后，由资产管理人公告资产管理计划成立，资产管理计划成立日为计划验资报告出具之日。

资产管理人应当在本资产管理计划成立之日起 5 个工作日内报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

本资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者认购资金。

本资产管理计划成立后、完成备案前不得开展投资活动，但可以现金管理为目的，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。投资者认可本资产管理计划成立后、完成备案前可投资资产管理人管理的货币市场基金。

(三) 资产管理计划不能成立或未完成备案的处理方式

资产管理计划初始募集期间届满，不能满足资产管理计划成立条件的，资产管理人应当承担下列责任：

- 1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在初始募集期间届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

资产管理计划不能成立的，资产管理人、资产托管人及销售机构不得请求报酬。资产管理人、资产托管人和销售机构为计划初始募集所支付之一切费用应由各方各自承担。

资产管理计划成立后未能获得基金业协会备案或在成立后 6 个月内未能完成备案的,本资产管理计划终止,资产管理人、资产托管人应按照资产管理合同的约定对计划财产进行清算。

三、资产管理计划份额的登记

(一)本资产管理计划份额的注册登记业务指本资产管理计划的登记、存管、清算和交收业务,具体内容包括投资者账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管资产管理计划客户资料表等。

(二)本资产管理计划的注册登记业务由资产管理人嘉实基金管理有限公司办理。资产管理人也可委托经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构代为办理本资产管理计划注册登记业务,并与该机构签订委托代理协议,列明代为办理资产管理计划份额登记机构的权限和职责。

(三)注册登记机构履行如下职责:

- 1、建立和保管投资者账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等,并将客户资料表提供给资产管理人。
- 2、配备足够的专业人员办理本资产管理计划的注册登记业务。
- 3、严格按照法律法规和本资产管理合同规定的条件办理本计划的注册登记业务。
- 4、严格按照法律法规和本资产管理合同的规定计算业绩报酬(如有),并提供交易信息和计算过程明细给资产管理人。
- 5、接受资产管理人的监督。
- 6、妥善保存登记数据,并将资产管理计划投资者名称、身份信息以及资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自资产管理计划账户销户之日起不得少于 20 年。
- 7、对投资者的账户信息负有保密义务,因违反该保密义务对投资者或本计划带来的损失,须承担相应的赔偿责任,但法律法规或监管机构另有规定的除外。
- 8、按本资产管理合同约定为投资者提供收益分配等其他必要的服务。
- 9、在法律法规允许的范围内,制定和调整注册登记业务的相关规则。
- 10、法律法规规定的其他职责。

(四)投资者签署资产管理合同,即视为同意管理人、注册登记机构或其他

份额登记义务人将本计划投资者名称、身份信息以及本计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

四、资产管理计划的财产

（一）资产管理计划财产的保管与处分

1、资产管理计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任，投资者以其委托财产为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

2、资产管理计划财产独立于资产管理人、资产托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。资产管理人、资产托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。

3、资产管理人、资产托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入资产管理计划财产。

4、资产管理人、资产托管人可以按照资产管理合同的约定收取管理费、托管费以及资产管理合同约定的其他费用。资产管理人、资产托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。资产管理人、资产托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

5、资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，资产管理人、资产托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，资产管理人、资产托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

（二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

资产托管人按照规定开立资产管理计划财产的资金账户、证券账户等投资所需账户，资产管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。证券账户和期货账户

（如有）的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。资金账户名称应当是“资产管理计划名称”，证券账户、期货账户（如有）名称应当是“管理人名称—托管人名称—资产管理计划名称”，具体以实际开立为准。

资产管理计划财产存放于资产托管人开立的托管账户中的存款利率适用托管人公布的银行间同业存款利率，若公布利率调整，则托管账户中的存款利率以

调整后的最新公布利率为准。

在资产管理人运用计划财产投资银行定期存款或协议存款等在非公开市场交易的存款类投资时,应及时将存款银行出具的存款证实书原件交资产托管人保管。资产托管人仅负责对所收到的存款证实书原件进行保管,不负责存款证实书真假的辨别,不对存款证实书对应存款的本金及收益的安全承担任何责任和义务。

资产管理人在运用计划财产投资于非公开市场交易的银行存款类资产之前,资产管理人应与存款机构签订存款协议,约定资产管理人与存款机构双方的权利和义务,该协议作为划款指令附件。该协议中应明确约定存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押,并不得用于转让和背书;本息到期或提前支取的所有款项必须划至托管账户,不得划入其他任何账户。若资产管理人提前支取或部分提前支取定期存款、协议存款等存款类资产,若产生息差,则息差处理方法由资产管理人与存款机构商定后通知资产托管人。

办理委托财产投资非公开市场交易的银行存款类资产的开户预留印鉴留存、全部提前支取、部分提前支取、到期支取时,应由存款银行或资产管理人至资产托管人处办理印鉴留存、送、取证实书,委托财产投资非公开市场交易的银行存款类资产的开户预留印鉴需包含托管人印鉴,支取时应凭借银行存款开户预留印鉴办理支取手续。存款银行或资产管理人经办人员应携带单位介绍信/授权书以及个人身份证件,以便资产托管人进行核对。资产托管人将存款证实书原件移交给资产管理人或存款银行上门经办人员后不再承担对存款证实书原件的保管责任。

资产托管人对实际交付并控制下的计划财产承担保管职责,对于证券登记机构、期货经纪公司或结算机构等非资产托管人保管的财产,由相应保管责任人承担相关责任。

1、托管账户

(1) 托管账户是指在资产托管人指定营业机构为资产管理计划单独开立的银行结算账户。托管账户不得提现,不得透支,托管账户项下不得购买本票、汇票、支票等可流通票据。资产管理人应在资产托管人开立账户的过程中给予必要的配合,提供所需资料和开户费用(如有)。资产管理人委托资产托管人负责办

理托管账户项下资金的划拨。托管账户户名应符合相关规定，并以实际开立的账户名称为准。

(2) 资产管理计划财产由资产托管人托管期间，本资产管理计划项下的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付费用、资产划拨等，均需通过托管账户进行。资产管理人使用托管账户中的资金，必须事先向资产托管人发送划款指令，经资产托管人审查无误后方能划款。

(3) 管理人和托管人不得假借资产管理计划的名义开立其他任何银行账户。除法律法规另有规定外，管理人、托管人双方不得采取使得该托管账户、预留印鉴等无效的任何行为。

2、证券账户

托管人按照规定开立资产管理计划财产的证券账户，委托人和管理人应在托管人开立账户的过程中给予必要的配合，提供所需资料和开户费用。证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。证券账户卡的保管由托管人负责，管理和运用由管理人负责。管理人不得擅自注销证券账户。

证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本资产管理计划业务的需要。托管人和管理人不得出借和未经对方同意擅自转让计划的任何证券账户，亦不得使用计划的任何证券账户进行本资产管理计划业务以外的活动。

3、证券资金账户及客户交易结算资金管理账户

资产管理人负责在证券公司处按照规定开立证券资金账户，原则上账户名称与本计划在资产托管人处开立的托管账户的名称一致。证券资金账户开立后，资产管理人协助资产托管人在托管账户开户行办理客户交易结算资金银行存管业务（简称“第三方存管”），并由资产托管人为本托管资产建立客户交易结算资金管理账户，办理过程中，相关方应提供必要的协助。

在资产管理合同有效期内，相关方不得单方面注销该证券资金账户，也不得自行从证券资金账户向银行托管账户划款。本计划管理期间进行的所有场内投资，均需通过证券资金账户进行资金的交收。

本计划托管账户和证券资金账户一经开立，即应按证券公司结算模式建立唯一对应的第三方存管关系。对应关系一经确定，不得更改。如果必须更改，经过资产管理人、资产托管人书面确认后，重新建立证券公司结算模式对应关系。资

