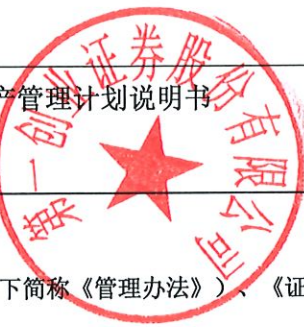


第一创业金选 FOF1 号集合资产管理计划说明书

2024 年 8 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》）、《第一创业金选 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。

投资者承诺以真实身份参与集合计划，保证参与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》的投资者，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。投资者将按照《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	第一创业金选 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	1、投资范围 (1) 资产管理产品：公开募集证券投资基金、证券公司及证券公司子公司资产管理计划、基金公司及其基金公司子公司资产管理计划、期货公司及期货公司子公司资产管理计划、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、银行理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品； (2) 现金类资产：包括现金、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。 2、投资比例 按市值计算，本计划投资于资产管理产品的比例不低于资产总值的 80%；并通过投向资产管理产品进行以下比例的资产配置： (1) 按市值计算，固定收益类资产的投资比例低于资产总值的 80%； (2) 按市值计算，权益类资产的投资比例低于资产总值的 80%；



	(3) 期货和衍生品类资产的持仓合约价值（非轧差计算）低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%； (4) 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； (5) 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%；除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外，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。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者不包括募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品）且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划，以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划，不受前述关于投资于同一资产的比例限制。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，并持有一个或者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；集合资产管理计划投资其他资产管理产品的，投资单只资产管理产品的比例，以及按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例，均应当符合组合投资相关要求。 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。本计划投资于公开募集证券投资基金的，按照穿透原则合并计算投资同类资产金额需符合本计划资产配置比例的要求。本计划投资于其他私募资产管理产品的，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者同类资产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，更新计算计划所投资资产金额或者比例。
投资限制	(1) 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； (2) 本计划投资除公开募集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开募集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； (3) 本计划投资除公开募集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投资《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产； (4) 本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，本计划的总资产不得超过其净资产的 120%。本计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会

	认可的投资品种不受前述规定限制； 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；如法律法规或者监管部门修改或者取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。
投资策略	(1) 资产配置策略 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，力争为计划资产获取稳健回报。 (2) 资产管理产品投资管理策略 本计划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、投资收益稳定的管理人，投资于上述管理人成立的资产管理计划、私募证券投资基金等资产管理产品，并对管理人的投资业绩进行评估及管理。 1) 子基金筛选 对全市场的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、多策略覆盖方式对管理人进行全市场覆盖；通过多维度数量模型建立备选池；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、稳定架构等建立核心池。 2) 子基金主要策略介绍 ① 日内回转套利策略 股票日内回转套利策略，也称为股票 T+0 交易策略，指利用已持有的底仓进行高抛低吸，针对同一支股票在同一个交易日内完成一次或多次买入和卖出的周转，收盘的时候保持账户的持股数量不变，通过市

	场波动的差价而获利。 ②期货高频套利策略 期货高频指利用期货市场上升或下降的趋势，交易对象价格的波动，利用复杂的计算机技术和系统，以毫秒级的速度执行交易且日内短暂持仓，交易的品种包括股指期货和商品期货。期货高频策略会考虑到交易费用、买卖价差、下单方式和交易速度这几个重要因素，其中对交易速度的追求是高频交易策略的核心竞争力之一。 ③商品期货策略 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。商品期货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。 ④ETF 套利策略 ETF 套利策略主要分为两种：一是折价套利，当 ETF 基金份额二级市场价格小于基金份额净值时，可通过二级市场买入 ETF，之后在一级市场赎回一篮子股票，卖出股票组合获取现金进行套利。另外一种溢价套利，和折价套利的方向相反，当 ETF 二级市场价格超过份额净值时，可买入股票组合，一级市场申购基金份额，之后在二级市场卖出获取现金。 ⑤期权套利策略 期权套利策略主要分为期权波动率套利策略和期权无风险套利策略，期权波动率套利策略指某一个市场中隐含波动率经常大于历史波动率时，通过卖空期权或期权组合，并进行 Delta 对冲的套利策略。无风险套利策略指某期权的单腿合约或者多腿组合超出了理论定价边界之外，那么就形成了无风险套利机会，在手续费、对手价和滑点在可接受范围内时，可以进行套利交易。 ⑥可转债套利策略 可转债套利策略指利用可转债的特性进行股债轮动，以可转债和对应股票之间的交易获取套利收益，其策略实际为赚取转股溢价率波动收益。 ⑦ 股票中性策略 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。 ⑧ 量化可转债策略 量化可转债策略充分利用可转换债券的独特债券属性及其内含的期权属性，专注于分析转债的基本面
--	---

