

东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计划说明书（第二版）

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）》、《东海证券添宁双月盈 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、中国银行保险监督管理委员会和中国银行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 | 东海证券添宁双月盈 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） |
| | 目标规模 | 本集合计划初始募集期及存续期均不设规模上限。 |
| | 管理期限 | 本集合计划存续期限为自成立之日起 10 年（可展期）。 |
| | 投资范围 | 本集合计划主要投资于国内依法发行的国债、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、短期融资券、中期票据、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、债券正回购、债券逆回购、现金、银行存款、同业存单、股票（本计划不直接买入股票，投资的资产管理产品可投资于股票）、公募混合型基金、公募债券型基 |

| | |
|------|---|
| | <p>金、货币市场基金、经证监会认可的比照公募基金管理的资管产品、证券公司及其子公司的资产管理计划、基金公司的资产管理计划、银行理财计划、在中国证券投资基金管理协会备案的私募证券投资基金等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及中国证监会允许计划投资的其他金融工具。</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、现金类资产投资策略</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、债券逆回购的预期收益率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> <p>上述投资策略为管理人主要运用的投资策略，本集合计划投资策略包括但不限于上述策略。投资经理可在本集合计划投资范围内，根据市场变动及自主判断采用其他投资策略。</p> |

| | | |
|--|-------------|--|
| | <p>投资限制</p> | <p>投资比例:</p> <p>本计划为固定收益类FOF集合资产管理计划,投资于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(包括公募基金)的比例不低于集合计划总资产的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总资产的80%。投资于股权类资产,按照穿透合并计算的市值合计不高于本集合计划总资产的20%。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>投资限制:</p> <ol style="list-style-type: none"> 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。 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; 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%;银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债等中国证监会认可的投资品种除外。 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%(银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债等中国证监会认可的投资品种除外),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。 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。 6、本计划投资的资产管理产品,不得投资非标准化资产。 7、法律、行政法规、金融监管部门对上述投资限制另有规定的,从其规定。 |
|--|-------------|--|

| | |
|--------|--|
| | <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。本计划投资于其他私募资产管理产品的，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>本集合计划为开放式运作。</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：本集合计划每周一、周二（如遇非工作日不开放、不顺延）为开放期，开放期内可以办理参与、退出业务，管理人无需另行公告。</p> <p>3、锁定持有期：投资者每笔份额的锁定持有期为自份额参与确认日起 60 个自然日（认购份额从计划成立日起算，申购份额从申购确认日起算，红利再投资份额锁定期的开始日与产生该笔收益的原份额确认日保持一致，即计划成立日/申购确认日），投资者只能在锁定持有期满后的开放期申请退出，但《管理合同》另有约定的除外。</p> <p>4、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 | 首次认购的最低金额为人民币 30 万元，追加认购的最低金额为人民币 1000 元的整数倍。 |
| 相关费率 | <p>1、参与费：0%；</p> <p>2、退出费：0%；</p> <p>3、管理费：0.80%/年；</p> <p>4、托管费：0.02%/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》“二十一、</p> |

| | |
|--------|--|
| | 集合计划的费用与税收”。 |
| 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+10 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。</p> |
| 当事人 | <p>管理人</p> <p>机构名称：东海证券股份有限公司 法定代表人：王文卓 注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层 办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 邮政编码：200125 联系人：王玉路阳 联系电话：021-20333333</p> |

| | | |
|---------------------------------|------|---|
| | 托管人 | <p>名称：兴业银行股份有限公司 住所：福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 办公地址：上海市银城路 167 号 法定代表人：吕家进 邮编：200120 联系人：林诗琪 联系电话：021-52629999</p> |
| 集 合 计 划 的 募 集 | 募集对象 | <p>本计划向合格投资者非公开募集，计划份额持有人累计不得超过 200 人。</p> <p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本计划的金额不低于 30 万元且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：</p> <p>（一）具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近三年本人年均收入不低于 40 万元。</p> <p>（二）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；</p> <p>（三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在证券投资基金管理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；</p> <p>（四）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）；</p> <p>（五）中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> <p>根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，将本集合计划的风险评级评价为中风险（R3），且根据前述风险评级，本集合计划适合向合格投资者中的专业投资者和风险承受能力评估结果为 C3、C4、C5</p> |