产管理人承诺，证券资金账户为主资金账户，不开立任何辅助资金账户。

4、基金账户

因本计划投资证券投资基金的需要，管理人为本资产管理计划在指定的基金公司或第三方销售机构以本计划的名义开立证券投资基金账户，用于办理本资产管理计划投资于开放式基金时的基金份额登记和交割，并确保在产品存续期间托管账户为所投资的基金发生分红和赎回时的唯一资金回款账户。管理人负责开立和使用上述账户，账户开立后管理人需及时书面告知托管人该账户的相关信息。持有基金期间，管理人需及时将基金确认、分红或赎回等业务单据的复印件发送给托管人。

5、期货账户

资产管理计划投资期货类品种的，管理人应按照期货资产管理业务开户管理规定为资产管理计划开立与撤销专门用于投资管理的期货账户（以下简称“期货资产管理账户”），申请或者注销交易编码，对期货资产管理账户及其交易编码进行单独标识、单独管理。

6、其它暂未涉及的账户之管理参照上述规定，未尽事宜届时由管理人和托管人另行商处。

五、投资指令的发送、确认和执行

（一）投资指令的授权

授权通知的内容：资产管理人应事先向资产托管人提供书面授权通知（以下简称“授权通知”），指定有权发送投资指令的被授权人员及被授权印鉴，授权通知的内容包括被授权人的名单、签章样本、权限和预留印鉴。资产管理人应使用电子邮件或其他与资产托管人协商一致的方式向资产托管人发出授权通知，同时电话通知资产托管人。资产管理人撤换被授权人员、改变被授权人员的权限或更改被授权印鉴，须提供变更后的新的授权通知。授权通知应加盖资产管理人公章及法定代表人或授权代表签字/章并写明生效时间。

授权通知的生效：授权通知在资产托管人确认收妥后于授权通知载明的生效时间生效。

授权通知的保管：资产管理人在与资产托管人电话确认授权通知后的三个工作日内将授权通知的正本送交资产托管人。资产管理人应确保授权通知的正本与

电子邮件所述授权内容一致。资产管理人和资产托管人对授权通知负有保密义务，其内容不得向授权人、被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露，但法律法规规定或有权机关另有要求的除外。

（二）投资指令的内容

投资指令是在管理计划财产时，资产管理人向资产托管人发出的交易成交单、交易指令及资金划拨类指令（以下简称“指令”）。指令应加盖预留印鉴并由被授权人签章。资产管理人发给资产托管人的资金划拨类指令应写明款项事由、金额、出款和收款账户信息等。

（三）投资指令的发送、确认和执行

指令的发送：资产管理人应按照相关法律法规以及资产管理合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内依照授权通知列明的方式或其他资产托管人和资产管理人认可的方式向资产托管人发送。资产管理人在发送指令时，应确保相关出款账户有足够的资金余额，并为资产托管人留出执行指令所必需的时间。

在计划成立前，资产管理人应事先向资产托管人提供书面的加盖预留印鉴的指令启用函。其中，指令启用函应明确资产管理人采取电子或传真指令的业务类型、发送和接收传真指令的号码、指令确认的指定电话号码等。对于通过资产管理人预留传真号码发出的指令，资产管理人不得否认其效力。对于通过非预留传真号码发送的传真指令，资产托管人需与资产管理人指定的电话号码核对指令日期、指令张数、指令类型、付款产品名称、收款方名称、金额、用途等。变更或新增接收传真指令的号码，资产管理人应事先向资产托管人更新上述书面授权文件。

对于新债申购等网下公开发行业务，资产管理人应于网下申购缴款日的 10:00 前将指令发送给资产托管人。

对于证券交易所场内业务，首次进行场内交易前资产管理人应与资产托管人确认已完成交易单元和股东代码设置后方可进行。

对于银行间市场业务，资产管理人应于交易日 15:00 前将银行间成交单及相关投资指令发送至资产托管人。资产管理人应与资产托管人确认资产托管人已完成证书和权限设置后方可进行资产管理计划的银行间交易。

对于指定时间出款的交易指令，资产管理人应提前 2 个工作小时将指令发送

至资产托管人；对于资产管理人于 15:00 以后发送至资产托管人的指令，资产托管人应尽力配合出款工作，但资产托管人不保证一定成功。

指令的确认：资产管理人有义务在发送指令后与资产托管人以录音电话的方式进行确认。指令以获得资产托管人确认该指令已成功接收之时视为送达资产托管人。对于依照“授权通知”发出的指令，资产管理人不得否认其效力。

指令的执行：托管人收到管理人发送的指令后，应对指令进行如下审查：审查指令的书面要素是否齐全、管理人预留印鉴与经办人、复核人及签发人签字是否与预留的授权文件内容相符。托管人针对管理人发送指令的付款户名、付款账号、付款账户开户行、付款金额（大小写）、收款户名、收款账号、收款账户开户行、要求到账时间、资金用途进行审查，并根据资产管理合同第十六节的约定履行投资监督职责。指令复核无误后应在规定期限内及时执行，不得延误或拒绝执行。若存在要素不符或其他异议，资产托管人应及时与资产管理人进行电话确认，暂停指令的执行并要求资产管理人重新发送指令。资产托管人可以要求资产管理人电子邮件提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保资产托管人有足够的资料来判断指令的有效性。资产托管人待收齐相关资料并判断指令有效后重新开始执行指令。资产管理人应在合理时间内补充相关资料，并给资产托管人预留必要的执行时间。在指令未执行的前提下，若资产管理人撤销指令，资产管理人应在原指令上注明“作废”并加盖预留印鉴及被授权人签章后以电子邮件发送给资产托管人，并电话通知资产托管人。

（四）资产托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

资产托管人发现资产管理人发送的指令有可能违反法律法规或资产管理合同的规定时，应暂缓执行指令，并及时通知资产管理人，资产管理人收到通知后应及时核对并纠正；如相关交易已生效，则应通知资产管理人在 10 个工作日内纠正，并有权报告中国证监会相关派出机构和基金业协会。

（五）资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

资产管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。资产托管人在履行监督职能时，发现资产管理人的指令错误时，应拒绝执行，并及时通知资产管理人纠正。

（六）更换投资指令被授权人的程序

由于人员、权限或印鉴变更而提供的变更后的新的授权通知，资产管理人必须提前至少一个交易日，使用电子邮件方式向资产托管人发送，同时电话通知资产托管人，变更后的新的授权通知经资产托管人确认后于授权通知载明的生效时间生效，同时原授权通知失效。

（七）指令的保管

指令若以电子邮件或传真发出，则正本由资产管理人保管，资产托管人保管指令电子邮件或传真件。当两者不一致时，以资产托管人收到的指令电子邮件或指令传真件为准。

（八）相关责任

对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令致使资金未能及时清算所造成的损失由资产管理人承担。因资产管理人原因造成的传输不及时、未能留出足够执行时间、未能及时与资产托管人进行指令确认致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失由资产管理人承担。资产托管人正确执行资产管理人发送的符合资产管理合同约定的有效指令，计划财产发生损失的，资产托管人不承担责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因资产托管人原因未能及时或正确执行合法合规的有效指令而导致计划财产受损的，资产托管人应承担相应的责任，但因不可抗力导致的情况除外。

资产托管人根据资产管理合同相关规定履行审查职责，如果资产管理人的指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能及时提供授权通知等情形，资产托管人不承担因执行有关指令或拒绝执行有关指令而给资产管理人或计划财产或任何第三方带来的损失，但资产托管人未按合同约定尽审查义务执行指令而造成损失的情形除外。

六、交易及清算交收安排

（一）证券经营机构的选择及交易相关基本信息的传输

资产管理人负责选择代理本计划证券买卖的证券经营机构，本计划参与交易所场内证券投资，采用证券公司结算模式。资产管理人、资产托管人应与资产管理人选择的证券经纪机构另行签署经纪服务协议，明确各自在业务上的程序和职责。资产管理人需以书面形式告知资产托管人上交所和深交所的交易单元号、交

易品种的费率、佣金收取标准和证券账户信息等,并确认已建立第三方存管关系、开通银证转账功能。在合同有效期内若交易单元号、交易会员号、交易编码、或涉及的相关费率等变动,则资产管理人应在变动生效前一个工作日书面告知资产托管人。