		数据、量价因子以及股债联动的特有指标。通过应用精确的量化选股技术、日内 T0 交易和程序化交易方法，旨在有效识别并捕捉市场中的 alpha 机会，从而实现超额收益。 ⑨ 股票量化择时策略 股票量化择时策略是一种利用量化方法进行金融市场分析、判断和交易的策略，旨在通过数学模型和算法来预测和把握市场的最佳买卖时机，以实现投资收益的最大化。这种策略通过处理大量数据，寻找市场趋势和模式，从而帮助投资者做出更明智的决策。量化择时策略的核心在于寻找能够识别市场趋势的因子，并制定一套机械化的规则来指导买卖操作。 3、现金及准现金类资产投资策略 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。 本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。
	风险收益特征	R3（中风险）等级
	适合推广对象	适合且仅能向风险承受能力为 C3（稳健型）级及以上或者符合专业投资者标准的合格投资者销售。
当 事 人	管理人	第一创业证券股份有限公司
	托管人	招商证券股份有限公司
	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 个自然日的期间，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 个自然日）或者缩短募集期限，此变更适用于所有销售机构。
	认购费用及认购份额计算	（1）认购费率 本计划无认购费，即认购费率为 0。 （2）认购份额的计算方法 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+应计利息）÷1 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。
	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投资者所有，其中利息金额以注册登记机构的记录为准。未经注册登记机构确认的认购款项将退还给投资者（无利息）。
	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 万元且其投资者的人数为 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、行政法规和中国证监会的规定。 管理人应当自资产管理计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，公告本计划成立。托管人于托管账户收到募集资金的当日向管理人发送《资金到账通知书》。
集合计划募集失败		初始募集期限届满，在本计划初始募集规模低于人民币 1000 万元或者投资者的人数少于 2 人条件下，本计划募集失败。本计划募集失败的，管理人以固有财产承担本计划因募集行为而产生的债务和费用，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）的营业场所或者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月第二个周五开放申购（如遇非交易日提前至前一个交易日），每年 3 月、6 月、9 月、12 月的第二个周五开放赎回（如遇非交易日提前至前一个交易日），具体开放时间以管理人公告为准。
	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者因本计划运作的实际情况需要变更合同时，管理人有权设定临时开放期，为投资者办理退出业务，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	（1）“未知价”原则，即参与价格为注册登记机构受理参与申请当日（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； （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； （3）本计划可采用预约参与退出机制。如采用预约参与退出机制，投资者通过管理人直销方式或者管理人营业网点参与的，应至少提前五个工作日（T-5 日）提交预约申请，管理人可调整预约方式，并通过公告方式提前披露具体预约方案；其他销售机构的预约参与退出安排由销售机构自行确定，具体以销售机构的交易系统规则为准； 如果投资者在预约参与/退出期未通过以上方式提交预约申请的，则管理人有权拒绝投资者的申请；若监管机构另有要求的，从其规定。 （4）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者退出，投资者以书面签名或者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者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者退出申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准； 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。投资者可在申请日后第 4 个工作日至各销售网点查询确认情况； 对于投资者的参与申请，若在 T 日参与申请全额确认后规模超过本计划规定的规模上限或者超过本计