| | |
|------|--|
| | 的普通投资者销售。但法律法规及销售机构另有规定的除外。 |
| 募集方式 | <p>本计划销售机构为东海证券股份有限公司及其指定的销售机构。投资者认购本计划，必须与管理人和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认购款项。投资者认购的具体金额和本计划份额以注册登记机构的确认结果为准。</p> <p>销售机构应将本计划资产管理合同、计划说明书等正式推广文件，置备于销售机构。本计划应当面向合格投资者推广，客户风险承受能力应与本计划相匹配，销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，引导客户审慎做出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大收益和商业贿赂等不正当手段推广本计划。</p> <p>管理人及销售机构应当采取有效措施，通过管理人、证券投资基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露本计划批准或者备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使投资者详尽了解本计划的特性、风险等情况及投资者的权利、义务，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得公开或变相公开募集资产管理计划，不得通过报刊、电台、电视、互联网及其他公共传播媒体或者讲座、报告会、传单、布告、自媒体（微信、博客）和电子邮件等方式向不特定对象推广本计划。</p> <p>管理人可以根据实际情况，选择使用管理人网站、电子邮件、手机信息等方式向投资者告知本集合计划相关信息。</p> |
| 募集期限 | <p>本计划初始募集期自计划份额发售之日起不超过 60 天，具体时间由管理人根据相关法律法规以及《管理合同》确定，并在管理人公告中披露。</p> <p>初始募集期指集合计划接受投资者认购日至募集期结束日。在募集期结束前，管理人有权根据本集合计划的销售情况延长或缩短募集期。若管理人决定提前结束初始募集期，应提前一个工作日通知销售机构和注册登记机构。</p> <p>如本集合计划在初始募集期内客户数达到 200 户，管理人可提前终</p> |

| | |
|-----------------------|--|
| | 止初始募集期，并对当日已提交的初次参与申请，管理人使用“时间优先，金额优先”方法对集合计划认购总户数实行限量控制。 |
| 认购费 | 投资者在初始募集期认购本集合计划，按照单笔认购金额的不同而收取相应的认购费用，本计划认购费率为0。 |
| 参与份额的计算方法 | <p>认购份额的计算方法如下：</p> <p>认购份数=（认购金额+认购期间的利息）/本计划份额初始募集面值</p> <p>认购份额的计算采用四舍五入法保留到小数点后2位，差额部分计入资产管理计划资产。</p> |
| 初始销售期间投资者资金的管理及利息处理方式 | <p>管理人应将本计划募集期间客户的资金存放于管理人开立的“东海证券股份有限公司集合资产管理计划资金结算专户”（以下简称“集合计划资金结算专户”），在本计划初始募集行为结束前，任何个人和机构不得动用。集合计划资金结算专户为集合计划参与、退出和收益分配资金清分交收账户。</p> <p>认购资金在初始募集期间发生的利息收入按银行同期活期存款利率计算。投资者的认购参与款项（不含认购费用）加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。利息的计算采用截位法保留到小数点后2位，差额部分计入本计划财产。</p> |
| 集合计划的参与和退出 | <p>一、参与和退出场所</p> <p>本计划参与和退出场所为各销售机构的营业网点，或按销售机构提供的其他方式办理参与和退出。</p> <p>二、参与和退出的开放日和时间</p> <p>1、开放期：本集合计划每周一、周二（如遇非工作日不开放、不顺延）为开放期，开放期内可以办理参与、退出业务，管理人无需另行公告。</p> <p>2、锁定持有期：投资者每笔份额的锁定持有期为自份额参与确认日起60个自然日（认购份额从计划成立日起算，申购份额从申购确认日起算，红利再投资份额锁定定期的开始日与产生该笔收益的原份额确认日保持一致，即计划成立日/申购确认日），投资者只能在锁定持有期满后的</p> |

开放期申请退出，但《管理合同》另有约定的除外。

业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，管理人有权视情况对前述参与办理的日期及时间进行相应的调整并公告。

三、临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

当发生合同变更、展期或监管规定等需要临时开放的情况时，管理人可公告临时开放期，投资者可在临时开放期退出本计划，临时开放期具体安排以管理人公告为准。

四、参与和退出的方式、价格、程序及确认

(一) “未知价”原则，即本计划的参与和退出价格以参与和退出申请提交日所在交易日收市后计算的计划份额净值为基准进行计算。

(二) 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。

(三) 投资者办理参与、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《管理合同》规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

(四) 当日的参与和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。

(五) 参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。当日(T日)在交易时间内提交的参与/退出申请，管理人及注册登记机构在收到投资者退出/参与申请的T+3日内对该交易的有效性进行确认，投资者通常可在T+4日后到销售网点查询退出/参与的确认情况。巨额退出的情形按本部分第九条巨额退出及连续巨额退出的认定及办理方式办理。

