

# 东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划说明书（第三版）

## 特别提示：

本说明书依据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》）、《集合资产管理计划管理合同内容与格式指引（试行）》、《东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《管理合同》）及其他有关法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定制作，管理人保证本说明书的内容真实、准确、完整，不存在任何虚假内容、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，并符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》及管理合同中关于“合格投资者”的要求，保证受托资产的来源及用途合法，所披露或提供的信息和资料真实，并已阅知管理合同和《说明书》全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。

管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用受托资产，不保证受托资产一定盈利，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。

投资者签订《管理合同》且合同生效后，投资者即为《管理合同》的投资者，其认购或申购集合计划份额的行为本身即表明其对《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》、《运作规定》、《管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

集 合 计 划 基 本 信 息	名称	东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划
	类型	固定收益类集合资产管理计划，基金中基金资产管理计划（FOF）
	管理期限	本集合计划的存续期限为自集合计划成立之日起的 10 年，在合同约定的条件下可以展期、提前终止。
	投资范围	本集合计划主要投资于受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的固定收益类私募资产管理产品、混合类私募资产管理产品、国债、地方政府债、央行票据、金融债、可交换债券、可转换债券、企业债、公司债、债券逆回购、债券正回购、现金、银行存款、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等。 如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理

	<p>人在与资产托管人及代销机构协商一致并履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围，并应为管理人和托管人相关系统准备以及投资组合调整留出必要的时间。</p>
投资策略	<p>1、资产管理产品投资策略</p> <p>通过管理人对宏观经济和金融市场的分析判断制定资产配置方案，建立资产管理产品池作为投资的依据。</p> <p>本集合计划管理人根据宏观经济情况确定资产配置方向，选择相应策略和风格的管理人。同时利用市场波动，动态调整不同产品间的配置结构，进一步提升产品收益。通过对投资对象的风险收益特征分析以及投资特性分析，选择符合条件的资产管理产品进行投资，并定期进行行业业绩跟踪和分析，适时作出相应的投资调整。</p> <p>管理人的投研团队建立了一套资产管理产品及其管理人的筛选体系，通过定量和定性相结合的方式，对资产管理产品的管理人的投研能力、投资风格、业绩可持续性和管理团队等进行细致分析，筛选出符合条件的管理人及其管理的资产管理产品。其中定量分析主要通过业绩与风险指标在数据库中进行筛选，包括历史投资收益率、投资策略、回撤控制能力等指标，对于每个指标在同类策略中横向打分；定性方法主要用于投资策略及投资理念、市场风格适应能力、公司治理等方面深入评价和分析。</p> <p>2、现金类管理工具投资策略</p> <p>本集合计划将投资于银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金等高流动性短期金融产品来保障资产的流动性。</p>
投资限制	<p>1、本集合计划的总资产不超过净资产的200%，计算本集合计划总资产，需按照穿透合并计算所投资资产管理产品的总资产；</p> <p>2、资产管理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本计划净资产50%的，该计划的总资产不得超过净资产的120%。资产管理计划投资于国债、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；</p>

	<p>3、本集合计划投资于同一资产的资金，不超过本集合计划资产净值的25%；</p> <p>4、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，不超过该资产的25%，投资于定制的私募资管产品（即本集合计划持有一个或多个私募资产管理产品全部份额）的情况，可豁免此限制；</p> <p>5、本计划投资的资产管理产品，不得再投资于公募基金以外的其他资产管理产品；</p> <p>6、本计划投资的资产管理产品，不得投资非标准化资产；</p> <p>7、相关法律法规约定的其他投资限制。</p> <p>本计划为固定收益类FOF集合资产管理计划，投资于固定收益类资产管理产品的比例不低于本计划资产的80%。投资于债权类资产，按照穿透合并计算的市值合计不低于本集合计划资产总值的80%。所投资标的产品持仓的各类资产市值以相应产品的信息披露义务人（投资标的产品的管理人、管理人委托的第三方服务机构或托管人，下同）提供的最近定期报告为准。</p> <p>本计划投资于其他资产管理产品的，计算本计划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。本计划投资于其他资产管理产品（公募基金除外）的，计算同一资产时，除对资产管理产品的直接投资比例进行监控外，还应按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一资产的金额，并符合中国证监会的相关规定。</p>
运作方式	<p>开放式集合资产管理计划。</p> <p>1、封闭期：开放期以外的期间，均为本集合计划的封闭期。封闭期内不办理参与、退出业务。</p> <p>2、开放期：本集合计划每周第一个工作日开放申购赎回，如遇节假日则顺延至下一个交易日，具体开放期以管理人公告为准。</p> <p>3、临时开放期：若因本计划管理人决定展期或变更合同的，管理人将通过网站公告的形式征询投资者的意见。投资者不同意的，管理人将为不同意的投资者设置临时开放期，临时开放期内投资者仅可退出本计划，不可申购本计划份额。</p>

份额面值	人民币 1.00 元
最低参与金额	首次参与的最低认购金额为人民币 30 万元(最低认购金额不包含认购费), 追加参与的金额为人民币 1000 元的整数倍。
相关费率	<p>1、认购费：本集合计划无认购费。</p> <p>2、退出费：本集合计划无退出费。</p> <p>3、管理费：0.80%/年；</p> <p>4、托管费：0.03%/年；</p> <p>5、业绩报酬：详见“费用、报酬”部分。</p> <p>6、其他费用：其他费用及具体计算方法详见《管理合同》“二十、集合计划的费用与税收”。</p>
风险收益特征	本集合计划的风险等级为 R3 (中风险)
预警止损机制	<p>1、本计划将计划份额净值 0.9500 元设置为预警线；将计划份额净值 0.9200 元设置为止损线（预警线、止损线的计算以资产管理人与资产托管人核对一致的日终净值为准，下同）。</p> <p>2、当 T 日计划份额净值低于或等于预警线 0.9500 元时，管理人应于 T+5 日（含）内将私募资产管理产品的比例降至集合计划资产总值的 70%（含）以内。</p> <p>3、当 T 日计划份额净值低于或等于止损线 0.9200 元时，管理人应于 T+20 日（含）内对本计划持有的全部非现金资产进行变现操作，直至计划资产全部变现为止。计划资产全部变现后本计划提前终止。</p> <p>因持有流通受限证券超过本计划存续期等原因导致本计划资产无法及时变现的，管理人应当于本计划终止后对计划资产进行清算并先行分配已变现部分。本计划持有流通受限证券的，自该等证券可上市流通首日起 20 个交易日内(本计划剩余期限大于等于 20 个交易日的情形)或在本计划终止日前(本计划剩余期限小于 20 个交易日的情形)，管理人完成变现操作。因不可抗力或意外事件，导致相关操作无法完成的，操作期限相应顺延。本计划持有多个流通受限的证券及投资产品的，管理人按本款约定进行多次变现及清算。</p> <p>在止损卖出过程中，由于大量卖出导致市场价格大幅下跌或因证券</p>

