

省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划说明书

2022 年

特别提示:

本说明书依据《中华人民共和国证券法》、《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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《管理合同》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》（以下简称《合同指引》）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，不存在任何虚假记载、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《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《管理合同》且合同生效后，投资者即为《管理合同》的委托人，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。委托人将按照《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	省心享-华泰量化多头单策略 FOF1 号集合资产管理计划	
	类型	权益类 (FOF)	
	目标规模	本集合计划的最低初始募集规模为人民币 1000 万元。	
	管理期限	本集合计划的存续期限为 10 年，从集合计划成立日起计算。	
	计划分级	本集合计划是否根据风险收益特征进行分级：否	
	初始募集期	在初始募集期内，投资者在工作日内可以认购本集合计划。本集合计划初始募集期自计划份额发售之日起不超过 60 天。	
	运作方式	开放式	
	份额面值	人民币 1.00 元。	
	最低金额	本集合计划单个投资者参与最低金额为 101 万元（含参与费）人民币，超过最低参与金额的部分不设金额级差，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。	
	相关费率	1、认购/参与费：	认购/参与金额 M
		M < 300 万	1%
		300 万 ≤ M < 500 万	0.5%
		M ≥ 500 万	0
	2、退出费：0		
	3、管理费：1%/年		
	4、业绩报酬：委托人持有期间年化收益率超过 8% 以上部分按照 15% 的比例收取；		
	5、托管费：0.01%/年		
	6、其他费用（如有）：年度专项审计费用、律师费、信息披露费用、银行结算费用、开户费等集合计划运营过程中发生的相关费用。		
投资范围	<p>投资范围包含如下资产：</p> <p>本集合计划主要投资于金融产品和现金类资产。</p> <p>1、金融产品：本计划主要投资于管理人选定的证券公司、基金公司、期货公司发行的集合资产管理计划以及在中国证券投资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（上述资产简称：私募基金）、公募证券投资基金、商业银行理财产品。本集合计划所投资的资产管理产品不会再投资公募证券投资基金以外的资产管理产品。</p> <p>2、现金类资产：包括现金、存款、通知存款、同业存单、期限在 7 天以内（含 7 天）的债券逆回购、货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具。</p>		
投资比例	1、金融产品：占集合计划资产总值的 80%-100%，金融产品包括证券公司、基金公司、期货公司发行的集合资产管理计划以及在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资		