(六) 参与和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

将退回投资者指定资金账户。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划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各销售机构，并通过销售机构划往申请退出投资者的指定资金账户，退出款项将在 T+4 日内从托管账户划出。如集合计划出现《集合资产管理合同》所述暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。

（七）本集合计划在存续期内，若开放日当日的参与申请全部确认后使得本集合计划的客户数达到 200 户以上的，则对该开放日有效参与申请采用“时间优先、金额优先”的原则给与确认，未确认的参与款项退还给投资者。

（八）管理人在不损害投资者权益的情况下，经与销售机构协商一致，可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日告知投资者。管理人提前 3 个工作日在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。同时，管理人应提前书面告知销售机构。

（九）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。

五、参与和退出的金额限制

投资者在本计划存续期开放日购买本计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应不低于 30 万元人民币，超过最低参与金额的部分需为人民币 1,000 元的整数倍，已持有本计划份额的投资者在本计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。现有投资者在本计划存续期开放期追加购买本计划份额的，单笔追加金额不低于 1000 元的整数倍。

当投资者持有的计划份额所对应的资产净值高于 30 万元人民币时，投资者可以选择全部或部分退出本计划份额；选择部分退出本计划份额的，投资者在退出后持有的计划份额所对应的资产净值不得低于 30 万元，否则管理人将在退出申请确认日对该投资者所持有的全部份额做退

出处理。

当投资者持有的计划份额所对应的资产净值低于 30 万元人民币(含 30 万元人民币)时,需要退出本计划的,投资者必须选择一次性全部退出本计划。

在符合上述规定的前提下,管理人可根据市场情况,合理调整对参与金额和退出份额的数量限制并告知投资者。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

六、参与和退出的费用

1、参与费

本集合计划不收取参与费用。

2、退出费

本集合计划不收取退出费用。

七、参与份额和退出金额的计算方式

(一) 本计划参与份额的计算方式

本计划参与份额的计算方式如下:

参与份额=参与金额/参与申请所在交易日的资产管理计划份额净值
其中,参与份额的计算结果保留到小数点后 2 位,小数点 2 位以后的部分四舍五入,由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

(二) 本计划退出金额的计算方式

本计划退出金额的计算方式如下:

退出总金额=退出份额×退出申请所在交易日的资产管理计划份额净值

退出金额=退出总金额-业绩报酬(若有)

其中,退出总金额和退出金额的计算结果保留到小数点后 2 位,小数点 2 位以后的部分四舍五入,由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。

八、大额退出的通知

任一投资者在申请退出金额超过人民币 1000 万元的,应当提前 5 个工作日书面通知管理人。管理人未收到该等通知的,管理人有权拒绝

该投资者的退出。

九、巨额退出和连续巨额退出

（一）认定标准

若本计划单个开放日（T 日）的计划份额净退出申请超过前一交易日的计划总份额的【10%】，即认定为计划发生了巨额退出。同一开放期内连续 2 个开放日以上（含 2 个交易日）发生巨额退出，即认定为计划发生了连续巨额退出。

（二）退出顺序、退出价格确定和退出款项支付

出现巨额退出时，管理人和销售机构协商一致，可以根据本计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。出现连续巨额退出时，如管理人认为有必要，可暂停接受计划份额退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过【20】个工作日，并在管理人指定网站上进行公告。

1、全额退出：当管理人和销售机构认为有能力兑付投资者的全部退出申请时，管理人接受全额退出，并按正常退出程序执行。

2、部分退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为因支付投资者的退出申请而进行的财产变现可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出的总份额不低于当日参与申请总份额的前提下，可对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理并接受的退出申请。投资者选择延期退出的，管理人对当日未办理的退出申请份额，延迟至下一工作日办理，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权并以该工作日的计划单位净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。因延期退出而导致投资者的份额净值较申请退出日增加或减少的，管理人不承担任何责任。投资者在申请退出时可选择当日未受理部分予以撤销，未进行选择的默认顺延。

（三）告知客户方式

当发生巨额退出、连续巨额退出时，管理人应当及时告知投资者。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

十、延期支付及延期退出的情形和处理方式

发生下列情形时，管理人可延期支付退出款项或延期办理投资者退出申请：

（一）因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

（二）发生《管理合同》规定的暂停基金资产估值情况。

（三）证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值。

（四）因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额退出，导致本集合计划的现金支付出现困难。

（五）发生继续接受退出申请将损害现有份额持有人利益的情形时。

（六）当前一估值日计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当延期支付退出款项或延期办理退出申请。

（七）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定延期支付或延期支付时，已确认的退出申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，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，未支付部分由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。因集合计划所投资的流动性受限资产无法在约定时间内变现而导致无法按上述时间支付退出款项的，投资者同意计划管理人在流动性受限资产可变现后进行支付。