管理人负责选择本计划的期货经纪商,并与托管人、期货经纪商共同签订操作备忘录或类似文件。

(二) 交易的资金清算与交割

资产管理人所选择的证券经营机构负责办理本计划的所有场内交易(或代销的场外开放式基金)的清算交割;资产托管人负责办理本计划的所有场外交易的清算交割。资金清算与交割具体的细节由资产管理人、资产托管人于相关协议中进行明确。

(三) 资金、证券和期货账目及交易记录的核对

资产管理人和资产托管人每月对资产管理计划财产的证券账目、实物券账目、交易记录进行核对。

(四) 参与和退出业务处理的基本规定

1、参与和退出的确认、清算由资产管理人或其委托的注册登记机构负责。

2、T 日,投资者进行参与或退出申请,资产管理人和资产托管人分别在 T+1 日计算资产管理计划财产净值,并进行核对;资产管理人向注册登记机构发送资产管理计划份额净值。

3、T+2 日下午 14:00 前,注册登记机构根据 T 日资产管理计划份额净值计算参与份额或退出金额,更新资产委托人数据库;并将确认的参与或退出汇总数据向资产管理人传送,资产管理人将参与或退出汇总数据传送资产托管人。资产管理人、资产托管人根据确认数据进行账务处理。

4、资产管理人应开立并管理专门用于办理资产管理计划参与和退出款项清算的清算账户。资产管理计划资金账户与清算账户间的资金清算遵循“全额清算、净额交收”的原则。

5、资产管理计划参与和退出款项采用轧差交收的结算方式,参与、退出款原则上 T+3 日交收,净额最晚不迟于交收日 16:00 前在资产管理人开立的清算账户和托管账户之间交收。

6、如果当日为净应收款，资产托管人应按管理人要求及时查收资金是否到账，对于未准时到账的资金，应及时通知资产管理人划付。如果当日为净应付款，资产托管人应根据资产管理人的指令及时进行划付。对于未准时划付的资金，资产管理人应及时通知资产托管人划付。

7、注册登记机构应将每个开放日的参与或退出汇总数据传送给资产管理人，资产管理人将参与或退出汇总数据传送资产托管人。资产管理人或注册登记机构应对传递的数据真实性负责。资产托管人应及时查收参与资金的到账情况，并根据资产管理人指令及时划付退出款项。

8、退出和分红资金划拨规定

拨付退出款或进行本计划分红时，如资金账户有足够的资金，资产托管人应按时拨付；因资金账户没有足够的资金，导致资产托管人不能按时拨付，托管人应立即通知资产管理人；如系资产管理人的原因造成，责任由资产管理人承担，资产托管人不承担垫款义务。

9、资金指令

除参与款项到达资产管理计划托管账户需双方按约定方式对账外，回购到期付款和与投资有关的付款、退出和分红资金划拨时，资产管理人需向资产托管人下达划款指令。

划款指令的格式、内容、发送、接收和确认方式等与投资指令相同。

（五）参与、退出净额结算

资产管理计划托管账户与“资产管理计划清算账户”间的资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每日按照托管账户应收资金与应付资金的差额来确定托管账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。当存在托管账户净应收额时，资产管理人应在交收日 15:00 之前从资产管理计划清算账户划到资产管理计划托管账户；当存在托管账户净应付额时，资产管理人应在 T 交收日前一日将划款指令发送给资产托管人，资产托管人按资产管理人的划款指令将托管账户净应付额在交收日 12:00 之前划往资产管理计划清算账户。

（六）通过第三方销售机构参与开放式基金投资的特别约定

本计划可以通过第三方基金销售机构渠道投资开放式基金。为维护投资者利益、保障资产安全，资产管理人应负责制订选择第三方基金销售机构的标准和程

序，并据此选择第三方销售机构。资产管理人应选择在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为中国证券投资基金业协会会员的销售机构，该销售机构应符合开展前述各类产品销售业务的各项资质和要求。

七、越权交易的界定

（一）越权交易的界定

越权交易是指资产管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出资产管理合同约定而进行的投资交易行为，包括：

- 1、违反有关法律法规和资产管理合同规定进行的投资交易行为。
- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

资产管理人应在有关法律法规和资产管理合同规定的权限内运用资产管理计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和资产管理合同的约定运作计划财产。

（二）越权交易的处理程序

- 1、违反有关法律法规和资产管理合同规定进行的投资交易行为

资产托管人发现资产管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人及时纠正。

资产托管人发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定，或者违反资产管理合同约定的，应当立即通知资产管理人。

资产管理人应向投资者和资产托管人主动报告越权交易。在限期内，资产托管人有权随时对通知事项进行复查，督促资产管理人改正。资产管理人对资产托管人通知的越权事项拒不改正的，资产托管人有权报告中国证监会、基金业协会。

- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为

资产托管人在行使监督职能时，如果发现资产管理计划财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒资产管理人，由资产管理人负责解决，由此给资产托管人及资产管理计划财产造成的损失由责任方承担。如果因非资产托管人的原因发生超买行为，资产管理人必须于 T+1 日上午 10:00 前完成融资，确保完成清算交收。

- 3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由资产管理人负担，所发生的收益归本资产管理计划财产所有。

（三）资产托管人对资产管理人的投资监督

自本计划成立之日起, 托管人本着勤勉尽职的原则对管理人的投资行为包括投资对象、投资范围、投资比例、投资限制、投资禁止等行为进行监督, 具体监督职责和监督内容以如下约定为准。

1、对投资范围及比例的监督

（1）投资范围

商品及金融衍生品类资产：在证券/期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的股指期货等标准化商品及金融衍生品类资产。

固定收益类资产：国债、政策性金融债、银行存款、同业存单、货币基金、债券回购、债券型公募基金及法律法规或监管机构允许的其他固定收益类金融产品。

权益类资产：股票型公开募集证券投资基金、混合型公开募集证券投资基金、股票型 ETF 基金、混合型 ETF 基金、股票型 LOF 基金、混合型 LOF 基金和指数增强基金等权益类投资标的。

（2）投资比例

本计划投资于前述商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值的比例不高于本计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%。衍生品账户权益具体计算方式为：衍生品账户权益=存出保证金+结算备付金。

本计划投资于前述固定收益类资产的投资比例不超过本计划总资产的 100%。

本计划投资于前述权益类资产的投资比例不超过本计划总资产的 80%。

如资产管理合同存续期内市场出现新的投资品种, 在法律法规、监管机构允许的前提下, 经全体投资者、资产托管人、资产管理人一致同意, 可纳入投资范围。

2、对投资限制的监督

（1）本计划不得违反资产管理合同中投资范围的规定。

（2）本计划投资于同一资产的资金, 不得超过该计划资产净值的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

(3) 本计划的总资产不得超过计划净资产的 200%。

若法律法规或监管部门取消上述限制或另有规定的，履行适当程序后，本计划投资可不受上述规定限制。

发生被动超标情形时，资产管理人应按照资产管理合同的约定进行处理。

(四) 被动超标

1、由于包括但不限于证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素导致资产管理计划的投资比例、投资范围等不符合资产管理合同约定的投资政策，或者合规持有的证券在持有期间，非因资产管理人原因导致继续持有该证券不符合投资政策的，为被动超标，不构成越权交易。发生上述情形时，资产管理人应在发生被动超标之日或所涉流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易之日起 15 个交易日内进行调整，以满足法律法规及投资政策的要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。法律法规另有规定的，从其规定。

2、本计划终止前，资产管理人有权对资产管理计划财产所投资证券进行变现，具体开始变现时间由资产管理人届时根据市场情况确定，由此造成投资比例、投资范围等不符合投资政策规定的，视为被动超标，不构成越权交易，不属于资产管理人违反资产管理合同的情形。