	<p>基金（上述资产简称：私募基金）、公募证券投资基金、商业银行理财产品。本计划按照所投资资产管理产品披露组合投资的频率，根据穿透原则合并计算的投资于权益类资产的总值不得低于计划总资产的 80%，投资于固定收益类、商品及金融衍生品类资产的总值均不得超过计划总资产的 20%。</p> <p>2、现金类资产：现金类资产包括现金、存款、通知存款、同业存单、期限在 7 天以内（含 7 天）的债券逆回购、货币市场基金以及中国证监会认可的其他现金管理类工具。</p> <p>管理人应自起始运作日起 6 个月内使本计划符合该比例限制。</p> <p>本计划完成备案前不得开展投资活动，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的除外。</p> <p>本集合计划的建仓期为 6 个月，本集合计划管理人应当在产品成立之日起 6 个月内，使得本产品投资组合比例符合上述要求。</p> <p>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之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个工作日内调整至符合相关要求。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>												
<p>投资策略</p>	<p>1、金融产品投资策略</p> <p>本计划为主动管理类 FOF 产品，投资策略为筛选涵盖量化多头策略的优质基金。</p> <p>本计划管理人对资产管理产品的选择主要基于对金融产品管理人投资能力评估和合规运营风险评估，采用定性分析为主，定量分析为辅的方法，将投资能力和合规运营风险各自分为 5 个等级，两方面必须同时达到 3 分以上方可聘用。具体的分析方法：（1）定量分析：通过获取拟投资资产管理产品的数据，辅以定量归因分析。（2）定性分析：对金融产品管理人的核心投研人员进行面对面访谈。对单个金融产品的选择上，更加注重投资逻辑的稳定性和预判性，而非仅仅基于历史收益风险比。在此基础上，选择其优势策略产品。</p> <p>评分等级分类见下表：</p> <table border="1" data-bbox="649 1102 1213 1338"> <thead> <tr> <th>投资能力等级</th> <th>合规运营风险等级</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>5 杰出</td> <td>5 健全</td> </tr> <tr> <td>4 卓越</td> <td>4 标准</td> </tr> <tr> <td>3 优秀</td> <td>3 建议改善</td> </tr> <tr> <td>2 低于平均</td> <td>2 不足</td> </tr> <tr> <td>1 不足</td> <td>1 无效</td> </tr> </tbody> </table> <p>2、现金类资产投资策略</p> <p>本计划以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对现金管理类金融品种的组合操作，在保持本金的安全性与资产流动性的同时，追求稳定的当期收益。通过合理有效分配本计划的现金流，保持投资组合的流动性，满足本计划投资运作的要求。</p>	投资能力等级	合规运营风险等级	5 杰出	5 健全	4 卓越	4 标准	3 优秀	3 建议改善	2 低于平均	2 不足	1 不足	1 无效
投资能力等级	合规运营风险等级												
5 杰出	5 健全												
4 卓越	4 标准												
3 优秀	3 建议改善												
2 低于平均	2 不足												
1 不足	1 无效												
<p>投资限制</p>	<p>本集合计划的投资限制包括：</p> <p>1、本计划的总资产不得超过本计划净资产的 200%；</p> <p>2、本计划投资于同一资产的资金不得超过计划资产净值的 25%；按照所投资资产管理产品披露组合投资的频率，管理人管理的全部集合资产管理计划根据穿透原则合并计算的底层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；</p> <p>3、本计划投资于其他资产管理产品的，计算本计划的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，该资产管理计划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，应当符合中国证监会的最新监管规定。资产管理计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算该资产管理计划所投资资产的金额或比例；</p> <p>4、本计划不直接投资于证券二级市场，不投资于融资类项目；</p> <p>5、本计划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；</p> <p>6、计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的</p>												

		10%； 7、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本计划资产净值的20%。
投资者权利与义务		<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) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；</p> <p>(4) 按照法律法规及本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>(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) 认真阅读并遵守资产管理合同，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；</p> <p>(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；</p> <p>(4) 认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(5) 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>(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；</p> <p>(7) 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>(8) 投资者身份资料以及联络方式以投资者在各销售机构所留存的信息/签署电子合同时留存的信息为准。投资者承诺留存的联络方式真实、有效、畅通，否则将自行承担不利后果。投资者联络方式变更时，应及时以书面方式通知管理人或销售机构，管理人或销售机构收到投资者通知的时间视为送达时间。投资者未书面通知管理人或销售机构的，管理人或销售机构以投资者原留存的联络方式为准。</p> <p>(9) 本集合计划采用电子签名合同，投资者应当如实提供与签署电子合同相关的信息和资料。投资者应当以自己的名义在参与网点开立指定资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；</p> <p>(10) 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>(11) 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>(12) 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>(13) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。</p>
	风险收益特征	本集合计划属中高风险产品
	适合销售对象	适合专业投资者和合格投资者中积极型及以上的普通投资者。
当事人	管理人	华泰证券（上海）资产管理有限公司
	托管人	招商银行股份有限公司南京分行
	投资顾问	无
	销售机构	<p>华泰证券（上海）资产管理有限公司以及与管理人华泰证券（上海）资产管理有限公司签订销售协议且符合法律法规要求的其他销售机构。</p> <p>本集合计划管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本集合计划。</p>
集合计划	办理时间	<p>(1) 封闭期：本计划成立之日起1个月封闭运作。自本集合计划成立满1个月后的每周四、周五开放参与（如遇非交易日则当天不开放参与），自本集合计划成立满6个月后的每月的第1个交易日开放退出。除开放期外的每一个工作日均为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。</p> <p>本计划针对每一集合计划份额设有锁定期，锁定期为自该集合计划份额被确认之日起180天（约6个</p>