		跌停、停牌等事件导致证券不能及时卖出等因素，可能给本计划带来损失，导致止损后计划资产净值可能低于止损前计划资产净值。
当事 人	管理人	<p>机构名称：东海证券股份有限公司</p> <p>法定代表人：王文卓</p> <p>注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层</p> <p>办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦</p> <p>邮政编码：200125</p> <p>联系电话：021-20333333</p>
	托管人	<p>机构名称：广发银行股份有限公司</p> <p>负责人或授权代表：王凯</p> <p>通信地址：北京市西城区金融大街 15 号鑫茂大厦北楼 4 层</p> <p>邮政编码：100053</p> <p>联系电话：010-65169644</p>
集合 计划 的 募 集	募集对象	本计划的产品风险等级为 R3（中风险），本产品适合于专业投资者及普通投资者中风险承受能力等级为 C3 及高于 C3 的投资者。本集合计划投资者的风险承受能力应当与集合计划的风险等级相匹配。本集合计划投资者人数累计不得超过二百人。
	募集方式	本集合计划通过管理人和管理人委托的代销机构进行募集。本集合计划募集机构及其从业人员以非公开方式向投资者募集资金。
	募集期限	初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 天，具体募集推广期以管理人的发行公告为准。在本集合计划满足成立条件的前提下，管理人有权提前结束推广期，并及时向投资者披露。
	认购参与的原则	<p>1、推广期内，本集合计划投资者以面值参与，即认购价格为 1.00 元；</p> <p>2、采用金额参与的方式，即以参与金额申请；</p> <p>3、当集合计划将接近目标规模时，管理人有权根据“时间优先，金额优先”的原则对投资者的参与申请进行确认，参与时间以管理人注册登记系统的确认结果为准；当计划达到目标规模后，管理人有权暂停接受或拒绝投资者的参与申请；</p>

	<p>4、在集合计划人数达到上限时，管理人将自当日起拒绝接受初次参与申请，但继续接受本集合计划份额持有人的追加参与申请，并对当日已提交的初次参与申请，管理人将采取“时间优先、金额优先”的原则处理，并及时向投资者披露；</p> <p>5、投资者可多次认购参与本集合计划，参与申请仅可以在当日业务办理时间内撤销；管理人可以对单个投资者参与上限进行规定；</p> <p>6、本集合计划采用书面或电子合同签署方式，投资者在签署书面或电子合同后方可参与本集合计划。投资者应当如实提供与合同签署相关的信息和资料，管理人和其他推广机构应当按照有关规定对投资者提供的信息和资料进行审查并如实记录。投资者保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。</p> <p>管理人可以根据集合计划运作的实际情况在不损害投资者利益的前提下更改上述原则。此集合计划参与原则更改将遵循合同变更的相关程序。</p>
集合计划的参与、退出	<p>(一) 参与和退出场所</p> <p>广发银行股份有限公司及管理人公告的符合《管理办法》要求的推广机构，具体以管理人公告为准。</p> <p>(二) 参与和退出的开放日</p> <p>1. 参与时间</p> <p>本集合计划每周第一个工作日开放申购赎回，如遇节假日则顺延至下一个交易日，具体开放期以管理人公告为准。</p> <p>2. 退出时间</p> <p>本集合计划每周第一个工作日开放申购赎回，如遇节假日则顺延至下一个交易日，具体开放期以管理人公告为准。</p> <p>(三) 临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排</p> <p>当发生合同约定的情况时，管理人可在网站公告设置临时开放期。</p> <p>若因本计划管理人决定展期或变更合同的，管理人将通过网站公告的形式征询投资者的意见。投资者不同意的，管理人将为不同意的投资者设置临时开放期，临时开放期内投资者仅可退出本计划，不可申购本</p>

计划份额。

#### (四) 参与的方式、价格、程序及确认

##### 1、参与的原则

(1) 存续期内，本集合计划投资者在开放期的申购参与价格为受理申请当日份额的单位净值；

(2) 采用金额参与的方式，即以参与金额申请；

(3) 投资者首次参与的最低净参与金额为人民币 300,000 元，超过最低参与金额的部分需为人民币 1,000 元的整数倍。

存续期开放日购买资产管理计划份额的，投资者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（人民币 300,000 元），已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的每次追加参与的最低金额为人民币 1,000 元的整数倍。

投资者一致同意：如相关法律法规对于投资者首次参与最低金额有最新规定的，管理人向监管机构履行相关报备程序，并在管理人网站和推广机构网点公告后即可按照最新规定执行；

(4) 当集合计划将接近目标规模时，管理人有权根据“时间优先，金额优先”的原则对投资者的参与申请进行确认，参与时间以管理人注册登记系统的确认结果为准；当计划达到目标规模后，管理人有权暂停接受或拒绝投资者的参与申请；

(5) 在集合计划人数达到上限 200 人时，管理人将自当日起拒绝接受初次参与申请，但继续接受本集合计划份额持有人的追加参与申请，并对当日已提交的初次参与申请，管理人将采取“时间优先、金额优先”的原则处理，并及时向投资者披露；

(6) 投资者可多次参与本集合计划，参与申请仅可以在当日业务办理时间内撤销；管理人可以对单个投资者参与上限进行规定；

(7) 本集合计划采用书面或电子合同签署方式，投资者在签署书面或电子合同后方可参与本集合计划。投资者应当如实提供与合同签署相关的信息和资料，管理人和其他推广机构应当按照有关规定对投资者提

