

第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划说明书

2021 年 6 月



特别提示:

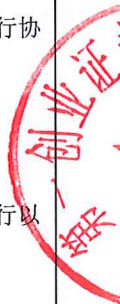
本说明书依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作管理规定》)、《第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称《资产管理合同》)及其他有关规定制作,管理人保证本说明书的内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

委托人承诺以真实身份参与集合计划,保证委托资产的来源及用途合法,并已阅知本说明书和《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。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产,但不保证集合计划一定盈利,也不保证最低收益。

投资者签订《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,其认购或参与集合计划份额的行为本身即表明其对《资产管理合同》及本说明书的承认和接受。委托人将按照《管理办法》、《运作管理规定》、《管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

基本 信息	名称	第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划
	类型	混合类集合资产管理计划
	最低初始募集规模	本计划成立时计划财产的初始资产净值不得低于人民币 1000 万元,本计划初始募集期及存续期不设规模上限。 管理人有权根据实际情况调整初始募集期及存续期规模上限,并在管理人指定网站公告。
	管理期限	本计划的管理期限为 10 年,从本计划成立日起算。在符合本合同约定的展期条件下可展期,但按照本合同约定出现本计划应当终止的情形时,本计划将提前终止并进行清算。
	份额面值	人民币 1.00 元。
	投资范围及比例	<p>1、投资范围</p> <p>(1) 金融产品类资产:公募证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金;</p> <p>(2) 现金类资产:现金、各类银行存款(包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款,不含结构性存款)、货币市场基金。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划为混合类产品,投资于金融产品类资产的比例不低于 80%,并通过投向金融产品类资产进行以下比例的资产配置:</p> <p>(1) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%;</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%;</p>



	<p>(3) 商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值不超过资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%;</p> <p>本计划投资于上述资产管理产品的, 计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产, 且按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率, 并按照所投资资产管理产品的披露频率更新计算计划所投资资产的金额或比例。</p> <p>如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主观因素之外的因素, 造成本计划投资比例不符合法律、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, 管理人应自超标发生之日起在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的 15 个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的, 管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p>
<p>投资限制</p>	<p>为维护委托人的合法权益, 本计划的投资限制为:</p> <p>(1) 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%; 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%, 单一融资主体及其关联方的非标准化资产, 视为同一资产合并计算。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。本计划属于基金中基金资产管理计划 (FOF), 基金中基金资产管理计划投资“定制”的子基金, 并持有有一个或多个子基金产品的全部份额的, 可豁免单只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%的组合投资要求;</p> <p>(2) 本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%, 计算总资产时, 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, 中国证监会另有规定的除外;</p> <p>(3) 本计划投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品的, 该等资产管理产品不得再投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品, 金融监管机构另有规定的除外;</p> <p>(4) 现行有关法律法规修订变化后, 若上述投资限制与之产生抵触, 应以有关法律法规规定为准, 同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容; 如法律法规或监管部门修改或取消上述限制, 履行适当程序后, 本计划可相应调整投资组合限制的规定。</p> <p>禁止行为</p> <p>本计划的禁止行为包括:</p> <p>(1) 违规将本计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途;</p> <p>(2) 将本计划资产用于可能承担无限责任的投资;</p>

	<p>(3) 向委托人做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺;</p> <p>(4) 侵占、挪用本计划资产;</p> <p>(5) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营;</p> <p>(6) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额;</p> <p>(7) 以获取佣金或者其他不当利益为目的, 使用本计划资产进行不必要的交易;</p> <p>(8) 内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为;</p> <p>(9) 为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利;</p> <p>(10) 利用本计划进行商业贿赂;</p> <p>(11) 利用本计划或者职务便利为委托人以外的第三方谋取不正当利益;</p> <p>(12) 直接或者间接向委托人返还管理费;</p> <p>(13) 不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目(证券市场投资除外), 包括但不限于以下情形:</p> <p>1) 投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录;</p> <p>2) 投资项目违反国家环境保护政策要求;</p> <p>3) 通过穿透核查, 资产管理计划最终投向上述投资项目。</p> <p>(14) 不得将本计划财产用于投资房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款或补充流动资金; 前述关于“房地产价格上涨过快热点城市”、“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定, 以基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第4号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准。</p> <p>(15) 本计划不得直接投资于商业银行信贷资产;</p> <p>(16) 本计划不得违规为地方政府及其部门提供融资, 不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保;</p> <p>(17) 本计划不得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;</p> <p>(18) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p> <p>上述禁止行为由管理人监控。</p>
<p>投资策略</p>	<p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划在严格控制风险的基础上, 通过对全球经济形势、中国经济发展(包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况)、证券市场估值水平等的研判, 动态调整计划大类资产的投资比例, 力争</p>