	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，由销售机构退还到投资者账户中。以上处理规则亦适用于初始募集期间超额募集的情况； 对于投资者的退出申请，管理人按照先进先出的原则予以确认，也即是按照投资者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（如有）； （5）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； 投资者退出申请确认成功后，管理人应按照本合同约定向投资者支付退出款项，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。投资者申请退出份额数量超过投资者持有份额数量时，申请无效。 （6）管理人可根据本计划运作的实际情况并在不影响投资者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投资者。
参与和退出的金额限制	投资者在本计划存续期内的参与开放期参与本计划的，投资者应当符合合格投资者标准，如投资者在提交参与申请时未持有本计划份额，则首次参与金额应当不低于人民币400,000元（不含参与费），已持有本计划份额的投资者在本计划存续期内的参与开放期追加参与本计划的除外。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。 当投资者持有的本计划份额资产净值高于人民币400,000元时，投资者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，投资者在退出后持有的本计划份额资产净值不应低于人民币400,000元，否则管理人有权将投资者持有本计划的全部份额发起强制退出。 当投资者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，投资者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投资者持有的本计划全部份额。 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投资者。
参与和退出的费用	（1）参与费用 本计划无参与费，即参与费率为0。 （2）退出费用 本计划退出费率如下：

		<table border="1"> <tr> <td></td><td>持有期≥ 180 天</td><td>持有期< 180 天</td></tr> <tr> <td>退出费率</td><td>0%</td><td>0.5%</td></tr> </table> 退出费由赎回本计划的投资者承担，在投资者赎回本计划份额时收取。投资者申请退出本计划时发生的退出费用全额计入计划资产。		持有期 ≥ 180 天	持有期 < 180 天	退出费率	0%	0.5%
	持有期 ≥ 180 天	持有期 < 180 天						
退出费率	0%	0.5%						
	参与份额和退出金额的计算	(1) 参与份额的计算 净参与金额=参与金额$\div$ (1+参与费率); 参与费用=参与金额-净参与金额; 参与份额=净参与金额$\div$ 注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值; 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。 (2) 退出金额的计算 退出费=(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-管理人业绩报酬(如有))$\times$退出费率; 退出金额=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-管理人业绩报酬(如有)-退出费; 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。						
管理人自有资金参与、退出情况		1、证券期货经营机构及其子公司(孙公司)自有资金参与的条件 在初始募集期间或者存续期内, 证券期货经营机构、其子公司(孙公司)可以以自有资金参与本计划。如参与, 则证券期货经营机构及其子公司(孙公司)以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。法律法规或者中国证监会对证券期货经营机构、其子公司(孙公司)自有资金投资比例另有规定的, 从其规定。 证券期货经营机构、其子公司(孙公司)持有计划份额与其他投资者持有的本计划份额享有同等参与收益分配的权利, 也承担与所持本计划份额相对应损失的责任。证券期货经营机构、其子公司(孙公司)投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。 2、证券期货经营机构及其子公司(孙公司)自有资金参与、退出的条件 (1) 证券期货经营机构、其子公司(孙公司)自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。 (2) 证券期货经营机构、其子公司(孙公司)自有资金在存续期内参与、退出本计划时应当提前 5 个工作日通知投资者和托管人。管理人和托管人应书面达成一致, 同时管理人以公告或者其他方式通知投资者。投资者不同意证券期货经营机构、其子公司(孙公司)自有资金参与、退出的, 应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请。未提出退出申请的, 视同投资者已经同意证券期货经营机构、其子公司(孙公司)自有资金参与、退出。 (3) 投资者和托管人签署本合同即视为同意证券期货经营机构、其子公司(孙公司)可以自行决定在初始募集期间以自有资金参与本计划。						