供的信息和资料进行审查并如实记录。投资者保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。

管理人可以根据集合计划运作的实际情况在不损害投资者利益的前提下更改上述原则。此集合计划参与原则更改将遵循合同变更的相关程序。

## 2、参与的程序和确认

(1) 投资者按推广机构指定营业网点的具体安排或通过推广机构的指定系统，在规定的交易时间段内办理；

(2) 填写客户信息登记表并签署风险揭示书；

(3) 投资者应开设推广机构认可的资金账户，并在资金账户备足认购的货币资金；若参与资金未在规定期限内全额到账，则仅限到账部分资金的参与申请为有效申请；

(4) 投资者签署书面或电子合同后，必须根据本集合计划推广机构规定的手续，在指定参与时间内提出参与申请。投资者既可以到集合计划推广机构指定营业网点的柜台申请参与集合计划，也可以登录推广机构指定网络系统以自主下单的方式申请参与集合计划。参与申请经管理人确认有效后，构成《资产管理合同》的有效组成部分；

(5) 投资者可多次申请参与本集合计划，申请确认成功后，其申请和资金不得撤销；

(6) 注册登记机构应在 T+3 日（T 日为开放日）内对投资者参与、退出申请的有效性进行确认。投资者可在当个开放期结束后至各销售网点查询最终确认情况；

(7) 投资者应当以自己的名义参与本集合计划，任何人不得非法汇集他人资金参与本集合计划；

(8) 投资者同意，申请的情况以管理人确认的结果为准。

## 3、参与费及参与份额的计算

(1) 参与费率：本集合计划无参与费

(2) 参与份额的计算方法：

$$\text{申购份额} = \text{申购金额} \div \text{参与日集合计划单位净值}$$

	<p>申购份额的计算保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的误差归入集合计划财产。</p> <p>其中：</p> <p>A、份额计算时采用四舍五入、保留至小数点后两位，由此产生的误差计入本集合计划资产的损益；</p> <p>B、多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。</p> <p>4、参与资金利息的处理方式</p> <p>投资者的参与资金在参与期产生的利息（如有）将折算为计划份额归投资者所有，最终利息折算份额数与实际产生利息的差额部分计入集合计划资产。</p> <p>5、参与的金额限制</p> <p>投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应不低于 300,000 元（不含参与费用），超过最低参与金额的部分需为人民币 1,000 元的整数倍。已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。</p> <p>6、拒绝或暂停接受投资者参与的情况及处理方式</p> <p>出现如下情形时，管理人可以拒绝或暂停接受投资者的参与申请：</p> <ul style="list-style-type: none"><li>(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；</li><li>(2) 当本集合计划规模接近、达到或超过约定的规模；</li><li>(3) 参与投资者数量达到 200 人，该情形下，管理人拒绝或暂停投资者初次参与；</li><li>(4) 集合计划资产规模过大，使管理人无法找到合适的投资品种，或可能对集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有集合计划投资者的利益；</li><li>(5) 发生计划合同中未予载明的事项，但管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划参与申请的，可以暂停接受投资者的参与申请；</li><li>(6) 管理人认为会有损于现有集合计划投资者利益的某笔参与；</li><li>(7) 推广机构对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证</li></ul>
--	--

明的；

(8) 法律、法规、规章规定或在计划合同、集合计划说明书载明并获中国证监会批准的其它可暂停接受投资者参与的情形。

在暂停参与的情况消除时，管理人应及时恢复参与业务的办理并提前3个工作日向投资者披露。

## (五) 退出的方式、价格、程序及确认

### 1、退出的原则

(1) “未知价”原则，即投资者退出集合计划份额的退出价格以退出申请日(T日)集合计划单位净值为准进行计算；

(2) 采用“份额退出”的方式，即退出以份额申请；

(3) “先进先出”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，对该投资者在该推广机构参与的集合计划份额进行处理时，参与确认日期在先的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出；

(4) 投资者当日的退出申请可以且只能在当日交易时间结束之前撤销；

(5) 投资者在开放期可以多次办理退出申请；

(6) 预约申请一经提出，投资者不得撤销申请，管理人同意的除外；

(7) 单笔退出最低份额的约定：参与份额单笔退出最低份额为10,000份，若某笔退出导致该投资者持有的份额净值少于300,000元，则管理人有权对该余额部分做强制退出处理。管理人有权对以上标准进行重新规定并及时在管理人指定网站公告。

### 2、退出的程序和确认

#### (1) 退出申请的提出

投资者必须根据本集合计划推广机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内向推广机构提出退出申请。申请退出份额数量超过投资者持有份额数量时，申请无效。集合计划份额的退出需经管理人同意，管理人有权拒绝本集合计划份额退出。

#### (2) 退出申请的确认

	<p>投资者 T 日提出的退出申请，经管理人确认后，可在 T+3 之后向推广机构所属网点或网络查询退出的确认情况。</p> <p>(3) 退出款项划付</p> <p>投资者退出申请经确认有效后，管理人指示托管人于T+7日内将退出款项从集合计划托管专户划出，通过推广机构在两个工作日内划往投资者指定的资金账户。</p> <p>(4) 发生全部退出时的特殊处理：如本集合计划全体投资者申请退出所持有的计划份额，致使所有计划份额被退出，且无在途参与申请的，管理人应当拒绝接受该等退出申请，按照合同约定终止运作并进行清算。</p> <p>3、退出费及退出金额的计算</p> <p>(1) 退出费用</p> <p>本集合计划无退出费。</p> <p>(2) 退出金额的计算方法</p> <p>本集合计划退出时以受理退出申请日计划单位净值作为计价基准，按扣除退出费、业绩报酬后的实际金额支付。退出费和退出金额的计算公式如下：</p> <p style="padding-left: 2em;">退出总额=T日集合计划单位净值×退出份额</p> <p style="padding-left: 2em;">退出费=（退出总额—管理人业绩报酬）×退出费率</p> <p style="padding-left: 2em;">退出净额=退出总额—管理人业绩报酬—退出费</p> <p>本集合计划无退出费。</p> <p>管理人业绩报酬具体计算方法详见计划合同“资产管理计划的费用与税收”章节。</p> <p>退出金额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后的部分采用四舍五入法处理，由此产生的差额部分计入计划资产损益。</p> <p>(3) 退出款项的支付</p> <p>投资者退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户在T+7日内划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各推广机构，并通过推广机构在两个工作日内划往申请退出投资者的指定账户。如集合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</p>
--	--