		<p>为本计划资产获取稳健回报。</p> <p>2、FOF 投资管理策略</p> <p>在 FOF 的投资管理模式下，第一创业证券作为管理人，负责根据宏观经济运行情况及投资风格表现制定资产配置策略，选聘市场上投资管理能力优秀、投资风格清晰、投资收益稳定的私募基金管理人，投资于上述私募基金管理人成立的私募证券投资基金，并对私募基金管理人的投资业绩进行评估及管理。</p> <p>(1) 子基金管理人筛选</p> <p>对全市场的私募管理人进行分析研究，采用漏斗式，逐层深入的方式进行筛选，并创立了 4P+1S 管理人评级体系，通过多数据库、多资产类别、多策略覆盖方式对私募管理人进行全市场覆盖；通过多维度数量模型建立投顾基础池；通过实地尽调、业绩归因分析、策略甄别建立重点池；通过独特的 Alpha 因子、业绩可持续性分析、稳定架构等建立的核心池。</p> <p>(2) 子基金策略介绍</p> <p>1) 股票多头策略</p> <p>通过挑选优秀的个股，以战胜市场指数为目标。</p> <p>2) 股票中性策略</p> <p>股票中性策略采用股指期货空头、融券、期权等手段，与股票多头进行对冲，其目的是获取与市场走势不相关的选股收益。股票中性策略运作会受股指期货的升贴水幅度、股票市场的波动率、股票市场的成交量等因素影响。</p> <p>3) CTA 策略</p> <p>CTA 策略是商品期货策略，主要包括商品趋势策略和商品套利策略，其中商品套利策略又分为跨期套利和跨品种套利。CTA 策略由于投资于商品市场，其收益走势主要受商品期货涨跌影响，与股票市场相关性较低，可以与股票投资形成较好的风险分散。</p> <p>3、现金及准现金类资产投资策略</p> <p>现金及准现金类资产包含银行存款、货币市场基金、现金（包括结算备付金）等。</p> <p>本集合计划将在确定总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、银行存款的期限来确定现金类资产的配置，并定期对现金类资产组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。</p>
	风险收益特征	中高（R4）风险等级
	适合推广对象	适合且仅能向风险承受能力为 C4（积极型）级及以上的合格投资者销售。
当 事	管 理 人	第一创业证券股份有限公司
	托 管 人	国泰君安证券股份有限公司