3、因被动超标导致本资产管理计划财产损失的，由本资产管理计划财产承担。

八、资产管理计划的估值和会计核算

(一) 资产管理计划财产的估值

1、估值目的

资产管理计划财产估值目的是客观、准确地反映资产管理计划财产的价值，并为计划份额的参与和退出等提供计价依据。计划财产净值的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

2、估值时间

自本计划成立日起，资产管理人与资产托管人在每个工作日对上一交易日（该日期以下简称“估值日”）的资产管理计划财产进行估值。

3、估值依据

估值应符合资产管理合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照证券投资基金的行业通行做法处理。

4、估值对象

资产管理计划所拥有的金融资产及负债。

5、估值方法

本计划按以下方式进行估值：

（1）本计划持有的银行存款以本金列示，按利率逐日计提利息。

（2）本计划持有的证券交易所上市的有价证券的估值：

交易所上市的有价证券（包括上市流通的股票、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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如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。

交易所上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种，选取第三方估值机构（中证）提供的相应品种当日的估值净价。

对在交易所市场上市交易的可转换债券，按照每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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去该债券收盘价中所含截至最近交易日的债券应收利息得到的净价进行估值；如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。

交易所上市或挂牌转让的实行全价交易的固定收益品种（可转换债券除外），选取第三方估值机构（中证）提供的当日估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

交易所上市不存在活跃市场的有价证券，如资产支持证券、中小企业私募债券等，采用估值技术确定公允价值。中小企业私募债券应选取估值日第三方估值机构（中证）提供的相应品种对应的估值价格估值。

处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

1) 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市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

2) 首次公开发行未上市的股票、债券、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。

3) 在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券、非公开定向债务融资工具等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，应使用第三方估值机构（中债）提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

(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) 本计划持有的回购以成本列示，按合同利率在回购期间内逐日计提应计利息。

(6) 证券投资基金的估值方法：

1) 在证券交易所挂牌交易的基金（含上市开放式基金（LOF 基金）场内部分），按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2) 在场外交易的开放式基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF））以估值日前一工作日的基金份额净值估值。估值日前一工作日开放式基金份额净值未公布的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日公告的基金份额净值计算。如果估值日前一工作日无基金份额净值，且最近交易日后经济环境发生重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日基金份额净值，确定公允价值进行估值。

3) 货币市场基金按估值日前一工作日基金公司公布的万份收益逐日计提收益。上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。

4) 期货合约按估值日其所在交易所的结算价估值；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。

5) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

6) 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。

(7) 如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情形，资产管理人根据以下原则进行估值：

1) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本计划估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。

2) 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境发生了重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化，可使用最新的基金份额净值为基础或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，确定公允价值。

3) 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，资产管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位及份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

(8) 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。

(9) 如资产管理人或资产托管人发现对资产管理计划财产的估值违反资产管理合同项下订明的估值方法、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。

6、估值程序

资产管理人应于每个工作日对上一交易日的资产管理计划财产进行估值，并

与资产托管人核对。资产管理计划资产净值计算和会计核算的义务由资产管理人承担，资产管理计划财产的会计责任方是资产管理人。

7、估值错误的处理

当计划财产估值出现错误时，资产管理人和资产托管人应该立即协商采取更正措施，并按资产管理合同约定的方式向资产委托人及时披露。当资产管理计划份额净值计算差错给资产管理计划财产或资产委托人造成损失需要进行赔偿时，资产管理人和资产托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

（1）本资产管理计划的主会计责任方由资产管理人担任。与本资产管理计划有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按资产管理人的建议执行。由此给资产管理计划财产或投资者造成的损失，在资产托管人的计算结果是正确的前提下，由资产管理人承担赔偿责任。

（2）若资产管理人计算的资产管理计划份额净值已由资产托管人复核，而且资产托管人未对计算过程提出疑义或要求资产管理人书面说明，资产管理计划份额净值出错且造成投资者损失的，应根据法律法规的规定向投资者支付赔偿金，就实际向投资者支付的赔偿金额，资产管理人与资产托管人按照固定管理费率 and 托管费率的比例各自承担相应的责任。

（3）资产管理人、资产托管人按本估值方法规定的公允价值进行估值时，所造成的误差不作为估值错误处理。

（4）前述内容如法律法规或监管机构另有规定的，按其规定处理。

8、估值调整的情形与处理

在任何情况下，资产管理人采用资产管理合同所述估值方法对资产管理计划财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。如资产管理人认为上述估值方法对资产管理计划财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人在综合考虑市场各因素的基础上，可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值，并对计划资产净值进行调整。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的资产管理计划财产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

9、暂停估值的情形

发生以下情形之一的，资产管理人有权决定本计划暂停估值，并通知资产托管人：

（1）本计划投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

（2）因不可抗力或其他情形致使资产管理人、资产托管人无法准确评估资产管理计划财产价值时；

（3）占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而资产管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值并征得资产托管人同意的；

（4）中国证监会认定的其他情形。

10、资产管理计划份额净值的确认

用于信息披露的计划资产净值和资产管理计划份额净值由资产管理人负责计算，资产托管人进行复核。资产管理人应于每个工作日对上一交易日的资产管理计划财产进行估值并发送给资产托管人，资产托管人当日对净值计算结果复核确认后发送给资产管理人，资产管理人按资产管理合同约定向投资者披露。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，按照资产管理人的计算结果为准。

资产管理计划财产净值是指计划资产总值减去负债后的价值。资产管理计划财产净值的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。资产管理计划财产份额净值的计算保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

11、特殊情况的处理

（1）资产管理人或资产托管人按资产管理合同约定的估值方法进行估值时，所造成的误差不作为估值错误处理。

（2）由于不可抗力，或由于证券/期货交易所、证券经纪机构、第三方估值机构或注册登记结算机构发送的数据错误，或者由于国家会计政策变更、市场规则变更等其他原因等，资产管理人和资产托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，仍未能发现错误的，由此造成的估值错误，资产管理人和资产托管人免除赔偿责任，但资产管理人、资产托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

12、计划财产账册的建立

资产管理人和资产托管人在资产管理合同生效后,应按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则,分别独立的设置、登录和保管资产管理计划财产的全套账册,对相关各方各自的账册定期进行核对,互相监督,以保证资产管理计划财产的合规运作。若双方对会计处理方法存在分歧,应以资产管理人的处理方法为准。

经对账发现相关各方的账目存在不符的,资产管理人和资产托管人必须及时查明原因并纠正,保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。

(二) 会计政策和会计核算方案

1、会计政策

(1) 本资产管理计划的会计年度为每年1月1日至12月31日。

(2) 记账本位币为人民币,记账单位为元。

(3) 本资产管理计划的会计核算按相关法律法规及资产管理合同的规定执行。

2、会计核算方法

(1) 资产管理人、资产托管人应根据有关法律法规的相关规定,按照相关各方约定的同一记账方法和会计处理原则,对计划财产独立建账、独立核算。若双方对会计处理方法存在分歧,应以资产管理人的处理方法为准。

(2) 资产管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算,编制会计报表。

(3) 资产托管人应定期与资产管理人就计划财产的会计核算、报表编制等进行核对。经对账发现相关各方的账目存在不符的,资产管理人和资产托管人必须及时查明原因并纠正,保证相关各方平行登录的账册记录完全相符。

九、信息披露与报告

(一) 资产管理计划成立及备案公告

本计划成立及获得备案后,资产管理人应及时在资产管理人网站上公告。资产管理人在管理人网站公告即视为履行了告知义务。

(二) 向投资者披露的定期报告和临时报告

1、年度报告

资产管理人应当在每年结束之日起4个月内,编制完成计划年度报告并经资产托管人复核后向投资者披露。资产管理人应于每年结束之日起75日内完成年度报告,并将年度报告发送至资产托管人复核,资产托管人在收到后45日内完成复核,并将复核结果书面通知资产管理人。截至报告期末,资产管理计划成立未满3个月或者存续期间不足3个月的,资产管理人可不编制当期年度报告。

年度报告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固定管理费、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;
- (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。