拨日期相应顺延。

投资者参与、退出本集合计划使用的账户必须为以投资者名义开立的同一账户。特殊情况导致参与、退出时使用的账户不一致时，投资者应出具符合相关法律法规规定的书面说明，否则管理人与托管人均有权拒绝投资者参与或退出的申请。

#### 4、退出限制与次数

(1) 投资者可以选择全部退出，也可以选择部分退出。部分退出资产管理计划的，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者参与份额单笔退出最低份额为10,000份，若某笔退出导致该投资者的份额净值少于300,000元，则管理人有权对该余额部分做强制退出处理。管理人有权对以上标准进行重新规定并及时在管理人指定网站公告。

(2) 投资者在某一开放日内的退出次数不受限制。

#### 5、单个投资者大额退出的认定、申请和处理方式

本集合计划不设大额退出条款。但当单个投资者退出触及巨额退出条款时，按巨额退出条款办理。

#### 6、巨额退出的认定和处理方式

##### (1) 巨额退出的认定

单个开放日，投资者当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的10%时，即为巨额退出。

##### (2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出：

**全额退出：**当管理人认为有条件支付投资者的退出申请时，按正常退出程序办理。

**部分顺延退出：**当管理人认为支付投资者的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额10%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退

出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，投资者可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以该工作日的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

### （3）告知客户的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

## 7、连续巨额退出的认定和处理方式

### （1）连续巨额退出的认定

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

### （2）连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按说明书及资产管理合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在管理人指定网站上进行公告。

## 8、拒绝或暂停退出的情形及处理

（1）发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的退出申请：

①不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

②证券交易场所交易时间非正常停市、登记结算机构或银行结算系统无法正常运作等，导致当日集合计划资产净值无法计算；

③管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有投资者利益时；

④因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金支付出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；

	<p>⑤法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在说明书、资产管理合同中已载明的特殊情形。</p> <p>发生上述情形之一的，已接受的退出申请，集合计划管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分由集合计划管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付，但最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并报告给投资者。</p> <p>(2) 发生《集合资产管理合同》、集合计划说明书中未予载明的事项，但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划参与、退出申请的，在履行相应程序后管理人可以暂停接受投资者的参与、退出申请。</p> <p>(3) 如果发生暂停开放日参与或退出的情况，管理人应在导致暂停参与或退出事项消失后的二十个工作日内设定新的开放日，并提前 2 个工作日公告投资者集合计划重新开放参与或退出，且以后的开放日不应受当次延迟开放日的影响。</p>
管理人的自有资金是否参与	<p>管理人及其子公司（孙公司）可以以自有资金参与本集合计划的：</p> <p>1、自有资金参与的金额和比例</p> <p>在集合计划存续期内，管理人及其子公司（孙公司）以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过集合计划总份额的 40%且符合相关法律法规的规定。参与金额和比例以管理人公告为准。</p> <p>2、自有资金的责任承担方式与收益分配</p> <p>管理人及其子公司（孙公司）自有资金所持的集合计划份额与其他投资者持有的集合计划份额享有同等权益、承担同等风险。管理人及其子公司（孙公司）自有资金不对其他投资者的本金和收益进行赔付。</p> <p>3、自有资金的参与、退出</p> <p>管理人及其子公司（孙公司）以自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月，除管理人及其子公司（孙公司）以自有资金在募集期参与的情况外，参与、退出时应当提前 5 个工作日以网站公告的形式告知全体投资者，提前 5 个工作日以邮件或其他方式告知托管人，并取得</p>

	<p>其同意。投资者应在公告指定的日期内按指定的形式回复意见，逾期未做答复的，视为投资者同意自有资金参与、退出事项。投资者向管理人答复不同意自有资金参与、退出事项的，可向管理人申请退出本集合计划。</p> <p>集合计划存续期间，管理人及其子公司（孙公司）有权部分或全部退出自有资金持有份额，管理人应按照本条前述款项的要求进行公告。</p> <p>因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规规定比例的，管理人及其子公司（孙公司）按照中国证监会规定及时安排自有资金的退出，可不受上述限制，但需事后及时告知投资者和托管人。</p> <p>4、为应对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计划合同约定的前提下，管理人及其子公司（孙公司）参与的自有资金参与、退出可不受本条第1款、第3款的限制，但需事后及时告知投资者和托管人，并向相关中国证监会派出机构报告。</p> <p>5、风险揭示：管理人及其子公司（孙公司）自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注计划规模变动情况，控制流动性风险。</p>
集合计划成立的条件 和日期	<p>集合资产管理计划推广活动结束后，管理人聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合资产管理计划进行验资，出具验资报告。如果集合计划同时满足以下条件，管理人公告本集合计划成立并开始运作：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>1、推广过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；</li> <li>2、募集金额不低于1000万元人民币；</li> <li>3、投资者不少于2人且不超过200人；</li> <li>4、符合集合资产管理合同及集合计划说明书的约定。</li> </ul> <p>集合计划管理人依据《管理办法》、《运作规定》及集合计划说明书可以决定停止集合计划的参与，并报告集合计划成立。如果集合计划不能同时满足上述条件，或在推广期内发生使集合计划无法设立的不可抗力事件，则不得成立。</p>