		但在发生以下特殊情形时，证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金参与、退出可以不受上述条件限制，但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知投资者和托管人，并向住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准： （1）因规模变动等客观因素导致证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金参与份额比例被动超限或者可能被动超限【即证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金投资比例被动超过或者可能被动超过《证券公司风险控制指标计算标准规定》等中国证监会对证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金投资比例的规定，或者证券期货经营机构及其子公司（孙公司）以自有资金参与本计划的份额合计超过或者可能超过本计划总份额的 50%】，证券期货经营机构、其子公司（孙公司）在发生上述超限情形或者可能超限情形之日起 5 个工作日内退出超限部分的参与份额，5 个工作日后仍超限的，证券期货经营机构、其子公司（孙公司）将在其后 5 个工作日处理。 （2）为应对本计划巨额赎回或者解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金参与及其后续退出本计划。
集合计划份额转让		本计划存续期间，在各项条件均满足的情况下，投资者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，份额转让应当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。 管理人和托管人无需就本计划份额转让事宜与投资者另行签订协议。但投资者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。受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。 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。
费用、报酬	费用种类（计提标准、方法、支付方式）	1、管理费 （1）固定管理费 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： 每日应计提的管理费=本计划前一自然日资产净值×1%/365。 管理费自本计划成立日起计算，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划款指令，经托管人核对无误后从本计划财产中支付给管理人。 费用计提如有四舍五入的差异，以会计责任方金额为准。 管理人费用收入账户 户名：第一创业证券股份有限公司 账号：4000023319200099986

开户银行：工行福田支行

(2) 管理人的业绩报酬（浮动管理费）

1) 管理人收取业绩报酬的原则：

①同一投资者不同时间多次参与本计划的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；

②在投资者退出日、本计划分红日及计划终止日，对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬；

③在本计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红中扣除；

④在投资者退出日及本计划终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

⑤投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。

2) 业绩报酬的计提方法与计提比例

每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则初始募集期参与的为注册登记机构份额注册登记日，存续期参与的为份额参与日，红利再投资的为分红除权日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。年化收益率的计算公式如下：

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

P_1 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0^* 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；

D 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（1 年按 365 天计算）；

R 为年化收益率。

管理人业绩报酬计提如下：

年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式
$R < K$	0%	0
$K \leq R$	30%	$Y = M * (R - K) * 30\% * D$

M = 每笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额；

K = 业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准由管理人公告，业绩报酬计提基准将在产品的推广广告中列

	示，若产品存续期间，管理人需变更业绩报酬计提基准的，则管理人将公告新的业绩报酬计提基准，管理人将在新业绩报酬计提基准生效前设置临时开放期供不同意新的业绩报酬计提基准的投资者退出； 初始募集期参与的份额首次计提业绩报酬的上一个业绩报酬计提日指注册登记机构确认初始募集期参与份额的注册登记日；开放期参与的份额首次计提业绩报酬的上一个业绩报酬计提日指参与日。 业绩报酬为本计划的浮动管理费，本计划固定管理费和浮动管理费合并收取的比例不得超过监管机构、自律组织要求的上限。 3) 提取频率：本计划提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次，因投资者退出本计划，管理人按照本合同约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。 4) 业绩报酬提取与支付：业绩报酬从本计划分红资金、退出资金或清算资金中提取；由于业绩报酬的计算涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核由管理人完成，托管人不负责复核业绩报酬，托管人仅根据管理人的指令将退出金额或者分红金额（含业绩报酬）划付至注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人。托管人根据管理人的划款指令从本计划财产中一次性支付。费用计提如有四舍五入的差异，以注册登记机构确认的金额为准。 2、托管费： 本计划托管人托管费按本计划前一日净值的【0.01】%年费率计提，计算方法如下： 每日应计提的托管费=本计划前一自然日资产净值×0.01%/365。 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。 费用计提如有四舍五入的差异，以会计责任方金额为准。 托管人费用收入账户 账户名：招商证券股份有限公司 账号：中国建设银行深圳分行营业部 开户行：44201501100052593402 3、运营服务机构的服务费 本计划运营服务机构的服务费按本计划前一自然日计划资产净值的 0.01%年费率计提，计算方法如下： 每日应计提的服务费=本计划财产前一自然日受托资产净值×0.01%/365 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运营服务机构。
--	--