2、季度报告

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投资者披露。资产管理人应于每季度结束之日起20日内完成季度报告,并将季度报告发送至资产托管人复核,资产托管人在收到后10日内完成复核,并将复核结果书面通知资产管理人。截至报告期末,资产管理计划成立未满3个月或者存续期间不足3个月的,资产管理人可不编制当期的季度报告。

季度报告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) 资产管理计划支付的固定管理费、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；

(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。

3、净值报告

自本计划成立日起，本计划按资产管理合同约定的方式披露每周最后一个交易日、开放日及之前两个交易日、计划终止日的计划份额净值（遇非交易日顺延）。除资产管理合同另有约定外，前述估值日之T日的计划份额净值于T+2日在资产管理人网站披露。

资产管理人披露的计划份额净值并不代表资产委托人所能够即时获得的现金等财产金额，也不代表将来在财产分配时所能获得的分配金额，份额净值的估值及披露受限于资产管理合同约定的假设、方法及时效，不构成资产管理人或资产托管人对资产委托人委托财产本金、收益的任何保证或承诺。

4、临时报告

发生资产管理合同约定的重大事件，可能对投资者利益造成重大影响时，除非资产管理合同另有约定或法律法规另有规定，资产管理人、资产托管人应当在事件发生之日起5日内就涉及本方的事项及时向投资者披露。资产管理合同约定的重大事件是指可能对投资者权益或者本计划份额净值产生重大影响的下列事件：

(1) 投资经理发生变动；

(2) 涉及资产管理业务、计划财产、资产托管业务的诉讼、仲裁；

(3) 资产管理人、资产托管人托管业务部门与资产管理合同项下资产管理计划财产相关的行为受到监管部门的严重行政处罚；

(4) 资产管理人或其高级管理人员、本计划投资经理受到严重行政处罚，资产托管人的托管业务或托管业务部门负责人受到严重行政处罚；

(5) 法律法规、监管规定和资产管理合同规定应予披露的其他事项。

5、资产管理计划年度财务会计报告应当经符合《证券法》规定的会计师事

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。

6、清算报告

资产管理人应按资产管理合同约定出具清算报告并及时披露给投资者。

7、为避免疑义，资产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。

（二）向投资者信息披露及投资者信息查询的方式

资产管理人按照资产管理合同约定应向投资者提供的报告或应向投资者披露或告知、通知的信息，将严格按照法律法规的规定通过资产管理人网站进行披露。资产管理合同中提及的任何及所有有关本资产管理计划的信息将在资产管理人官方网站披露，投资者应自行查阅。

资产管理人官方网站：www.jsfund.cn

通过资产管理人或其他销售机构购买本计划的投资者，均应不时通过上述网站，登录其个人账户查询本资产管理计划的相关信息。首次登录的投资者，请点击注册后，根据网站提示内容进行操作，注册或激活其个人账户。如投资者在登录账户查询时有任何疑问，请致电资产管理人的客户服务电话：4006008800。

投资者已充分了解并确认，上述资产管理人官方网站是资产管理人就本资产管理计划涉及的所有信息的发布平台，资产管理人在该平台上发布了相关信息，即视为资产管理人履行了资产管理合同约定的相应信息披露义务。

（三）向监管机构、自律组织提供的报告

资产管理人、资产托管人应当根据法律法规和监管机构及自律组织的要求履行报告义务。

（四）信息保密义务

投资者根据资产管理合同的约定从资产管理人处获取的相关数据，仅供用于投资者了解本资产管理计划的相关投资状况，不得擅自以任何形式对外泄露、报导、转送，投资者不得利用获取的相关数据进行内幕交易、不公平交易或者操纵市场等其他违反证券法等法律法规的规定，不得向他人披露该等数据，法律法规另有规定或监管机关另有要求的除外。

十、资产管理合同的效力

（一）资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文

件。投资者为法人或其他组织的，资产管理合同自投资者、资产管理人、资产托管人加盖公章或合同章以及各方法定代表人（负责人）或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，资产管理合同自投资者本人签字、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同章并由双方法定代表人（负责人）或授权代表签字或盖章之日起成立。

（二）资产管理合同自本计划成立之日起生效，至本计划终止之日终止。除资产管理合同另有约定外，本计划的存续期为10年，自本资产管理计划成立之日起至10个公历年后年度对应日（如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日）止。资产管理合同终止后，合同约定的清算条款继续有效，直至本计划剩余财产分配完毕。

（三）资产管理合同自生效之日起对投资者、资产管理人、资产托管人具有同等的法律约束力。

（四）投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本计划存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，该投资者不再是资产管理计划的投资者和资产管理合同的当事人。资产委托人特此声明：其独立、自主、谨慎作出投资决策并签署资产管理合同，同时认可资产管理人和资产托管人以实体、电子或套印等方式加盖公章或合同专用章具有法律效力。

（五）投资者以电子签名形式签署资产管理合同的，资产管理人、资产托管人作为资产管理合同签署方，在资产管理合同中加盖公章或合同专用章并经法定代表人（负责人）或授权代表签署，即表示三方已接受资产管理合同项下的全部条款，按照资产管理合同约定履行相关职责，成为资产管理合同当事人。三方一致同意投资者以电子签名方式接受资产管理合同、计划说明书、风险揭示书或其他文书的，视为签署资产管理合同、计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他纸质文书。

十一、资产管理合同的变更、终止与财产清算

（一）资产管理合同的变更

1、因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变动或基金业协会的备案补正意见而必须对资产管理合同进行变更，或对投资者利益无实

质性不利影响情形的变更，资产管理人可与资产托管人协商后修改资产管理合同，并由资产管理人按照资产管理合同约定及时向资产委托人履行信息披露义务。

2、因其他原因需要变更资产管理合同的，经全体委托人、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，法律法规或资产管理合同另有约定的除外。资产管理计划改变投向和比例的，应事先取得委托人的同意，法律法规或资产管理合同另有约定的除外。

3、管理人应合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利。因发生以下事项资产管理合同需要变更的，管理人应以公告形式向资产委托人和托管人披露，保障委托人选择退出资产管理计划的权利，并对相关后续事项作出公平、合理安排：

（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，且资产管理计划由其他托管人承接。

4、对资产管理合同任何形式的变更、补充，资产管理人应当按照法律法规及中国证监会相关要求备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

（二）资产管理合同的展期

本计划展期的，资产管理合同相应展期。本计划展期，应符合如下条件：

1、资产管理计划运作规范，资产管理人、托管人未违反法律法规、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、符合资产管理合同第七节第一条所约定的本计划成立条件；

4、中国证监会规定的其他条件。

在取得资产托管人同意的情况下，资产管理人届时将以资产管理合同约定的方式向投资者发出本计划展期方案的征询意见函（或通知）。

投资者应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复书面意见。投资者不同意展期的，应在征询意见函（或通知）指定期限内明确回复；投资者未在前述时间回复意见或意思表示不明确的，视为投资者不同意展期。如有两名

以上投资者书面同意计划展期且本计划满足届时法律法规有关计划延期的其他要求的，本计划存续期相应延长，资产管理人将在原计划到期日对未书面同意计划延期的投资者所持计划份额发起强制退出。

本计划展期后，资产管理人与资产托管人可根据本条约定继续决定是否对本计划进行展期，展期次数不限。

（三）资产管理合同的终止

本计划终止日，资产管理合同相应终止。发生以下任一情形的，本计划终止：

- 1、本资产管理计划存续期届满而不展期的；
- 2、资产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；
- 3、资产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；
- 4、经全体投资者、资产管理人和托管人协商一致决定终止的；
- 5、本计划存续期间内，持续五个工作日投资者少于二人；
- 6、本计划在成立后，未在6个月内在基金业协会完成备案或被基金业协会不予备案的；
- 7、资产管理人判断本计划的投资目的和投资策略因市场风险、政策风险、操作风险等原因无法实现的，资产管理人有权提前终止本计划，但应提前进行公告；
- 8、本计划适用的法律法规或监管要求发生变化，导致本计划无法继续运作或投资的；
- 9、资产管理计划净值低于1000万元时，如资产管理人认为资产管理计划规模过小而不再适宜继续运作的，则资产管理人有权提前终止本计划，并提前进行公告；
- 10、发生资产管理合同第八节第四条第（五）款约定的进入清算程序情形的；
- 11、法律法规及中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