	<p>集合资产管理计划推广期间，管理人和推广机构必须将推广期间客户的资金存入注册登记机构指定的专门账户。</p>
集合计划设立失败(本金及利息返还方式)	<p>集合计划推广期结束，在集合计划规模低于人民币 1000 万元或投资者的人数少于 2 人条件下，或推广期内发生使本集合计划无法设立的不可抗力，集合计划设立失败。</p> <p>募集期届满，资产管理计划未达到成立条件的，管理人以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并将已募集资金加计在集合计划推广期内按照中国人民银行公布的银行同期活期存款基准利率计算的利息在推广期结束后 30 个工作日内退还投资者。</p>
集合计划份额转让	<p>本集合计划暂时不支持份额的转让。但在条件允许的情况下，本集合计划份额方可转让。集合计划份额转让业务的开通和处理方式、份额转让的实际收费标准以管理人公告为准。在符合管理人公告的条件下，并经管理人同意后，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。受让方首次参与集合计划，应满足合格投资者的条件，并与管理人、托管人签订集合资产管理合同。</p>
费用、报酬	<p>1、管理费</p> <p>本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提。管理费的年费率为 0.80%。计算方法如下：</p> $H=E \times \text{年管理费率} \div 365$ <p>H 为每日应计提的集合计划管理费 E 为前一日集合计划资产净值</p> <p>本计划投资于本计划管理人所管理的资产管理计划部分不收取固定管理费。</p> <p>集合计划管理费每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于每季度结束后的次月首日起 3 个工作日内依据管理人划款指令从集合计划资产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延至下一个工作日。</p>

	<p><b>2、托管费</b></p> <p>本集合计划的托管费按前一日集合计划的资产净值计提。托管费的年费率为 0.03%。计算方法如下：</p> $H = E \times \text{年托管费率} \div 365$ <p>H 为每日应计提的集合计划托管费</p> <p>E 为前一日集合计划资产净值</p> <p>集合计划托管费每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于每季度结束后的次月首日起 3 个工作日内依据管理人划款指令从集合计划资产中一次性支付给托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延至下一个工作日。</p> <p><b>3、管理人的业绩报酬</b></p> <p><b>(1) 管理人收取业绩报酬的原则：</b></p> <p>①同一投资者不同时间多次参与的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬；</p> <p>②符合业绩报酬计提条件时，在资产管理计划分红、投资者退出和资产管理计划终止时计提业绩报酬；</p> <p>③资产管理计划分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；</p> <p>④在投资者退出或计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；</p> <p>⑤投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或资产管理计划终止时持有份额计算；</p> <p>⑥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。</p> <p>⑦业绩报酬的提取频率不超过每 6 个月一次。因投资者退出本资产管理计划，管理人按照计划合同的约定在投资者退出时提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。</p> <p><b>(2) 业绩报酬的计提方法：</b></p>
--	---

	<p>以上一业绩报酬计提日（如上一业绩报酬计提日不存在，则初始募集期参与的为资产管理计划成立日，存续期参与的为参与日，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。其中业绩报酬计提日即为资产管理计划分红权益登记日、资产管理计划投资者退出日和资产管理计划终止日。年化收益率计算方法为：</p> $R = \frac{S_T^* - S_0^*}{S_0} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ <p>R：指上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的年化收益率；  <math>S_T^*</math>：指本次业绩报酬计提日的累计单位净值；  <math>S_0^*</math>：指上一业绩报酬计提日的累计单位净值；  <math>S_0</math>：指上一业绩报酬计提日的单位净值（如上一业绩报酬计提日不存在，则为投资者参与资产管理计划的参与价格）；  T：指上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然天数。</p> <p>管理人按如下标准和方法提取业绩报酬：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>①当 <math>R \leqslant 5.00\%</math> 时，管理人不收取业绩报酬；</li> <li>②当 <math>R &gt; 5.00\%</math> 时，业绩报酬 = <math>M \times S_0 \times (R - 5.00\%) \times 20\% \times T / 365</math></li> </ul> <p>其中业绩比较基准和业绩报酬计提比例可根据市场利率情况进行调整，届时以管理人公告为准。若调低业绩报酬计提基准，管理人将设置临时开放期，有异议的投资者可在临时开放期退出本计划。</p> <p><b>(3) 业绩报酬的支付</b></p> <p>业绩报酬由管理人依据计划合同计算并复核，托管人不承担复核义务。业绩报酬在业绩报酬计提日提取，管理人在提取业绩报酬当日以邮件等方式告知投资人，并向托管人发送业绩报酬提取金额。托管人据此入账，并于 5 个工作日内依据管理人出具的业绩报酬划款指令从资产管理计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</p>
集合计划的税 收	本集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。投资者投资本集合计划应缴纳的税收由投资者自行负责，管理人不承担代扣代缴义务。

	<p>以下条款具有优先适用效力：</p> <p>为免歧义，计划合同各方特别约定，如依据相关法律法规或财政税务主管部门的规定，就本集合计划投资运营过程中发生的增值税应税行为及其他应税行为，管理人需要承担相应纳税或代扣代缴义务的，该税费由本集合计划财产承担，管理人有权以集合计划财产予以缴纳，且无需事先征得投资者的同意（除本约定以外，本集合计划已列明的资产管理业务费用产生的税费由各收款方自行缴纳的，相关方应自行缴纳）；管理人在向投资者交付利益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，投资者应按照管理人通知要求缴纳相应税费（具体以管理人通知为准），管理人亦有权以集合计划剩余财产直接缴纳；投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。如剩余财产不足以缴付而导致管理人因此垫付相应税费等款项的，管理人有权向投资者追索垫付的税费或孳息款项，投资者应按照管理人通知向管理人指定账户返还垫付款。投资者已知悉并同意本集合计划资产承担上述税费可能导致资产变现损失或投资收益减损。</p>
收益分配	<p>（一）收益的构成</p> <p>收益包括：集合计划投资所得债券利息、红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。</p> <p>（二）可供分配利润</p> <p>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。</p> <p>（三）收益分配原则</p> <p>1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，每个自然年度管理人可对计划份额进行收益分配不超过 2 次；具体时间以及分配方案由管理人根据本集合计划收益情况拟定，并在管理人指定网站上披露；</p> <p>2、每一集合计划份额享有同等分配权；</p> <p>3、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；</p>