人	投资顾问	本计划未聘请投资顾问
	销售机构	第一创业证券股份有限公司及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本计划的机构
初始募集期间	募集期限	本计划的初始募集期为自本计划启动募集之日起不超过 60 日的期间，具体募集期间以本计划推广公告为准；管理人有权根据本计划销售的实际情况延长（但最长不得超过 60 日）或缩短募集期限，此变更适用于所有销售机构，管理人延长或缩短募集期限的，将在管理人指定网站公告。
	认购费用及认购份额计算	<p>(1) 认购费率</p> <p>本计划无认购费，即认购费率为 0。</p> <p>(2) 认购份额的计算方法</p> $\text{认购份额} = (\text{认购金额} + \text{应计利息}) \div 1$ <p>注：本计划份额计算时采用四舍五入，保留至 0.01 份，由此产生的误差计入本计划财产；多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。</p>
	初始认购资金的管理及利息处理方式	销售机构应当将本计划初始募集期间投资者的资金存入募集账户，在本计划募集期限结束前，任何机构和个人不得动用。本计划成立前，认购款在募集账户产生的利息将折算为本计划份额归委托人所有，其中利息金额以注册登记机构的记录为准。
	最低认购金额	投资者首次认购本计划的最低认购金额为人民币 400,000 元（不含认购费），超额部分不设金额级差，管理人可以根据法律法规的规定及本计划运作的实际情况设置和调整最低认购金额（但最低不得低于人民币 40 万元），并提前披露。投资者可以多次参与本计划，投资者多次参与本计划的每次最低参与金额为人民币 1 万元，超过部分不设金额级差。
集合计划成立的条件、时间		初始募集期限届满时，本计划的初始募集规模不低于人民币 1000 万元且其委托人的人数为 2 人至 200 人（含管理人自有资金参与份额），募集过程符合法律法规和中国证监会的规定，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对本计划进行验资并出具验资报告后，管理人公告本计划成立。
集合计划设立失败		初始募集期限届满，在本计划初始募集规模低于人民币 1000 万元或委托人的人数少于 2 人条件下，本计划设立失败，管理人以固有资产承担本计划因募集行为而产生的债务和费用，并在募集期届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。
集合计划的参与和退出	办理场所	本计划的参与和退出场所为管理人及代理销售机构（如有）的营业场所或按照管理人及代理销售机构（如有）提供的其他方式办理参与和退出。
	办理时间	本计划自成立之日起每年 3 月、6 月、9 月与 12 月第三个周五（如遇非交易日则提前至前一个交易日）开放申购，每年 1 月与 7 月第一个周五（如遇非交易日则提前至前一个交易日）开放赎回，具体开放时间以管理人公告为准。在开放期内的工作日，委托人可办理参与和/或退出业务。
	临时开放期	因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订或因本计划运作的实际情况需要变更合同及在发生其他必要情况时，管理人有权设定临时开放期，为委托人办理退出业务，临时开放期的具体安排以管理人公告为准，管理人需提前通知托管人及运营服务机构。
	参与和退出的方式、价格、程序及确认	<p>(1) “未知价”原则，即参与价格为注册登记机构受理参与申请日（T 日）本计划的单位净值，退出价格为注册登记机构受理退出申请当日本计划单位净值；</p>

	<p>(2) 本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；</p> <p>(3) 参与和退出申请的确认：投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理参与或退出，投资者以书面签名或电子合同方式签署本合同后，方可通过销售机构的交易系统申请参与本计划。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，而仅表示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；</p> <p>对于开放日当日(T日)交易时间结束前受理的有效申购和赎回申请，在正常情况下，本计划注册登记机构在T+3个工作日内对该申请的有效性进行确认。委托人可在申请日后第4个工作日至各销售网点查询确认情况；</p> <p>对于委托人的参与申请，若参与申请全额确认后规模超过本计划规定的规模上限或超过本计划规定的人数上限时，管理人可暂停接受参与申请，对当日(T日)已提交的参与申请，注册登记系统根据“时间优先、金额优先、申请单号优先”的先后原则逐笔确认，即相同时间金额大者优先确认；相同金额申请单号小者优先确认。未确认部分的参与资金，由销售机构退还至委托人账户中。以上处理规则亦适用于初始募集期间超额募集的情况；</p> <p>对于委托人的退出申请，管理人按照先进先出的原则予以确认，也即是按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额并适用相应的退出费率；</p> <p>(4) 参与和退出申请的款项支付：投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购的货币资金；若交易账户内资金不足，销售机构将不受理该笔参与申请；</p> <p>委托人退出申请确认成功后，管理人应按照本合同约定向委托人支付退出款项，退出款项于确认之日起7个工作日内从托管账户中划出。在发生巨额退出的情形时，款项的支付办法参照本合同的有关条款处理。如本计划出现暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。委托人申请退出份额数量超过委托人持有份额数量时，申请无效。</p> <p>(5) 管理人可根据本计划运作的实际情况并不影响委托人实质利益的前提下调整上述原则。管理人必须在新规则开始实施前在管理人指定网站公告告知委托人。</p>
参与和退出的金额限制	<p>投资者在本计划存续期内的参与开放期参与本计划的，如投资者在提交参与申请时未持有本计划份额的，则首次参与金额应不低于人民币400,000元(不含参与费)，已持有本计划份额的委托人在本计划存续期内的参与开放期追加参与本计划份额的除外。投资者可以多次参与本计划，投资者多次参与本计划的每次最低参与金额为人民币1万元，超过部分不设金额级差。</p> <p>当委托人持有的本计划份额资产净值高于人民币400,000元时，委托人可以在本计划的退出开放期内选择全部或者部分退出本计划，选择部分退出的，委托人在退出后持有的本计划份额资产净值不得低于人</p>