		服务费收入账户 账户名称：招商证券股份有限公司 银行账号：中国建设银行深圳分行营业部 开户银行：44201501100052593402 若本计划现金资产不足以支付管理费和托管费的，则相应顺延至本计划现金资产足以支付之日支付。 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投资者。 4、证券交易费用 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投资者利益的原则，按照法律法规的规定确定。 5、其他费用 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。 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、诉讼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，列入或者摊入当期本计划费用。
	不列入资产管理计划费用的项目	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募集有关的费用，管理人和托管人因未履行或者未完全履行义务导致的费用支出或者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。
收益分配		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： （一）收益的构成 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。 本计划的净收益为本计划收益扣除按照国家有关规定及本合同约定的可以在本计划收益中扣除的费用后的余额。 （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。 （三）收益分配原则 1、每一计划份额享有同等分配权； 2、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； 3、收益分配时发生的银行转账或者其他手续费用由投资者自行承担； 4、本计划默认现金红利方式，可选择红利再投资方式； 5、本计划成立不满6个月可不进行收益分配； 6、法律法规或者监管机关另有规定的，从其规定。

	(四) 收益分配对象 分红权益登记日所有持有本计划的投资者。 (五) 收益分配时间 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。 (六) 收益分配方案的内容 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。 (七) 收益分配方案的确定与披露 本计划收益分配方案由管理人拟定, 经托管人复核后由管理人向投资者公告。 (八) 收益分配中发生的费用 收益分配时发生的银行转账等手续费用由本计划投资者自行承担, 分红款项将于本次分红权益登记日起 T+5 个工作日内从托管户划出。 (九) 收益分配方案的实施 本计划默认现金红利方式, 可选择红利再投资方式。投资者可修改分红方式。选择现金分红方式的, 管理人将现金红利在扣除业绩报酬后款划往销售机构账户, 再由销售机构划入投资者账户; 选择红利再投资方式的, 分红资金在扣除业绩报酬后按分红除权日当日的单位净值自动转为本计划的份额。红利再投资形成的本计划份额计算保留到小数点后两位, 小数点后两位以后的部分四舍五入, 由此产生的差额计入本计划资产的损益。
信 息 披 露	定期报告 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、托管年度报告、年度审计报告和对账单。 1、本计划单位净值报告 披露时间: 本计划存续期内每周最后一个工作日及每个开放日 (如遇节假日, 则以节假日前最近一个工作日为估值日) 的计划单位净值及计划累计单位净值将于下三个工作日内在管理人网站上公布。 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, 投资者可随时查阅。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。 资产管理计划参与价格为注册登记机构受理参与申请当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。 2、本计划的季度报告和年度报告 (1) 本计划的资产管理季度报告 管理人每季度结束之日起一个月内向投资者提供一次准确、完整的管理季度报告, 对报告期内本计划的运作情况作出说明。资产管理季度报告由管理人编制, 管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告 (如有) 供托管人复核, 托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后, 于 10 日内向管理人反馈复核意见。管理人通过管理人网站公告经托管人复核后的

资产管理季度报告。托管人完成管理人季度报告的复核工作后，向管理人出具履职报告，托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

本计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月的，可以不编制当期的季度报告及托管人履职报告。

集合计划投资股指期货、国债期货的，管理人应当在资产管理季度报告中披露集合资产管理计划参与相关标的的有关情况。若监管机构对集合资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。

(2) 本计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人每年度结束之日起四个月内向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告，对报告期内本计划的运作情况作出说明。资产管理年度报告由管理人编制，管理人应当在每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。管理人通过管理人网站公告经托管人复核后的资产管理年度报告。托管人完成管理人年度报告的复核工作后，向管理人出具履职报告，托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。托管人在每年度结束之日起四个月内向投资者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。