	<p>4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费由投资者自行承担，与收益分配、退出集合计划的相关税负由投资者自行承担；</p> <p>5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p> <p><b>(四) 收益分配方案的确定与披露</b></p> <p>收益分配方案须载明收益范围、分配对象、分配原则、分配时间、分配方式等内容。</p> <p>本集合计划收益分配方案由集合计划管理人拟定，由托管人复核，由管理人通知投资者。</p> <p><b>(五) 收益分配方式</b></p> <p>本集合计划的分红方式分为两种：现金分红与红利再投资。若投资者不选择收益分配方式，本计划默认为现金分红方式。投资者选择现金分红方式的，管理人将现金红利款划往销售机构账户，再由销售机构划入投资者账户，现金红利款自款项从集合计划资金账户划出之日起7个工作日内到达投资者账户。投资者选择采取红利再投资收益分配方式的，分红资金将按分红权益登记日的集合计划单位净值转成相应的集合计划份额，且红利再投资增加的集合计划份额计入集合计划份额规模。</p> <p>投资者获得的现金分红或红利再投资份额保留小数点后两位，第三位四舍五入。</p> <p>除分红权益登记日外，投资者可在计划存续期内选择变更收益分配的方式。投资者在不同募集机构参与的计划份额可以申请采取不同的收益分配方式，但投资者在某一募集机构参与的计划份额只能选择一种分红方式，且在某一募集机构申请变更收益分配方式的计划份额只能是在该募集机构参与的计划份额。</p>
集 合 计 划 展 期	<p>本集合计划展期应符合以下条件：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(1) 在存续期间，集合计划运营规范，管理人、托管人未违反集合计划合同、说明书的约定；</li> <li>(2) 集合计划展期没有损害投资者利益的情形；</li> <li>(3) 托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；</li> <li>(4) 符合本集合计划的成立条件；</li> </ul>

	(5) 中国证监会规定的其他条件。
展期的程序与期限	<p>(1) 展期的程序：本集合计划原存续期届满前，管理人可以决定到期清算终止或展期继续管理本集合计划。</p> <p>本集合计划拟展期的，管理人应当在计划存续期届满前 1 个月征询托管人是否同意继续托管展期后的集合计划资产。在获得托管人同意后，管理人可开展本集合计划展期准备事宜，通过公告等形式通知投资者展期安排，并按照资产管理合同的约定进行展期。</p> <p>(2) 展期的期限：管理人可以决定展期的期限，并以公告形式通知投资者，具体期限以管理人公告为准。</p>
展期的安排和实现	<p>1、展期的安排</p> <p>(1) 通知展期的时间</p> <p>管理人在获得托管人同意继续托管展期后的集合计划资产的意见后的五个工作日内在管理人网站进行公告，对集合计划展期事宜进行说明。</p> <p>(2) 通知展期的方式</p> <p>管理人决定展期的，将在管理人网站进行公告，管理人须在公告后十个工作日内以书面或电子等方式向投资者发送展期征询意见。</p> <p>(3) 投资者回复的方式</p> <p>投资者如同意参与集合计划展期，应在公告规定期限内按照管理人公告规定的形式作出答复；未在规定时间内作出答复的，视为同意本集合计划展期。</p> <p>2、投资者不同意展期的处理办法</p> <p>回复不同意展期的投资者，可以在原存续期届满前的开放日通过推广机构办理退出手续，如投资者未在原存续期届满前的开放日办理退出手续，则管理人在原存续期届满时为该部分投资者办理强制退出手续。</p> <p>3、展期的实现</p> <p>(1) 如果展期后的集合资产管理合同、计划说明书与原集合资产管理合同、计划说明书有变更之处，管理人将在其指定网站上对新的集合资产管理合同、计划说明书进行公告。</p> <p>(2) 同意本集合计划展期的投资者的人数不少于 2 人并符合资产管</p>

	<p>理计划成立条件，且原存续期届满日符合展期条件的，本集合计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本集合计划不能展期。</p> <p>(3) 本集合计划可以连续展期，且展期次数不限。</p>
投资者的权利与义务	<p>1、投资者的权利</p> <p>(1) 分享资产管理计划财产收益；</p> <p>(2) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；</p> <p>(3) 按照计划合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；</p> <p>(4) 根据计划合同的规定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会（如有），行使相关职权；</p> <p>(5) 按照法律法规及计划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；</p> <p>(6) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；</p> <p>(7) 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。</p> <p>2、投资者的义务</p> <p>(1) 投资者应认真阅读并遵守计划合同及《说明书》，充分理解计划合同全文，已详细了解相关权利及义务、所投资品种的风险收益特征及产品的相关信息、业务规则、业务风险；听取了管理人或代理推广机构的适当性匹配意见，并对自身的风险承受能力、投资期限、投资品种、预期收益等要素进行评估，系独立、自主、审慎作出投资决策，自愿独立承担投资风险。投资者知悉并确认，管理人或代理推广机构的信息告知、规则讲解、风险揭示、适当性匹配意见不会降低产品的固有风险，不表明管理人或代理推广机构对产品的风险和收益作出实质性判断或保证；</p> <p>(2) 投资者保证投资资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划，不使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金参与本集合计划，投资者用筹集的资金参加集合资产管理业务时，必须为法人或依法成立的其他组织，且应向管理人提供合法筹集资金证明文件；投资者承诺遵守《中国人民共和国反洗钱法》等反洗钱相关法律、法规，</p>

	<p>承诺参与集合资产管理业务的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；</p> <p>(3) 投资者承诺具有相应合法的投资主体资格，不存在任何法律、行政法规、中国证券监督管理委员会等规范性文件及交易规则禁止或限制的情形并符合本计划关于合格投资者的规定；</p> <p>(4) 投资者承诺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担能力问卷，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，投资者承诺提供的所有证件、资料均真实、准确、全面、有效、完整、合法。投资者在其信息发生重要变化时，应主动告知管理人及代理推广机构，以便管理人及代理推广机构作出调整；</p> <p>(5) 认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(6) 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；</p> <p>(7) 按照计划合同及《说明书》约定，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；</p> <p>(8) 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；</p> <p>(9) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；</p> <p>(10) 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；</p> <p>(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；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；</p> <p>(12) 不得违规转让其所拥有的计划份额；</p> <p>(13) 投资者应当采取有效措施妥善保管与电子签名合同有关的信息和资料，防止他人以投资者的名义实施电子签名行为；</p> <p>(14) 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</p>
--	--