资产管理合同终止后，资产管理人、资产托管人应继续履行法律法规及资产管理合同规定的清算职责。

资产管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报基金业协会备

案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第6项约定的情形除外。

（四）财产清算

1、清算小组

本资产管理计划终止的，资产管理人应当在计划终止之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划财产，具体可由清算小组具体处理。

清算小组成员由资产管理人、资产托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

清算小组职责：负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。清算小组成员具体职责如下：

资产管理人的职责：

- （1）资产变现；
- （2）除交易所、银行等自动扣收的费用外，对清算期间资金支付出具划款指令；
- （3）出具会计报表；
- （4）编制清算报告并签章；
- （5）配合资产托管人办理账户注销工作；
- （6）向投资者发布清算通知、清算报告；
- （7）将计划财产清算报告报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，并通知投资者；
- （8）与资产管理人义务相关的其他职责。

资产托管人的职责：

- （1）清算期间的财产保管；
- （2）出具进入清算环节的计划财产清单；
- （3）复核资产管理人划款指令，进行资金划付；
- （4）计划财产资金、证券等账户的注销；
- （5）清算期间发生资金变动的当日，提供日终资金调节表；
- （6）复核资产管理人出具的会计报表；
- （7）复核资产管理人出具的清算报告并签章；

(8) 与资产托管人义务相关的其他职责。

2、清算程序

本资产管理计划终止,应当按法律法规和资产管理合同的有关规定对资产管理计划财产进行清算。资产管理计划财产清算程序主要包括:

- (1) 资产管理计划终止时,由资产管理计划财产清算小组统一接管财产;
- (2) 对资产管理计划财产进行清理和确认;
- (3) 对资产管理计划财产进行估价和变现;
- (4) 制作清算报告(无需审计);
- (5) 对资产管理计划剩余财产进行分配。

本计划终止后,计划财产仍持有可流通非现金资产的,资产管理人应在 3 个交易日内(含本计划终止日当日)进行变现处理。对于计划财产持有的流通受限证券或所持证券因停牌或暂停交易无法变现的投资标的,资产管理人应自相关投资标的可交易之日起 2 个交易日内进行变现。对部分暂时不能变现的资产,在该部分资产完成变现时,进行二次清算或多次清算。资产管理人应根据二次或多次清算方案进行二次或多次清算,并将变现后的资产按照资产管理合同的约定,以货币形式全部分配给资产委托人。在进行二次或多次清算的变现过程中,变现的资金以现金保存,不得再进行投资。投资者应接受上述资产变现产生的收益或损失。因流动性受限等原因无法及时变现导致本计划财产延期清算的,资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。

自本计划终止之日起不再对资产管理计划财产计提资产固定管理费和资产托管费,但本计划终止日前已计提尚未支付的资产固定管理费、资产托管费、业绩报酬(如有)应从清算财产中予以支付。

3、清算费用的来源和支付方式

清算费用是指清算小组在进行资产管理计划财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由资产管理计划财产清算小组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) 聘请会计师事务所(如需)、律师事务所(如需),以及其他工作人员所发生的报酬;
- (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) 诉讼、仲裁、保全等维护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。

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外，所有清算费用由资产管理人向资产托管人出具指令，由资产托管人复核后办理支付。

除非全体投资者一致要求并承担费用，否则，本计划清算过程中不聘请会计师事务所进行审计，也不聘请律师事务所出具法律意见书。

4、清算剩余财产的支付

依据资产管理计划财产清算的分配方案，将资产管理计划财产清算后的全部剩余财产扣除资产管理计划财产清算费用及各项负债后，向投资者进行分配。计划财产按下列顺序清偿：

- (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) 向投资者进行分配。

资产管理计划财产未按前款（1）（2）（3）项约定清偿前，不分配给投资者。在完成前款（1）（2）（3）项程序后的剩余财产，资产管理人将按照投资者所持份额占本计划总份额的比例，以现金形式向投资者进行分配。

5、资产管理计划财产清算工作结束后，资产托管人应在资产管理人的配合下，尽快完成资产管理合同项下相关账户的销户工作，并将销户结果通知资产管理人。如因资产管理合同相关当事人故意拖延等行为造成销户不及时而出现直接损失或造成相关费用，应当对各自行为承担赔偿责任。

资产管理计划财产清算完毕后，资产托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户、证券账户、期货账户等投资所需账户，资产管理人应给与必要的配合。

资产管理人应当在资产管理计划财产清算结束后五个工作日内将清算结果报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，且及时通知投资者。

资产管理人、资产托管人等机构应当按照法律法规、监管机构及自律组织的

规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者销毁。保存期限自资产管理计划终止之日起不少于二十年。

十二、违约责任

（一）因资产管理合同当事人的违约行为造成资产管理合同不能履行或者不能完全履行的，由违约的一方承担违约责任；如属当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应承担的违约责任。但是发生下列任一情况的，相应当事人应当免责：

- 1、不可抗力；
- 2、非因资产管理人和/或资产托管人原因造成的计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击及其它意外事故造成的损失；
- 3、资产管理人及/或资产托管人按照届时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失；
- 4、资产管理人按照资产管理合同约定行使或不行使其投资权而造成的损失；
- 5、投资者理解资产管理计划财产的投资、运作、保管面临资产管理合同第二十二节中列举的各类风险，资产管理人及资产托管人就资产管理计划财产面临的上述固有风险免于承担责任；
- 6、在没有欺诈或过失的情况下，资产托管人由于按照资产管理人的有效指令执行而造成的损失等；
- 7、资产管理人、资产托管人对已按照法律法规及资产管理合同约定履行勤勉尽责义务外因所引用的证券经纪商及其他中介机构提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵所引起的损失不承担任何责任。
- 8、法律法规规定及资产管理合同约定的其他情况。

（二）资产管理人、资产托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规的规定或者资产管理合同约定，给计划财产或者投资者造成损失的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。

（三）在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护投资者利益的前提下，资产管理合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进

一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

（四）资产管理合同所称损失，均指直接损失。“赔偿”仅应对“直接损失”进行赔偿。

十三、适用法律及争议的处理

（一）对于因资产管理合同的订立、内容、履行和解释或与资产管理合同有关的争议，合同当事人应尽量通过协商或调解途径解决。不愿或者不能通过协商或调解解决的，任何一方均有权将争议提交北京仲裁委员会，按提交仲裁申请时该会有效之仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

资产管理合同各方一致同意，各方就仲裁的提起、仲裁过程、仲裁结果，以及与仲裁有关的一切事项或信息均予以保密，除法律法规或监管机构另有要求或向各方委托的中介机构提供以外，不应向资产管理合同当事方以外的其他方披露。如顾问机构未执行本条保密约定的，视为该顾问机构委托方的违约行为。

争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护投资者的合法权益。

（二）资产管理合同适用中华人民共和国法律（为资产管理合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规）并依据其解释。

第三节 资产管理人与资产托管人概况

一、资产管理人概况

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元

法定代表人：经雷

联系人：嘉实基金客户运营部

通讯地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

联系电话：400-600-8800

二、资产托管人概况

名称：中国工商银行股份有限公司北京市分行

住所：北京市西城区南大街 2 号天银大厦 B 座

负责人或授权代表：周小斌

联系人：王哲

通讯地址：北京市西城区月坛南街 1 号院 5 号楼 0802 房间

联系电话：010-63958537

第四节 风险揭示

资产管理计划投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：

一、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认购或参与资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益，以及限定投资损失金额或比例。

本计划属于 R4-中高风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为 C4 及以上的合格投资者以及符合专业投资者条件的合格投资者。