		<p>人民币 400,000 元。当管理人发现委托人申请部分退出本计划将导致其在部分退出申请确认后持有的本计划份额净值低于人民币 400,000 元的，管理人有权适当减少该委托人的退出份额，以保证部分退出申请确认后该委托人持有的本计划份额资产净值不低于人民币 400,000 元。当委托人持有的本计划份额资产净值低于（含）人民币 400,000 元时，需要退出本计划的，委托人应当选择一次性全部退出本计划，否则管理人有权发起强制退出委托人持有的本计划全部份额。</p> <p>如相关法律法规变更导致前述约定不再符合法律法规规定的，管理人有权根据变更后的法律法规要求，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制，管理人必须在新规则开始实施前在管理人网站指定公告告知委托人。</p>						
参与和退出的费用	<p>(1) 参与费用 本计划无参与费，即参与费率为 0。</p> <p>(2) 退出费用</p>	<table border="1" data-bbox="496 846 1219 976"> <tr> <td></td> <td>持有期\geq365 天</td> <td>持有期$<$365 天</td> </tr> <tr> <td>退出费率</td> <td>0</td> <td>1%</td> </tr> </table>		持有期 \geq 365 天	持有期 $<$ 365 天	退出费率	0	1%
	持有期 \geq 365 天	持有期 $<$ 365 天						
退出费率	0	1%						
参与份额和退出金额的计算		<p>(1) 参与份额的计算</p> <p>参与份额=参与金额\div注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值</p> <p>注：本计划份额计算时采用四舍五入，保留至 0.01 份，由此产生的误差计入本计划财产；多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。</p> <p>(2) 退出金额的计算</p> <p>退出金额=退出总额-实际退出费-管理人业绩报酬（如有）</p> <p>退出总额=退出份额\times注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值</p> <p>实际退出费=原始退出费-返回退出费</p> <p>返回退出费=原始退出费\times（管理人业绩报酬（如有）/单位净值）/确认份额</p> <p>原始退出费=退出总额\times退出费率</p> <p>注：退出金额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。</p>						
管理人自有资金参与情况		<p>管理人不以自有资金参与本计划。</p>						
集合计划份额转让		<p>本计划存续期间，在各项条件均满足的情况下，委托人可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让本计划份额，受让方必须是符合《运作管理规定》规定和本合同约定的合格投资者，份额转让应遵守相应的交易场所的相关规定及要求并按规定办理份额变更登记手续。</p> <p>管理人和托管人无需就本计划份额转让事宜与委托人另行签订协议。但委托人与受让人应签署转让协议，并将该转让协议发送给管理人、托管人书面确认，托管人在管理人已书面同意的情况下予以确认。受</p>						

	<p>让方首次参与本计划，应先与管理人、托管人签订资产管理合同。</p> <p>管理人可以视情况开放本计划的份额转让，管理人应在本计划开放份额转让前5个工作日通过网站公告，份额转让事宜以管理人公告为准。</p>
<p>费用、报酬</p>	<p>费用种类（计提标准、方法、支付方式）</p> <p>1、管理费：</p> <p>本计划管理人管理费按本计划前一日净值的1%年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 1\% \div 360$ <p>H为每日应计提的管理费；</p> <p>E为本计划前一日净值。</p> <p>本计划管理费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前5个工作日内向托管人出具管理费投资指令，经托管人核对无误后从本计划财产中一次性支付给管理人。</p> <p>2、托管费：</p> <p>本计划托管人托管费按本计划前一日净值的0.025%年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.025\% \div 360$ <p>H为每日应计提的托管费；</p> <p>E为本计划前一日净值。</p> <p>本计划托管费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前5个工作日内向托管人出具托管费投资指令，经托管人核对无误后从本计划资产中一次性支付给托管人。</p> <p>3、运营服务费：</p> <p>本计划运营服务机构的运营服务费按本计划前一自然日净值的0.025%年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.025\% \div 360$ <p>H为每日应计提的运营服务费；</p> <p>E为本计划前一自然日资产净值。</p> <p>本计划运营服务费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前5个工作日内向托管人出具运营服务费划款指令，经托管人核对无误后从本计划资产中一次性支付给运营服务机构。</p> <p>若本计划现金资产不足以支付管理费、托管费和运营服务费的，则相应顺延至本计划现金资产足以支付之日支付。</p> <p>管理人和托管人协商一致可以调低管理费率或者托管费率，并通过管理人网站公告告知委托人。</p> <p>4、证券交易费用</p> <p>证券交易费用指本计划进行各类投资品种的投资交易而形成的费用，包括但不限于：印花税、交易所经手费、证管费、银行间交易手续费、场外基金办理要求的申购赎回费等费用、结算费、过户费、佣金等</p>