	理合同约定的其他义务。
信息披露的内容、频率和方式	<p>(一) 定期报告</p> <p>定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度(年度)报告、托管季度(年度)报告、年度审计报告。</p> <p>1、集合计划单位净值报告</p> <p>披露时间：本集合计划存续期内，管理人至少每周披露一次经托管人复核的集合计划份额净值，如遇节假日顺延。</p> <p>披露方式：本集合计划的信息披露将严格按照《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、计划合同及其他有关规定进行。本集合计划的计划单位净值、计划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。</p> <p>集合计划信息披露事项在以下指定网站上公告：</p> <p>管理人网址：<a href="http://www.longone.com.cn/">http://www.longone.com.cn/</a></p> <p>2、集合计划季度报告和年度报告</p> <p>管理人应当向投资者提供资产管理计划季度报告和年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况，年度报告包括但不限于下列信息：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>(1) 管理人履责报告；</li> <li>(2) 托管人履责报告；</li> <li>(3) 资产管理计划投资表现；</li> <li>(4) 资产管理计划投资组合报告；</li> <li>(5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；</li> <li>(6) 资产管理计划财务会计报告；</li> <li>(7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；</li> <li>(8) 资产管理计划投资收益分配情况；</li> <li>(9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；</li> <li>(10) 中国证监会规定的其他事项。</li> </ul> <p>资产管理计划季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。</p>

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和年度报告。

季度报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站通告。

年度报告应于每个会计年度截止日后 4 个月内通过管理人网站通告。

### 3、年度审计报告

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向投资者提供。

### 4、托管季度报告和年度报告

托管人在每季度向管理人提供一次准确、完整的托管季度报告。上述报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站通告。集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，托管人可以不编制当期的季度报告。

托管人在每年度向管理人提供一次准确、完整的托管年度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后 4 个月内通过管理人网站通告。集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的一个季度时，当期托管年度报告可以不编制。

## （二）临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当按照法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定、计划合同、集合计划说明书在事项发生之日起五日内在管理人网站上向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于：

（1）集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资主办人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

（2）暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

	<p>(3) 发生巨额退出并延期支付;</p> <p>(4) 集合计划终止和清算;</p> <p>(5) 集合计划存续期满;</p> <p>(6) 管理人及其子公司（孙公司）以自有资金参与和退出;</p> <p>(7) 合同的补充、修改与变更;</p> <p>(8) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项;</p> <p>(9) 负责本集合计划的代理推广机构发生变更;</p> <p>(10) 集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券;</p> <p>(11) 集合计划收益分配方案;</p> <p>(12) 资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内（不含第四位）发生差错时，视为本集合计划单位净值错误），集合计划资产净值计算错误偏差达到集合计划资产净值 0.5%;</p> <p>(13) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更;</p> <p>(14) 临时开放期;</p> <p>(15) 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;</p> <p>(16) 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> <p>(17) 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。</p> <p>(18) 其他法律法规、中国证监会有关规定的情况。</p> <p><b>（三）信息披露备查文件的查阅地点</b></p> <p>《集合资产管理合同》、《说明书》及其他备查文件存放在集合计划管理人、集合计划销售网点的营业场所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。</p> <p>投资者也可以直接登录集合计划管理人的网站进行查阅。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，集合计划管理人保证其内容与所披露的内容完全一致。</p>
--	--

	<p><b>投资风险揭示</b></p> <p>投资有风险。当您/贵机构参与东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在作出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和《东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》，充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑本计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。</p> <p>本资产管理计划为固定收益类资产管理计划，也是基金中基金资产管理计划（FOF）。管理人在管理本资产管理计划过程中可能面临多种风险，包括但不限于市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险及其他风险。投资者在投资本资产管理计划之前，请仔细阅读本资产管理计划的资产管理合同、说明书和风险揭示书，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，理性判断市场，谨慎做出投资决策。</p>
<b>利益冲突及关联交易</b>	<p><b>一、利益冲突情形</b></p> <p>本集合资产管理计划存在的或可能存在利益冲突情形，包括但不限于：</p> <p>1、管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、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，投资前述机构管理的资产管理产品（含公开募集证券投资基 金），与前述机构作为对手方进行银行间市场的交易，向前述机构支付报酬，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项；</p> <p>2、管理人董事、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管理人设立的资产管理计划；</p> <p>3、管理人及其子公司（孙公司）自有资金参与和退出本计划；</p> <p>4、法律、行政法规规定或者中国证监会认定的其他情形。</p> <p><b>二、利益冲突的处理</b></p> <p>1、全体投资者不可撤销地同意并授权管理人可以将计划合同项下的集合计划的资产从事除重大关联交易以外的其他关联交易，投资者签署计划合同视为对本集合计划运作期间所有可能发生的除重大关联交易以外的其他关联交易投资的同意答复，管理人以计划合同为依据进行上述</p>

关联交易。交易完成后，管理人应定期通过管理人指定网站公告等方式告知投资者和托管人，并按法律法规、监管规定履行报告义务。

对于开展重大关联交易，管理人应当事前采取逐笔征求投资者意见或公告确认等方式取得投资者同意，保障不同意的投资者的退出权利。

本集合资产管理计划的关联交易的范围、关联方范围及披露方式、一般关联交易与重大关联交易的区分标准、管理人对关联方交易的内部管控机制以及关联交易的处理方式等内容如下：

#### (1) 关联交易的范围

管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、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，投资前述机构管理的资产管理产品（含公开募集证券投资基金），与前述机构作为对手方进行银行间市场的交易，向前述机构支付报酬，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项。

#### (2) 关联方范围及披露方式

本集合资产管理计划的关联方包括管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人及与其存在重大利害关系的机构，与本计划存在重大利益关系的其他关联方等。

托管人的关联方认定将以托管人提供的关联方名单为依据，若托管人未及时提供或更新其关联方名单，管理人将根据托管人公布的年度报告或其他定期报告的披露信息进行控制。管理人的关联方名单以管理人提供的关联人名单或年度报告或其他定期报告中披露的关联方名单为准，将于管理人网站披露（<https://www.longone.com.cn/>），托管人的关联方名单以托管人总行公布的年度报告或其他定期报告中披露的关联方名单为准。