二、市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：

1、政策风险

因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险

经济运行具有周期性的特点，受其影响，本计划的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

3、利率风险

利率风险主要是指因金融市场利率的波动而导致证券市场价格和收益率变动的风险。

利率直接影响着债券的价格和收益率。本计划投资对象包括债券、票据和银行存款等，其收益水平直接受到利率波动的影响。利率波动可能导致本计划亏损，在利率波动时计划资产净值将受到一定影响。

4、购买力风险

资产管理计划财产的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使资产管理计划财产的实际收益下降。

5、衍生品投资风险主要包括：

衍生品价格会根据其标的物价格变化而变化，因此衍生品标的物价格的变化会影响衍生品的价格。

三、管理风险

资产管理计划运作过程中，资产管理人的研究水平、投资管理水平直接影响资产管理计划财产收益水平，如果资产管理人对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全、投资操作出现失误，都会影响资产管理计划财产的收益水平。资产管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

四、流动性风险

流动性风险可视为一种综合性风险，它是其他风险在资产管理计划财产管理和公司整体经营方面的综合体现。

当发生市场状况异常、巨额退出、大额退出、份额转让等情况时，本计划资产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对本计划资产价格造成重大不利影响时，本计划存在流动性风险。本计划的流动性风险按照其来源可以分为：

1、证券市场整体流动性相对不足。证券市场整体流动性受到证券市场行情、投资者心理等诸多因素影响。在证券市场整体流动性相对不足时，交易变现成本可能增加，对本计划收益造成不利影响。本计划可通过回购方式增加资金杠杆率，在资金的高杠杆情况下，短期内的回购利率大幅波动将会导致资金不足，从而造成亏损的风险。

2、证券市场流动性不均匀，存在单一证券流动性风险。即使在证券市场整体流动性较好的情况下，一些证券的流动性仍可能较差，可能使得本计划难以

按照投资决策买卖相应数量的证券，或该等买卖行为对上述证券价格产生较大影响，导致本计划的建仓成本或变现成本增加。

3、若本计划所投资的金融产品流动性受限，可能导致本计划仓位调整困难，从而产生流动性风险。

4、本计划资产中现金类资产部分不能应对可能出现的巨额退出或大额退出的风险。在本计划任一开放日，可能会发生巨额退出或大额退出的情形，巨额退出或大额退出可能会导致本计划即时仓位调整困难，从而产生流动性风险，甚至影响本计划份额净值。资产管理人为实现投资策略和追求投资表现，通常会使用回购的方法。较高比例的逆回购会降低本计划资产的流动性，此时如果本计划面临较大比例的净赎回，可能导致本计划现金支付出现困难。

5、本计划财产要应对资产委托人退出资产管理计划，如果资产管理计划财产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响资产管理计划财产运作和收益水平。

6、在条件允许的情况下，本计划委托人可根据资产管理合同约定转让其持有的份额，但转让的流动性不强，委托人通过转让本计划份额变现，可能面临流动性风险。

7、根据本计划投资运作安排，本计划存续期内除退出开放日外资产委托人不能退出本资产管理计划，对资产委托人存在流动性风险。

8、根据资产管理合同相关约定，委托人每一笔认购/参与的计划份额均设置 180 天的锁定持有期，资产委托人仅可在计划份额对应的锁定持有期届满后于退出开放日申请退出。若委托人持有的计划份额未满相应锁定持有期，则该部分未满锁定持有期的计划份额不得申请退出，从而可能带来流动性风险。

五、信用风险

信用风险是交易对手的违约风险，资产管理计划项下交易对手拒绝或未能按时足额还本付息或按时履约，资产管理计划财产可能遭受损失。

六、场内衍生品投资风险

1、基差风险

在使用场内衍生品合约对冲市场风险的过程中，资产管理计划财产可能因为场内衍生品合约与标的物价格波动不一致而遭受基差风险。形成基差风险的

潜在原因包括：

(1) 需要对冲的风险资产与场内衍生品标的物风险收益特征存在明显差异；

(2) 因未知因素导致场内衍生品到期时基差严重偏离正常水平；

(3) 因存在基差风险，在进行场内衍生品展期的过程中，委托财产可能会承受场内衍生品之间的价差向不利方向变动而导致的展期风险。

2、杠杆风险

因场内衍生品采用保证金交易而存在杠杆，委托财产可能因此产生更大的收益波动。

3、到期日风险

场内衍生品到期时，资产管理计划财产如持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将委托财产持有的合约进行现金或实物交割，委托财产将无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

4、对手方风险

资产管理人运用委托财产投资于场内衍生品时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货或证券公司作为经纪商，但不能杜绝所选择的期货或证券公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致委托财产遭受损失。

5、盯市结算风险

场内衍生品采取保证金交易，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。假如市场走势对委托财产不利，期货经纪公司或证券公司会按照合同约定的时间和方式通知资产管理人追加保证金，以使委托财产能继续持有未平仓合约。如出现极端行情，市场持续向不利方向波动导致保证金不足，又未能在规定时间内补足，按规定保证金账户将被强制平仓，甚至已缴付的所有保证金都不能弥补损失，从而导致超出预期的损失。

6、平仓风险

在某些市场情况下，委托财产可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓，例如，这种情况可能市场达到涨跌停板时出现。出现这类情况，委托财产缴付的所有保证金有可能无法弥补全部损失，委托人还必须承担由此导致的全部

损失。

期货经纪公司或证券公司或其客户保证金不足，又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致交易所对期货经纪公司或证券公司的经纪账户强行平仓，委托财产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

本计划参与场内衍生品交易，因市场变化导致保证金不足时，期货经纪场内衍生品将按合同约定的时间、方式通知管理人以计划资产追加保证金。当市场价格发生巨大波动时，管理人将可能被通知以计划资产大量追加保证金。若计划资产中的现金不足，无法在规定时间内、按规定方式存入所需的追加保证金，本计划所持有的未平仓合约将可能被强行平仓，导致本计划资产损失；若因场内衍生品市场流动性差造成未平仓合约平仓困难或无法平仓，可能导致本计划资产损失，甚至可能出现计划权益为负（即“爆仓”或“穿仓”）的情形。管理人将针对上述可能的情形及时做出专业判断并最大程度避免其发生，但不能保证上述风险不发生。

7、连带风险

为资产管理计划财产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致交易所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，委托财产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

8、其他风险

如期货经纪公司或证券公司违反法律法规或交易所交易、结算等规则，可能会导致本委托财产受到损失。

由于国家法律、法规、政策的变化、交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，委托财产持有的未平仓合约可能无法继续持有，委托财产必须承担由此导致的损失。

七、资产管理计划募集失败、提前终止及延期的风险

1、资产管理计划募集失败风险

本计划的成立需符合相关法律法规的规定，本计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。如本计划募集期限届满，资产管理计划未达到法律法规或资产管理合同约定的成立条件（如募集规模未达到法律法规及资产管理

合同约定的规模下限等), 本计划不成立。

如本计划募集期内发生拟投资标的急剧变化或相关政策变更, 进而导致资产管理人判断投资目标和投资策略可能存在差异过大或无法实现的风险, 则资产管理人有权终止本计划募集。

2、资产管理计划提前终止风险

本计划发生提前终止情形或其他法定情形(包括但不限于本计划未取得基金业协会出具的备案证明等情形)时, 资产管理人将按照法律法规、资产管理合同以及其他规定提前终止本计划, 从而可能会影响本计划的投资表现。

3、资产管理计划延期风险

本计划存续期限届满时, 如发生资产管理合同约定情形, 本计划期限将会延长, 由此可能造成本计划委托人不能及时获得委托财产。

八、备案风险

本计划按照监管要求向基金业协会履行备案手续, 尽管资产管理人本着勤勉尽责的原则, 本计划存在不能完成备案手续或取得备案证明时点较晚的风险。按照法律法规资产管理计划完成备案前不得开展投资活动, 如本计划取得备案证明时点较晚, 可能影响委托财产的收益水平。如资产管理计划最终未能完成备案或基金业协会不予备案的, 本资产管理计划终止, 资产管理人、资产托管人将按照资产管理合同的约定对计划委托财产进行清算。