发生《管理合同》、集合计划说明书中未予载明的事项，但管理人有正当理由认为需要暂停接受退出申请的，可以暂停接受投资者的退出申请，并按照规定向相关监管机构报备。

暂停集合计划退出，管理人应及时通过管理人网站报告投资者，并制定相应的补救措施。在延期退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知投资者。

投资者认可上述关于退出的原则及处理方法，接受管理人依据法律法规及《管理合同》的约定所作出的延期退出或暂停退出的决定。

十一、拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式

(一) 在如下情况下，管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：

- 1、本计划份额持有人达到 200 户。
- 2、根据市场情况，管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对本计划业绩产生负面影响，从而损害现有投资者的利益的情形。
- 3、因本计划所持某个或某些证券进行权益分派等原因，使管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有投资者利益的。
- 4、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投资者利益的。
- 5、法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

管理人决定拒绝接受某些投资者的参与申请时，参与款项将退回投资者账户。

(二) 在如下情况下，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投资者的参与申请。
- 2、证券、期货交易场所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值和计划份额净值。
- 3、发生《管理合同》规定的暂停计划资产估值情况。
- 4、法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知投资者。在暂停参与的情形消除时，管理人应及时恢复参与业务的办理并予以告知投资者。

(三) 在如下情况下，管理人可以暂停接受投资者的退出申请：

- 1、因不可抗力导致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，导致管理人无法计算当日计划资产净值和计划份额净值。
- 3、发生《管理合同》规定的暂停本计划资产估值的情况。
- 4、连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

| | |
|--------------|---|
| | <p>5、法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一的，管理人应当及时告知投资者。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知投资者。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。</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书面方式告知托管人，并取得其同意。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</p> |

| | |
|-----------------------------------|--|
| | <p>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> |
| <p>集合计划成立的条件和日期</p> | <p>集合计划的初始募集规模不低于1000万元,投资者人数不少于2人,且不超过200人,募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。</p> <p>集合计划的募集金额缴足之日起10个工作日内,管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告,并在取得验资报告后公告资产管理计划成立。本集合计划成立的时间为计划管理人于管理人网站公告资产管理计划成立的日期。</p> |
| <p>集合计划设立失败(本金及利息返还方式)</p> | <p>募集期届满,本计划未达到《管理合同》约定的成立条件的,本计划募集失败,则管理人应当承担下列责任:</p> <p>(一)管理人以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用;</p> <p>(二)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,认购资金产生的利息自初始募集期结束之日起至下一个结息日后的五个工作日内退还集合计划投资者,各方互不承担其他责任。利息金额以本计划注册登记机构的记录为准。</p> <p>由于监管政策及指导意见的不时更新与变动,本计划可能存在无法成立或无法进行备案的风险,全体投资者确认,管理人及托管人对此不承担任何责任。</p> |
| <p>集合计划份额转让</p> | <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</p> |

| | |
|-------|---|
| | <p>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>(一) 管理人管理费计提和支付</p> <p>集合计划管理人的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下：</p> $H = E \times 0.80\% \div 365$ <p>H 为每日应计提的管理费</p> <p>E 为前一日的集合计划资产净值（产品成立首日按推广期参与资金及其推广期内产生的利息的总额计算）。</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>合同生效后，集合计划管理费每日计提，按季支付。由托管人根据与管理人核对一致的估值数据以及按照上述公式进行计算的结果，自动在每个自然季初的前 5 个工作日内按照管理人指定的管理费账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。</p> <p>(二) 托管人托管费计提和支付</p> <p>集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.02% 年费率计提，托管费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.02\% \div 365$ <p>H 为每日应计提的托管费</p> <p>E 为前一日的集合计划资产净值（产品成立首日按推广期参与资金及其推广期内产生的利息的总额计算）。</p> <p>合同生效后，托管费每日计提，按季支付。由托管人根据与管理人核对一致的估值数据以及按照上述公式进行计算的结果，自动在每个自然季初的前 5 个工作日内按照托管人指定的托管费账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。</p> |

| | |
|--|--|
| | <p>(三) 业绩报酬</p> <p>1、管理人收取业绩报酬的原则：</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《管理合同》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>2、业绩报酬的计提方法：</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、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> <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；</p> <p>S^*_T：指本次业绩报酬计提日的累计单位净值；</p> <p>S^*_0：指上一业绩报酬计提日的累计单位净值；</p> |
|--|--|