#### (3) 一般关联交易、重大关联交易的区分标准

资产管理计划从事关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定，按照重要性原则进行分层管理。

重大关联交易包括本计划资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行

的证券或承销期内承销的证券；单笔交易金额超过资产管理产品资产净值 10%的关联交易或其他重大关联交易等情形，除重大关联交易以外的关联交易属于一般关联交易。

投资者、托管人在此同意，如监管部门、行业协会对一般关联交易和重大关联交易的区分标准另有规定的，管理人将根据前述规定重新划分，并以公告形式告知投资者，书面告知托管人。如因管理人内部制度调整原因，对一般关联交易和重大关联交易的区分标准进行调整的，如属于调低关联交易认定标准或增加关联交易认定情形，则管理人以公告形式告知投资者，并书面通知托管人，无需按照计划合同“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”的规定进行合同变更；如涉及调高关联交易认定标准或减少关联交易认定情形，管理人应当按照计划合同“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”的规定进行合同变更事宜。

#### （4）管理人对关联方交易的内部管控机制

管理人制定并实施了《东海证券股份有限公司资产管理业务关联交易管理办法》，规定关联交易的审议程序、定价、信息披露等。管理人按资产管理合同约定及管理人制度履行对关联方交易的审批、披露、报告等程序。

##### 1) 禁止以下关联交易

- A、利用资产管理产品资产向管理人、托管人出资；
- B、利用资产管理产品资产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、资产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提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得投资者同意的资产管理计划除外；
- C、利用资产管理产品资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向管理人注资等；
- D、利用资产管理产品资产从事法律法规、监管机构及产品合同禁止

的其他关联交易。

### 2) 在投资决策方面

资产管理产品的关联交易根据交易金额大小和交易性质不同分别履行下列审议程序：

A、董事会授权经营管理层审议批准以下关联交易：

资产管理产品与管理人关联方进行的、《东海证券股份有限公司关联交易管理制度》规定由经营管理层审议批准的关联交易，以及资产管理产品与其他关联方之间进行的关联交易；

根据已经监管机构批准或向自律组织备案的产品法律文件约定的费率、计提方法和支付方式等，资产管理产品向其他关联方支付管理费、托管费、业绩报酬等费用。

B、管理人董事会审议批准以下关联交易：

资产管理产品与管理人关联方进行的、《东海证券股份有限公司关联交易管理制度》规定由董事会审议批准的关联交易。

C、管理人股东大会审议批准以下关联交易：

资产管理产品与管理人关联方进行的、《东海证券股份有限公司关联交易管理制度》规定由股东大会审议批准的关联交易。

### 3) 在交易定价机制方面

资产管理产品关联交易应当遵循产品份额持有人利益优先原则，采取切实有效措施，防范利益冲突，按照市场公平合理价格执行，保护产品份额持有人合法权益。

管理人有权调整上述内容并在调整后公告披露调整情况。若后续中国证监会、中国证券投资基金业协会等相关监管部门或自律组织对私募资产管理产品关联交易另有规定的，管理人届时将另行公告，并按届时有效的规定执行。投资者应当及时查阅上述公告信息。

2、若管理人的董事、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管理人设立的资产管理计划，管理人应向投资者充分披露，对该计划账户进行监控，并向中国证监会相关派出机构报告。

	<p>三、管理人根据法律法规、监管规定、计划合同约定履行关联交易的信息披露义务。</p>
终止和清算	<p>(一) 资产管理计划终止的情形，包括但不限于下列事项：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、资产管理计划存续期届满且不展期；</li> <li>2、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；</li> <li>3、持有人大会（如有）决议提前终止资产管理合同；</li> <li>4、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；</li> <li>5、托管人被依法撤销集合计划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承接；</li> <li>6、持续五个工作日投资者少于 2 人的；特别的，本集合计划存续期内因投资者申请退出导致集合计划当日户数低于 2 户时，当日投资者的退出申请管理人有权做失败处理，本集合计划进入清算程序；</li> <li>7、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；</li> <li>8、当出现不能预见，不能避免，不能克服的客观情况，包括但不限于自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化、或其他突发事件、注册登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等不可抗力，将会严重影响证券市场的运行，可能导致集合计划不能存续；</li> <li>9、有下列情形的，管理人有权终止本集合计划： <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 若本集合计划所投资的金融产品发生提前终止，则管理人有权提前终止本集合计划；</li> <li>(2) 本集合计划参与投资的金融资产全部出清，即占集合计划净值比例为 0% 时，管理人有权提前终止本集合计划；</li> <li>(3) 其他管理人认为有必要提前终止集合计划的情况。</li> </ol> </li> <li>10、集合计划份额净值触及止损线的情形；</li> <li>11、本集合计划全体投资者申请退出所持有的集合计划份额，致使所有集合计划份额被退出，且无在途参与申请的；</li> <li>12、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</li> </ol>

情形。

管理人应当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，前述第（7）项约定的情形除外。

## （二）财产清算

资产管理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资产。

### 1、资产管理计划财产清算小组

（1）自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组，资产管理计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）资产管理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。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。

### 2、资产管理计划财产清算的程序

集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算，清算过程中的有关重大事项应当及时公布。

### 3、清算费用

本集合资产管理计划的清算费用，由管理人本着保护投资者利益的原则，按照公允的市场价格确定，经托管人确认后支付，清算费用列入资管计划的费用。

### 4、资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

清算结束后 15 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费（含业绩报酬）及托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。

### 5、延期清算

若本集合计划在终止之日有未能变现的证券或资产，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，对前述未能变现的证券或资产

	<p>在可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计划合同的约定，以货币形式全部分配给投资者。</p> <p>资产管理计划发生延期清算的，管理人应当及时按照监管要求向中国证监会相关派出机构和证券投资基金管理协会报告。</p> <p><b>6、资产管理计划财产清算报告的告知安排</b></p> <p>清算结束后 5 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果，将清算结果报证券投资基金管理协会备案。</p> <p><b>7、资产管理计划财产清算完毕后，托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。</b></p> <p><b>8、资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。</b></p>
<b>特别说明</b>	本说明书作为《管理合同》的重要组成部分，与《管理合同》具有同等法律效力。