		<p>各项费用，证券交易费用在交易发生时直接计入当期费用；以上各项费用的费率标准按照相关法规政策执行，其中交易佣金的费率由管理人本着保护本计划及委托人利益的原则，按照法律法规的规定确定。</p> <p>5、其他费用</p> <p>在存续期间发生的本计划审计费用，由本计划承担，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。</p> <p>银行间市场账户开户费及维护费、证券账户开户费、存续期间信息披露费、电子合同服务费、注册登记费、银行汇划手续费、账户管理费、会计师费及律师费等本计划运营过程中发生按照国家有关规定可以列入的其他相关费用，按费用实际支出金额支出，列入或摊入当期本计划费用。</p>
	不列入资产管理计划费用的项目	<p>本计划成立前发生的费用（包括但不限于计划初始募集期发生的信息披露费、会计师费、律师费等相关费用），以及存续期间发生的与推广有关的费用，管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或本计划资产的损失以及处理与本计划运作无关的事项发生的费用等不得列入本计划费用。</p>
	业绩报酬	<p>本计划管理人不收取业绩报酬。</p>
收益分配		<p>本计划的收益分配方案依据法律法规的规定及本合同的约定执行：</p> <p>（一）收益的构成</p> <p>收益包括：本计划投资所得收益、利息、红利、银行存款利息及其他合法收入。</p> <p>本计划的净收益为本计划收益扣除按照国家有关规定可以在本计划收益中扣除的费用后的余额。</p> <p>（二）可供分配利润：指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数，实际分配利润的比例由管理人根据本计划运作的实际情况确定。</p> <p>（三）收益分配原则</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、每一计划份额享有同等分配权； 2、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配； 3、收益分配基准日的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； 4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担； 5、集合计划成立不满6个月可不进行收益分配； 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 <p>（四）收益分配对象</p> <p>分红权益登记日所有持有本计划的委托人。</p> <p>（五）收益分配时间</p> <p>本计划存续期间，管理人根据具体情况进行收益分配，具体分配时间以管理人公告为准，但收益分配的间隔期间不得短于6个月。</p> <p>（六）收益分配方案的内容</p> <p>收益分配方案须载明收益的范围、净收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配金额及比例、分配方式等内容。</p> <p>（七）收益分配方案的确定与披露</p> <p>本计划收益分配方案由管理人拟定，经托管人复核总金额后由管理人向委托人公告，但托管人不负责复核分配明细。</p>

	<p>(八) 收益分配中发生的费用</p> <p>收益分配时发生的银行转账等手续费用由本计划委托人自行承担, 分红款项将于本次分红权益登记日起 T+3 个工作日内从托管户划出。</p> <p>(九) 收益分配方式</p> <p>本计划仅以现金红利方式向投资者分配收益。</p>
<p>信 息 披 露</p>	<p>定期报告</p> <p>定期报告包括本计划单位净值报告、本计划的资产管理季度及年度报告、托管季度及年度报告、年度审计报告和对账单。</p> <p>1、本计划单位净值报告</p> <p>披露时间: 本计划存续期内管理人应每周公告一次计划单位净值及计划累计单位净值。本计划每个开放日 (T 日) 的计划单位净值及计划累计单位净值将于 T+3 个工作日内在管理人网站上公布。</p> <p>披露方式: 本计划的单位净值、累计单位净值等信息将在管理人指定网站上披露, 委托人可随时查阅。若管理人指定网站变更, 管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>2、本计划的季度报告和年度报告</p> <p>(1) 本计划的资产管理季度报告</p> <p>管理人每季度结束之日起一个月内向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告, 对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理季度报告由管理人编制, 经托管人复核后由管理人通过管理人网站公告, 并报基金业协会备案, 同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p> <p>本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月的, 可以不编制当期的季度报告。</p> <p>(2) 本计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人每年度结束之日起四个月内向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告, 对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理年度报告由管理人编制, 经托管人复核后由管理人通过管理人网站公告, 并报基金业协会备案, 同时抄报管理人住所地中国证监会派出机构。托管人在每年度结束之日起四个月内向委托人提供一次年度托管报告, 年度托管报告由管理人通过管理人网站公告。</p> <p>本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月的, 可以不编制当期的年度报告。</p> <p>(3) 资产管理年度报告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) 本计划投资表现; 4) 本计划投资组合报告; 5) 本计划运用杠杆情况 (如有); 6) 本计划财务会计报告;