| | |
|--|---|
| | <p>S_0: 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）；</p> <p>T: 指资产管理计划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>本集合计划业绩报酬计提基准 F 为 5.20%/年。管理人根据投资运作情况可调整业绩报酬计提基准，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>在业绩报酬计提日，若投资者在该期间内的实际年化收益率 R 小于或等于业绩报酬计提基准 F，管理人不计提业绩报酬；若在该期间内的实际年化收益率 R 大于业绩报酬计提基准 F，管理人将对超过部分收益的 40% 计提业绩报酬，剩余部分归投资者所有。</p> <p>管理人按如下标准和方法提取业绩报酬：</p> <p>② $R \leq F$ 时，管理人不收取业绩报酬；</p> <p>② 当 $R > F$ 时，业绩报酬 = $M \times S_0 \times (R - F) \times 40\% \times T / 365$</p> <p>M: 应计提业绩报酬的集合计划份额。</p> <p>(3) 业绩报酬的支付</p> <p>因涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人依据《管理合同》计算并复核，托管人根据管理人发送的指令执行划款操作。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> <p>(四) 证券交易费用</p> <p>本集合计划应按规定比例在发生投资交易时单独计提并分别支付经手费、证管费、过户费、印花税和证券结算风险基金等，作为各自交易成本直接扣除。交易佣金的费率由集合计划管理人本着保护投资者利益的原则，按照法律法规的规定确定。</p> <p>本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金，其费率由管理人根</p> |
|--|---|

| | |
|--------------|---|
| | <p>据有关政策法规确定。具体划款时间和金额以管理人划款指令为准。</p> <p>证券账户开户费由管理人在开户时先行垫付，在集合计划成立后，管理人出具指令，由托管人从集合计划中扣划至管理人指定账户。托管人不垫付证券账户开户费。</p> <p>(五) 审计费用</p> <p>在存续期间发生的集合计划审计费用，在合理期间内摊销计入集合计划。</p> <p>本集合计划的年度审计费，按与会计师事务所签定协议所规定的金额，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>(六) 其他费用：</p> <p>银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、注册登记机构相关费用（包括认购登记结算费、服务月费、年度电子合同服务费）等集合计划运营过程中发生的相关费用；</p> <p>银行结算费用，一次计入集合计划费用；</p> <p>开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；</p> <p>与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。</p> <p>上述计划费用中第（四）至（六）项费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付。</p> |
| 不列入集合计划费用的项目 | <p>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，不得在计划资产中列支。</p> <p>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资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关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。</p> |
| 托管费、管理费的调整 | 管理人可以调减管理费率，并在新的管理费率开始实施前在管理人网站公告并发送至托管人。 |

| | |
|---------|---|
| | <p>管理人、托管人可以协商调减托管费率，并在新的托管费率开始实施前在管理人网站公告并发送至托管人。</p> <p>就今后上述调整事宜，全体投资者同意不再按照《管理合同》“第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算”第一项的规定进行合同变更事宜。</p> |
| 集合计划的税收 | <p>《管理合同》各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。投资者应缴纳的税收由投资者负责，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。</p> <p>为免歧义，各方特别约定并优先使用如下条款：《管理合同》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，属于本计划需要承担且由管理人作为纳税主体缴纳的，该税费由计划财产承担，管理人有权以计划财产予以缴纳，且无需事先征得投资者的同意（除本约定外，本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和孳息款项，投资者应按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，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、资产管理计划收益分配方案依据现行法律法规以及合同约定执行。</p> <p>二、可供分配利润的构成</p> <p>本计划可供分配利润为截至收益分配基准日计划未分配利润。计划已实现收益指计划利润减去公允价值变动收益后的余额。</p> <p>资产管理计划利润指计划投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入扣除相关费用后的余额。</p> |

三、收益分配原则

- (一) 每一集合计划份额享有同等分配权。
- (二) 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。
- (三) 本集合计划收益分配方式：采用现金红利或红利再投资方式。
- (四) 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。
- (五) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担，与收益分配的相关税赋由投资者自行承担。
- (六) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

四、收益分配基准日

- (一) 分红权益登记日（T 日）：由管理人于权益分配方案中确定；
- (二) 除息日：T 日为除息日。

五、收益分配方案的确定与通知

- (一) 计划收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

- (二) 计划收益分配方案由管理人拟订，由托管人复核，通过管理人网站或销售机构通告投资者。

六、收益分配方式

本计划收益分配方式分为两种：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。若采用现金分红方式，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。若采用红利再投资的方式，现金红利自动转为相应份额进行再投资。