本计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月的，可以不编制当期的年度报告。

集合计划投资股指期货、国债期货的，管理人应当在资产管理年度报告中披露集合资产管理计划参与相关标的的有关情况。若监管机构对集合资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。

(3) 资产管理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) 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；
- 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；
- 8) 本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。

资产管理季度报告应当披露前述除第6)项之外的其他信息。

3、年度审计报告

		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，并要求符合《证券法》规定的会计师事务所就本计划出具单项审计意见。 管理人应当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个月或者存续期间不足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。 4、对账单 管理人至少每个季度以电子或者其他形式向投资者提供对账单，如有调整，管理人将以公告形式通知投资者。对账单内容应包括投资者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。 投资者应向管理人提供电子邮箱地址等资料，因投资者未正常提供以上信息、邮件运营商系统平台故障及内部操作等非管理人原因导致投资者未能获得电子对账单的，管理人不承担任何责任。
	临时报告	本计划存续期间，发生对本计划持续运营、投资者利益、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公告或者其他途径和方式及时向投资者披露，并及时报送管理人住所地中国证监会相关派出机构，具体以监管机构的要求为准。临时报告的情形包括但不限于： 1、管理人或者托管人变更； 2、本计划运作过程中，负责本计划的投资经理发生变更，或者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； 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）； 11、管理费、托管费等费用计提方式或者费率发生变更； 12、其他发生对本计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件。
利益冲突	利益冲突的情形	本计划存在或者可能存在如下利益冲突的情形： 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；

		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； 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投资者之间可能存在利益冲突； 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。
	利益冲突的处理方式及披露	1、利益冲突的处理方式 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，维护本计划及投资者的合法权益： （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； （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。 2、利益冲突的披露 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投资者。
终止和清算		资产管理计划的终止 有下列情形之一的，本计划应当终止： 1、本计划存续期届满且不展期； 2、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在6个月内没有新的管理人承接； 3、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在6个月内没有新的托管人承接； 4、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的； 5、本计划存续期间，持续5个工作日投资者少于2人； 6、本计划成立后，未在基金业协会完成备案的，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、因监管政策或者监管规则的变化导致本产品违反相关监管政策或者监管规则要求的，或者监管机构通知（无论是口头或者书面形式的通知）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、管理人有权根据产品的运作情况决定提前终止本计划；

10、法律、行政法规、中国证监会规定以及资产管理合同约定的其他终止情形。

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，前述第6项约定的情形除外，具体以监管机构的要求为准。

资产管理计划的清算

资产管理计划在发生终止情形之日起5个工作日内开始组织清算资产管理计划财产。

1、财产清算组的成员及职责

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、财产清算程序

(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并告知投资者，具体以监管机构的要求为准；

(7) 对本计划财产进行分配。

3、清算费用及支付方式

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、财产清算剩余资产的分配

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，按本计划投资者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投资者处理本计划涉及诉讼、仲裁或者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) 按本计划投资者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，不得分配给本计划投资者；

(5) 清算后的剩余财产，原则上以货币资金形式进行分配；本合同另有约定的，从其约定；但不得违反中国证监会规定。

5、二次清算的处理方式

若本计划在终止之日有未能流通变现的证券或者金融产品，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者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投资者拥有份额的比例或者本合同的约定，以货币形式分配给投资者，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报告，具体以监管机构的要求为准。

6、延期清算的处理方式

本计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。

7、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投资者进行披露，并报告基金业协会，具体以监管机构的要求为准。

8、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，管理人或者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。

(2) 银行托管账户销户

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银行托管账户，并提供齐全的销户资料，托管人应予以配合。

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。

	9、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投资者补足，管理人不承担垫付责任，投资者应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。 本计划清算期间，为支付最低备付金、结算保证金，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备付金、保证金金额的，差额部分由管理人通知投资者补足，管理人不承担垫付责任，投资者应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。 10、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。
特别说明	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。

2024 年 8 月 19 日