九、特定的投资方法及资产管理计划资产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

1、本计划资产投资于各类基金的风险

本计划资产如股票型公开募集证券投资基金、股票型ETF基金、股票型LOF基金和指数增强基金等权益类投资标的, 所投资基金净值变化将影响到本计划业绩表现。可能面临以下风险:

(1) 集中度风险: 同一基金公司管理被投资的基金组合在投资风格、重仓证券、市场判断等方面可能具有相对较高的相似性, 因而当本计划持有同一基金公司发行的基金比例较高时, 本计划在市场风险、信用风险、流动性风险等方面可能面临较高的集中度, 不利于风险分散。

(2) 本计划投资的基金组合可能发生收益不达预期、场内份额可能发生折

溢价波动的风险，其盈利和估值变化都可能导致本计划净值发生波动。

(3) 被投资基金风格偏离风险：本计划筛选策略依靠对被投资基金风格的研判，通过选择和不同市场环境风格相匹配的基金获取收益。因此当被投资基金投资风格出现偏离，会使得本计划存在收益不达预期的风险。

(4) 基金场内份额可能存在流动性风险，在市场流动性欠佳等情况下集中变现可能有较大冲击成本，资产管理人有可能根据资产管理合同约定暂停本计划份额的退出，从而影响委托财产的流动性。

2、本计划资产投资于银行存款时，如果存款银行延期支付银行存款，则支付本计划的到期款项也将进行顺延，会对投资者的流动性需求有所影响。如果存款银行发生违约，无法全额支付银行存款本息，则委托人将可能面临较大的损失。

3、债券回购风险

债券正回购为提升整体组合收益提供了可能，但也存在一定风险，其主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险。其中，信用风险指正回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成计划资产净值损失的风险；用于融资回购的债券作为证券经纪商相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若资产管理人债券回购交收违约，资产管理人和资产委托人面临结算公司依法对质押券进行处置的风险；投资风险是指在正回购操作时，正回购利率大于债券投资收益而导致的风险，以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行正回购操作时，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对计划资产净值造成损失的可能性也就越大。

债券逆回购为提升整体组合收益提供了可能，但也存在一定风险。债券逆回购的主要风险包括信用风险和投资风险。其中，信用风险指逆回购交易中交易对手在逆回购到期时，不能偿还全部或部分价款，造成计划资产净值损失的风险；投资风险是指在逆回购操作时，逆回购利率大于债券投资收益而导致的风险。逆回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对计划资产净值造成损失的

可能性也就越大。

4、因资产净值规模较小而被动清盘的风险

资产管理计划净值低于 1000 万元时，若资产管理人本着勤勉尽责的原则下认为资产管理计划规模过小而不再适宜继续运作的，本计划可能提前终止。

5、投资标的集中度可能较高的风险

本计划主要投资股指期货合约、ETF 基金、指数增强基金等投资标的，当本计划投资于该等投资标的的比例较高时，本计划的风险收益情况可能主要由该等投资标的的投资情况决定。当该等投资标的出现投资风险导致收益情况下降时，将影响本计划的风险收益情况。

6、策略失效风险

本计划主要通过精选股指期货合约、ETF 基金、指数增强基金等投资标的，追随跟踪标的涨跌幅趋势并力求获得超越跟踪标的涨跌幅的投资回报。在实际运作中，由于本计划投资经理变更、法律法规或监管要求发生变化或因市场风险、操作风险、政策风险等原因可能导致本计划采用的策略无法实现、不再有效或在运作过程中与本计划期初投资策略发生偏离，进而影响本计划收益。

7、本计划委托人的投资收益和跟踪标的表现相关。跟踪标的（中证 500 指数）并不能完全代表整个 A 股股票市场。中证 500 指数的平均回报率与整个 A 股股票市场的平均回报率可能存在偏离。中证 500 指数的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，直接影响指数标的表现。当跟踪标的在本计划存续期内的下跌幅度过大时，本计划净值的跌幅可能会超过指数跌幅，本计划可能产生较大亏损，委托人将面临较大损失。

十、操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、资金划拨失败、IT 系统故障等风险，从而导致委托财产的损失。

在计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能

来自证券公司、管理人、托管人、注册登记机构、销售机构、证券/期货交易所、证券注册登记机构等。

十一、税收风险

本计划委托财产管理、运用及处分过程中可能会发生增值税及其附加费、所得税等应由本计划或者资产委托人负担的税费，该等税费将影响本计划的收益表现或者委托人收益预期，极端情况下将导致委托人的损失超过委托财产本金。

本计划所适用的税收征管法律法规及具体执行方式可能会由于国家相关税收政策、资产管理人主管税务机关指导意见、中国证监会相关规定、行业指引、自律规则及有关政策调整而发生变化，资产委托人收益（如有）也可能因相关税收政策调整而受到影响。

十二、关联交易风险

在本计划投资范围内，资产管理人运用委托财产投资于资产管理人、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，或从事其他关联交易（包括重大关联交易）。虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但管理人无法确保选择进行关联交易的实际交易结果（就投资结束后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易结果更优，进而可能影响委托人的利益；或仍存在因管理人运用计划资产从事关联交易被监管部门认为存在重大风险的可能。此外，若将来法律、行政法规及中国证监会的规定对于计划的关联交易作出新的监管要求的，本计划将按照届时最新的监管要求进行调整，该等调整可能会对计划的投资收益造成影响。

十三、不设置份额持有人大会机制的风险

本计划不设置份额持有人大会及日常机构。对于延长资产管理合同期限、修改资产管理合同的重要内容或提前终止资产管理合同、更换管理人或托管人、调整管理人和托管人的报酬标准或其他可能对投资者权利义务产生重大影响的事宜将按照资产管理合同相关章节相应条款处理。

十四、其他风险

1、战争、自然灾害、传染病传播等不可抗力因素的出现，将会严重影响证

券市场的运行，可能导致资产管理计划财产的损失；

2、金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出资产管理人和资产托管人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致资产委托人利益受损。

投资者应充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，并作出自愿承担风险的陈述与声明。

资产委托人应充分认识到资产管理人不能进行刚性兑付，更不具备刚性兑付的条件和能力。本风险揭示并不能揭示投资本资产管理计划的全部风险。投资者在投资本资产管理计划之前应认真阅读本资产管理计划的资产管理合同，全面认识本资产管理计划的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力及个人资产规模，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

第五节 拟任投资经理简介

本计划投资经理由资产管理人负责指定。本计划投资经理可按照规定兼任资产管理人管理的公开募集证券投资基金的基金经理。

本计划投资经理基本信息如下：

金元正先生：中央财经大学金融工程本硕，FRM，4 年从业经验。现就职于嘉实基金管理有限公司，担任投资经理，从事固收及衍生品等投资工作。

本计划投资经理已经依法取得基金从业资格，具备良好的诚信记录和职业操守，无兼职情况，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

资产管理人可以变更投资经理。投资经理变更后，资产管理人应在 5 个工作日内通知投资者及资产托管人。资产管理人在其官方网站就投资经理变更事宜进行公告，即视为已经履行了相应告知程序。

第六节 销售机构

一、直销机构

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元

法定代表人：经雷

通讯地址：北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

联系电话：400-600-8800

传真：010-65185678

二、代销机构

名称：嘉实财富管理有限公司

注册地址：海南省三亚市天涯区凤凰岛 1 号楼 7 层 710 号

法定代表人：张峰

通讯地址：北京市建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座 11 层

联系电话：400-021-8850

第七节 销售期间

本计划募集期限自计划份额发售之日起不超过 60 日。资产管理人延长募集期的，应当告知特定客户。

如果在募集期提前满足资产管理合同规定的条件的，资产管理人可提前终止募集，并在嘉实基金管理有限公司网站及时公告，即视为履行完毕提前终止募集的程序。资产管理人发布公告提前结束募集的，本资产管理计划自公告的截止认购之时起不再接受认购申请。