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>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>(一) 资产管理计划展期应符合以下条件：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、本计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和《管理合同》的约定； 2、本计划展期没有损害投资者利益的情形； 3、中国证监会规定的其他条件。 <p>(二) 本计划展期的，应当符合本计划的成立条件。</p> |
| | <p>(一) 展期的安排</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、通知展期的时间 不晚于在集合计划到期前 1 个月。 2、通知展期的方式 管理人取得托管人同意后，将通过管理人网站公告通知投资者。 3、投资者回复的方式 投资者不同意展期的，应在展期公告发出后的 10 个工作日内按照展期公告中约定的方式明确回复不同意展期的意见；投资者未在前述时间回复意见或意思表达不明确的，视为投资者同意展期。 <p>展期公告满 10 个工作日后，若同意展期的投资者不少于 2 人，则展期生效，自展期公告生效之日起，公告内容即成为《管理合同》组成部分。投资者不同意展期的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：</p> <p>投资者不同意展期的，管理人维护其退出集合计划的权利，在所有投资者回复后或征询期满后，管理人将为不同意展期的投资者设置临时开放期退出本集合计划。具体开放期以管理人公告为准。</p> <p>(二) 展期的实现</p> <p>展期公告日（不含）起 10 个工作日届满，若同意展期的投资者不少</p> |

| | |
|-----------|--|
| | 于 2 人，并且符合资产管理计划的成立条件，则展期生效，本集合计划即实现展期。否则，集合计划到期终止，将按照《管理合同》及相关法律文件的规定办理集合计划到期终止和清算事宜。 |
| 展期情况备案 | 集合计划展期后 5 日内，管理人将展期情况报证券投资基金业协会或监管部门指定的其他机构备案，同时抄送管理人住所地所在地中国证监会派出机构。 |
| 投资者的权利与义务 | <p>(一) 投资者的权利</p> <p>1、分享本计划财产收益；</p> <p>2、取得分配清算后的剩余计划财产；</p> <p>3、按照《管理合同》的约定参与、退出和转让本计划份额；</p> <p>4、按照法律法规及《管理合同》约定的时间和方式获得本计划的信息披露资料；</p> <p>5、监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；</p> <p>6、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和《管理合同》约定的其他权利。</p> <p>(二) 投资者的义务</p> <p>1、认真阅读并遵守《管理合同》，保证投资资金的来源及用途合法；</p> <p>2、接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，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；</p> <p>3、认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>4、按照《管理合同》约定支付本计划份额的参与款项，承担《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>5、在持有的本计划份额范围内，承担本计划亏损或者终止的有限责任；</p> <p>6、向管理人或本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</p> |

| | |
|---------------|--|
| | <p>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>7、不得违反《管理合同》的约定干涉管理人的投资行为；</p> <p>8、不得从事任何有损本计划及其投资者、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>9、保守商业秘密，不得泄露本计划的投资计划、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>10、如投资者资金来源为募集资金，投资者保证受托资产的来源及用途合法，承诺已经在募集资金环节履行客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存、大额交易和可疑交易报告等反洗钱职责，确认不存在洗钱行为，管理人无需对投资者募集资金客户履行反洗钱职责。投资者不得将自有资金和募集资金混同操作；投资者在初始和持续募集资金过程中不得接受资管产品作为募集资金来源；</p> <p>11、投资者应当听取管理人或销售机构的适当性匹配意见并进行自主决策，在购买本产品或接受相应服务时，应当按照管理人和销售机构明示的要求提供管理人和销售机构履行适当性管理和开展反洗钱工作所需的真实信息。如投资者向管理人或销售机构提供虚假信息或证明材料，管理人、销售机构据此作出销售产品或提供金融服务行为的，由投资者自行承担不利后果及责任。</p> <p>12、在本计划存续期间及时关注管理人的短信、电话、邮件、传真以及其公司网站公告。</p> <p>13、理解并同意承担受托资产的投资、运作、托管面临《管理合同》之第二十四部分“风险揭示”以及风险揭示书中列举的各类风险。</p> <p>14、法律法规、中国证监会及证券投资基金管理协会规定和《管理合同》约定的其他义务。</p> |
| 信息披露的内容、频率和方式 | <p>一、管理人应向投资者提供下列信息披露文件：</p> <p>（一）资产管理合同、计划说明书和风险揭示书；</p> <p>（二）资产管理计划份额净值，资产管理计划参与、退出价格；</p> <p>（三）资产管理计划定期报告，至少包括季度报告和年度报告；</p> |

(四) 重大事项的临时报告;

(五) 资产管理计划清算报告;