		<p>7) 本计划支付的管理费、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；</p> <p>8) 本计划投资收益分配情况；</p> <p>9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及委托人权益的重大事项；</p> <p>10) 中国证监会规定的其他事项。</p> <p>资产管理季度报告应当披露前述除第6)项之外的其他信息。</p> <p>3、年度审计报告</p> <p>管理人应当进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本计划出具单项审计意见。</p> <p>管理人应当将审计结果报基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构，并将本计划的单项审计意见通过管理人网站公告。本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月时，可以不编制当期的年度审计报告，产品终止当年，无需出具年度审计报告。</p> <p>4、对账单</p> <p>管理人至少每个季度以邮寄向委托人寄送对账单。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。</p> <p>委托人应向管理人提供邮寄地址等资料，因委托人未正常提供以上信息、邮寄运营商系统平台故障及内部操作等非管理人原因导致委托人未能获得邮寄对账单的，管理人不承担任何责任。</p>
	<p>临时报告</p>	<p>本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、资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5日内以管理人指定网站或其他途径和方式及时向委托人披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人或托管人变更； 2、本计划运作过程中，负责本计划的投资经理发生变更，或出现其他可能对本计划的持续运作产生重大影响的事项； 3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请； 4、本计划终止和清算； 5、本合同的补充、修改与变更； 6、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项； 7、负责本计划的代理销售机构发生变更； 8、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格； 9、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

		<p>10、资产计价出现错误（当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；</p> <p>11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；</p> <p>12、其他发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件。</p>
利益冲突	利益冲突的情形	<p>本计划存在或可能存在如下利益冲突的情形：</p> <p>1、若发生管理人开展的不同业务之间的敏感信息不当流动和使用，导致管理人其他业务与管理人资产管理业务可能存在利益冲突；</p> <p>2、若发生不同投资经理管理的资产管理计划的持仓、交易等重大非公开信息的不当流动和使用，导致管理人管理的不同资产管理计划之间可能存在利益冲突；</p> <p>3、若发生管理人从业人员利用知悉的敏感信息参与资产管理计划且未按规定进行申报和披露的，导致管理人从业人员与资产管理计划及委托人之间可能存在利益冲突；</p> <p>4、其他可能存在的管理人、管理人从业人员与资产管理计划及管理人管理的不同资产管理计划之间可能存在的利益冲突情形。</p>
	利益冲突的处理方式及披露	<p>1、利益冲突的处理方式</p> <p>管理人制定了信息隔离墙管理办法及利益冲突管理办法，并在业务开展过程中严格执行业务隔离和利益冲突防范的机制，对利益冲突进行识别和管理，若发现存在利益冲突情形的，管理人将遵循如下原则及时予以处理，维护本计划及委托人的合法权益：</p> <p>（1）在处理涉及到公司、从业人员与客户之间的利益冲突时，严格坚持客户利益至上的原则；</p> <p>（2）在处理涉及到客户与客户之间的利益冲突时，严格坚持公平对待客户的原则。</p> <p>2、利益冲突的披露</p> <p>对于实际发生的利益冲突情形，管理人将自发现之日起5个工作日内通过管理人网站公告将利益冲突的具体情形及管理人的处理安排等告知委托人。</p>
终止和清算		<p>资产管理计划的终止</p> <p>有下列情形之一的，本计划应当终止：</p> <p>1、本计划存续期届满且不展期；</p> <p>2、经全体委托人、管理人和托管人协商一致决定终止的；</p> <p>3、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，且在六个月内没有新的管理人承接；</p> <p>4、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，且在六个月内没有新的托管人</p>

承接:

5、本计划存续期间,持续5个工作日委托人少于2人;

6、本计划成立后,未在基金业协会完成备案或未通过基金业协会的产品备案或未取得产品的备案确认函的,则管理人有权终止本计划,且不承担任何责任;

7、不可抗力发生导致本计划不能存续;