(六) 中国证监会规定的其他事项。

二、资产管理计划运作期间，管理人应向投资者披露以下信息：

(一) 净值报告

本计划每个工作日向投资者披露经托管人复核的计划份额净值。

披露方式：计划份额净值报告将在管理人指定网站上披露，投资者可随时查阅。

(二) 季度报告和年度报告

1、管理人应于每季度结束之日起一个月内披露季度报告，每年度结束之日起四个月内披露年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况。本计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制当期的季度报告和年度报告。

2、年度报告内容应包括但不限于下列信息：

(1) 管理人履职报告；

(2) 托管人履职报告；

(3) 资产管理计划投资表现；

(4) 资产管理计划投资组合报告；

(5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；

(6) 资产管理计划财务会计报告；

(7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（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。

3、季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。

4、资产管理计划年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格的会计师事务所审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。

（三）托管人履职报告

1、托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，由管理人根据管理合同约定的方式向投资者披露。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。

2、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。

3、管理人应当在每年度结束后 3 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。

4、因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

三、临时报告

发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向投资者披露。

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经理发生变更，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；

（3）发生巨额退出并延期支付；

（4）集合计划终止和清算；

（5）集合计划存续期满并展期；

（6）合同的补充、修改与变更；

- (7) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- (8) 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；
- (9) 管理人及其子公司（孙公司）以自有资金参与或退出本集合计划；
- (10) 管理人调整业绩报酬计提基准；
- (11) 设置临时开放期；
- (12) 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；
- (13) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- (14) 其他管理人认为的重大事项。

四、向投资者提供报告及投资者信息查询的具体方式

（一）投资者信息查询范围

投资者可根据管理合同约定的时间和方式查阅或复制计划所披露的信息资料。

（二）投资者向管理人查询信息的方式

管理人通过以下至少一种方式进行披露信息即视为履行了告知义务，投资者可通过以下方式向管理人查阅管理合同约定披露的信息资料：

1、资产管理人网站

定期报告、份额净值报告、临时报告等管理合同约定披露的信息资料将在管理人网站上披露，投资者可随时查阅。

2、邮寄服务

管理人或销售机构向投资者邮寄定期报告等管理合同约定披露的信息资料。投资者在管理合同签署页上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，投资者应当及时以书面方式或以管理人规定的其他方式通知管理人。

3、传真或电子邮件

如投资者留有传真号、电子邮箱等联系方式的，管理人也可通过传

| | |
|---------------|--|
| | <p>真、电子邮件、电报等方式将管理合同约定披露的信息资料告知投资者。</p> <p>(三) 投资者向托管人查询信息的方式</p> <p>1、投资者可通过电话、传真或电子邮件等联系方式，经由管理人向托管人查询有关信息披露资料。</p> <p>2、对于管理人向投资者提供的文件材料中不在托管人复核职责范围内的信息，应由管理人保证该等信息的真实性、有效性、合法性。</p> <p>3、对于因管理人未提供或未及时提供应由托管人复核的相关信息披露文件等客观因素，导致托管人无法履行或无法按时履行相应复核职责的，由过错方承担相应责任。</p> <p>五、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划，应向投资者充分披露。</p> <p>六、管理人、托管人向监管机构的报告</p> <p>管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募资产管理业务管理年度报告和私募资产管理业务托管年度报告，并报中国证监会相关派出机构和证券投资基金管理协会备案。</p> <p>七、信息披露文件的存放及查阅</p> <p>本集合计划的定期公告与报告、临时公告与报告披露于管理人网站，供投资者查阅。</p> <p>管理人和托管人应当妥善保存客户开户资料、委托记录、交易记录和与内部管理、业务经营有关的各项资料，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者毁损。</p> |
| 投资风险揭示 | <p>投资者投资于本计划可能面临风险，有可能因下述风险导致投资者本金或收益损失。管理人承诺以诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划资产，管理人制定并执行相应的内部控制制度和风险管理制度，以降低风险发生的概率。但这些制度和方法不能完全防止风险出现的可能，管理人不保证本计划一定盈利，也不保证最低收益。</p> <p>本资产管理计划为固定收益类资产管理计划，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，</p> |

| | |
|-----------|---|
| | <p>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> |
| 利益冲突及关联交易 | <p>一、利益冲突情形</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> <ol style="list-style-type: none"> 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； 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； 3、管理人及其子公司（孙公司）自有资金参与和退出本计划； 4、法律、行政法规规定或者中国证监会认定的其他情形。 <p>二、利益冲突的处理</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。</p> <p>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。</p> <p>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：</p> <p>（1）关联交易的范围</p> <p>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</p> |

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“二十五、

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“二十五、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

| | |
|-------|---|
| | <p>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。</p> <p>B、管理人董事会审议批准以下关联交易：</p> <p>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。</p> <p>C、管理人股东大会审议批准以下关联交易：</p> <p>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。</p> <p>3) 在交易定价机制方面</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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> <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) 资产管理计划合同的终止</p> <p>资产管理计划终止的情形，包括但不限于下列事项：</p> <p>(1) 资产管理计划存续期届满且不展期；</p> <p>(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，且在六个月内没有新的管理人承接；</p> <p>(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，且在六个月内没有新的托管人承接；</p> |

| | |
|--|---|
| | <p>(4) 存续期内, 经全体投资者、管理人、托管人协商一致可以提前终止本集合计划;</p> <p>(5) 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;</p> <p>(6) 未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形;</p> <p>(7) 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;</p> <p>(8) 集合计划份额净值触及止损线的情形;</p> <p>(9) 管理人认为本计划的投资策略已不适应当时的市场环境时, 管理人可以与托管人协商一致提前终止本计划;</p> <p>(10) 有下列情形的, 管理人有权终止本集合计划:</p> <ol style="list-style-type: none"> 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; 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; 3) 其他管理人认为有必要提前终止集合计划的情况。 <p>(11) 战争、自然灾害等不可抗力的发生导致本集合计划不能存续;</p> <p>(12) 法律、行政法规、中国证监会规定或资产管理合同约定的其他情形。</p> <p>发生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、宣告破产情形时, 托管人有权立即对托管账户采取止付措施。</p> <p>管理人应当自本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(六)项约定的情形除外。</p> <p>(二) 集合计划的清算</p> <p>管理人应在本计划发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算, 管理人应通知托管人和投资者本集合计划终止。自集合计划终止日起, 本集合计划不得进行任何新增投资行为。</p> <p>1、资产管理计划财产清算小组</p> |
|--|---|

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。

资产管理计划财产清算小组负责计划财产的保管、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

(1) 本计划合同终止时,由资产管理计划财产清算小组统一接管财产;

(2) 对本计划财产和债务进行清理和确认;

(3) 对本计划财产进行估价和变现;

(4) 制作清算报告;

(5) 对本计划剩余财产进行分配。

(6) 本集合计划清算完毕,资产管理合同终止。

3、清算费用的来源和支付方式

清算费用是指资产管理计划财产清算小组在进行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计划财产中支付。

4、资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

(1) 本计划终止时已计提但尚未支付的管理费、托管费等,经清算小组复核后从清算财产中支付。

集合计划财产按如下顺序进行清偿

① 支付集合计划财产清算费用;

② 缴纳集合计划所欠税款;

③ 清偿集合计划债务。

(2) 依据资产管理计划财产清算的分配方案,将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以现金形式进行分配,《管理合同》另有约定的除外。

(3) 因持有流通受限证券及其他投资品种等原因导致本计划财产无法及时变现的,管理人应将已变现部分先行分配,并于本计划终止后对计划财产进行延期清算。清算期间将不再提取管理费、托管费等相关费

| | |
|------|---|
| | <p>用及业绩报酬（如本计划合同已明确约定业绩报酬的收取）。待上述资产可以变现时，管理人应及时完成剩余可变现计划资产的变现操作后进行延期清算，并在扣除相关费用和业绩报酬（如有）后将该剩余财产分配给全体投资者。本计划持有多只流通受限的证券及其他投资产品的，管理人按本款约定进行多次变现及清算。管理人应在剩余计划财产变现并完成清算后 3 个工作日内向托管人发送指令，托管人按指令将剩余计划财产划至指定账户。</p> <p>（4）在计划财产移交前，由托管人负责保管。清算期间，任何当事人均不得运用该财产。清算期间的收益归属于计划财产，发生的保管费用由被保管的计划财产承担。因投资者原因导致计划财产无法转移的，托管人和管理人可以在协商一致后按照有关法律法规进行处理。</p> <p>5、本计划因受托资产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p> <p>6、资产管理计划财产清算报告的告知安排</p> <p>清算小组在本计划终止后 20 个工作日内编制计划财产清算报告，由管理人或销售机构按照投资者提供的联系方式或由管理人通过其公司网站告知投资者。投资者在此同意，上述报告不再另行审计，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。</p> <p>管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案。</p> <p>7、资产管理计划财产相关账户的注销</p> <p>计划财产清算完毕后，托管人按照规定注销本计划托管账户及本计划投资所需账户，管理人应给予必要的配合。</p> <p>8、资产管理计划财产清算账册及文件的保存</p> <p>本计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。</p> |
| 特别说明 | 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。 |