8、因监管政策或监管规则的变化导致本产品违反相关监管政策或监管规则要求的,或监管机构通知(无论是口头或书面形式的通知)管理人停止开展此类资产管理产品的,则管理人有权停止开放本计划份额的参与并终止本计划,且不承担任何责任;

9、本计划净值低于或等于止损线且资产管理人完成平仓操作,将可变现的非现金资产全部变现的;

10、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。

管理人应当自本计划终止之日起5个工作日内报基金业协会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出机构,前述第6项约定的情形除外。

资产管理计划的清算

1、本计划财产清算小组

本计划在发生终止情形起5个工作日内,由管理人和托管人组织成立本计划财产清算小组,在本计划财产清算小组接管本计划财产之前,管理人和托管人应按照本合同的约定继续履行保护本计划财产安全的职责。

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,本计划财产清算小组负责本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配,本计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、本计划清算程序

(1) 本计划终止情形发生后,由本计划财产清算小组负责统一接管本计划财产;

(2) 本计划财产清算小组根据情况确定具体的清算期限;

(3) 本计划财产清算小组对本计划财产进行清理和确认;

(4) 对本计划财产进行评估和变现;

(5) 制作清算报告;

(6) 将清算报告报基金业协会、管理人住所地中国证监会派出机构并告知委托人;

(7) 对本计划财产进行分配。

3、本计划清算费用

清算费用是指本计划财产清算小组在进行本计划财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由本计划财产清算小组优先从本计划财产中支付。

4、本计划财产清算及剩余资产的分配

依据本计划财产清算的分配方案，将本计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后，按本计划委托人持有的计划份额比例进行分配，本合同另有约定的除外，本计划财产按照以下顺序进行分配：

(1) 支付清算费用；

(2) 缴纳所欠税款；

(3) 清偿本计划债务：本计划债务主要包括应付管理费、托管费、银行间账户维护费、交易佣金、证券交易费用、银行汇划费用、销户费、管理人代表本计划及委托人处理本计划涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出等，除交易所、证券登记结算机构等自动扣缴的费用外，其他费用的清偿由管理人、托管人核对无误后，由管理人向托管人出具投资指令，由托管人复核后支付。

(4) 按本计划委托人所持计划份额比例进行分配；

本计划财产未按前述第(1)、(2)、(3)项约定进行清偿前，不得分配给本计划委托人。

5、本计划二次清算

若本计划在终止之日有未能流通变现的证券或金融产品，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券或金融产品可在流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式分配给委托人，二次清算期间，管理人、托管人继续按照本合同约定计提管理费、托管费及其他费用。发生二次清算情形的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。

6、本计划清算报告的告知安排

清算结果由本计划财产清算小组结束后通过管理人网站向委托人进行披露。并报告管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。

7、本计划相关账户销户

(1) 证券类账户销户

本计划证券类资产完成变现、结清相关权益、缴清相关费用后，托管人负责证券类账户的销户工作，管理人负责基金账户销户，销户过程中其他各方应给以必要的配合。

在证券资产变现完毕、相关权益结清后5个工作日内，管理人将托管人注销证券账户的通知书及其他销户资料寄送托管人，托管人原则上应于收到管理人提供资料后的10个工作日内完成。

	<p>管理人在开放式基金变现完毕、相关权益结清后 15 个工作日内完成场外开放式基金账户注销，并向托管人出具销户确认通知书。</p> <p>(2) 银行托管账户销户</p> <p>本计划财产清算完毕后管理人应向托管人申请注销本计划财产托管账户。</p> <p>与本计划财产有关的其他账户的销户，由管理人与托管人协商一致后办理。</p> <p>8、本计划存续及清算期间，为支付本计划财产承担的各项税费，管理人有权预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的税费的，差额部分由管理人通知委托人补足，管理人不承担垫付责任，委托人应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。</p> <p>本计划清算期间，为支付最低备付金、结算保证金，管理人应预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的备付金、保证金金额的，差额部分由管理人通知委托人补足，管理人不承担垫付责任，委托人应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。</p> <p>9、本计划清算账册及文件应当由管理人自清算完毕之日起保存 20 年以上。</p>
<p>特别说明</p>	<p>本说明书作为《资管管理合同》的重要组成部分，与《资管管理合同》具有同等法律效力。</p>

2021.06.18