的参与和退出	<p>月)，即委托人仅可在本集合计划开放退出日对其持有的已过锁定期的集合计划份额进行退出。认购的份额自集合计划成立之日起计算，申购的份额自申购确认之日起计算。</p> <p>(2) 开放期：自本集合计划成立满1个月后的每周四、周五开放参与（如遇非交易日则当天不开放参与），自本集合计划成立满6个月后的每月的第1个交易日开放退出，本集合计划具体开放安排以管理人公告为准。中国证监会另有规定的除外。</p> <p>预约退出方式：委托人如需在该开放期退出，需在本集合计划成立满6个月后开放退出的每月第1个交易日（T日）前9个工作日（T-9日）至7个工作日（T-7日）通过信件、传真、电子邮件等方式在销售机构提出预约退出申请，具体以管理人公告为准。在除管理人特别约定的情形外，若委托人未提交预约退出申请，则管理人有权拒绝该次退出申请。经委托人提交预约退出申请后，管理人在该退出开放期对提交预约退出申请的客户进行份额退出。</p>									
办理场所	<p>投资者既可以到本集合计划销售机构指定营业网点的柜台申请参与或退出集合计划，也可以登录销售机构指定网络系统以自主下单的方式申请参与或退出集合计划，具体参与和退出方式以管理人公告为准。</p>									
参与的办理方式、程序	<p>(1) 参与的方式、价格和金额限制</p> <p>1) 投资者在存续期开放日购买资产管理计划份额的，应符合合格投资者标准。</p> <p>2) 参与以金额申请。本集合计划单个投资者参与最低金额为101万元人民币（含参与费），超过最低参与金额的部分不设金额级差，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>3) 初始募集期认购采用“已知价”原则，参与价格为份额面值1.00元人民币；存续期参与采用“未知价”原则，即参与集合计划份额的价格以参与申请日当日份额净值为基准进行计算。</p> <p>4) 在存续期内，当集合计划募集规模接近或达到约定的规模上限时，管理人可提前暂停接受参与申请，对有效参与申请采用“金额优先+金额同等情况下时间优先”的原则给与部分确认，未确认部分的参与款项退还给投资者。</p> <p>5) 本集合计划采用电子签名合同，投资者在签署电子签名合同后方可参与本集合计划。投资者应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，管理人和销售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。</p> <p>(2) 参与的程序和确认</p> <p>1) 投资者在接受销售机构风险承受能力测评后，需签署电子签名约定书，同意以电子签名方式签署集合资产管理合同，之后必须根据本集合计划销售机构规定的手续，在指定参与时间内提出参与申请。投资者既可以到本集合计划销售机构指定营业网点的柜台申请参与集合计划，也可以登录销售机构指定网络系统以自主下单的方式申请参与集合计划。当日参与申请可以且只能在当日交易时间内申请撤销。</p> <p>2) 投资者需要事先开设销售机构认可的交易账户，并在账户内备足参与的货币资金；若账户内参与资金不足的，销售机构不受理该笔参与申请。投资者参与申请经确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；投资者指定资金账户作为办理参与款项、红利款项、退出款项以及清算款项的收款账户。投资者应承诺在本集合计划的资产管理合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料。在兑付受托资金及收益时，管理人应当保证受托资金及收益返回投资者的原账户、同名账户。</p> <p>3) 投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分。</p> <p>4) 注册登记机构在T+2日内为投资者参与的有效性进行确认，投资者参与申请确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销。</p> <p>5) 开放期参与的，投资者于T日提交参与申请后，可于T+3日后在原销售场所或管理人网站查询参与确认情况。</p>									
参与费及参与份额的计算	<p>(1) 参与费率：</p> <table border="1" data-bbox="373 1889 882 2038"> <tr> <td>参与金额 M</td> <td>参与费率</td> </tr> <tr> <td>M < 300 万</td> <td>1%</td> </tr> <tr> <td>300 万 ≤ M < 500 万</td> <td>0.5%</td> </tr> <tr> <td>M ≥ 500 万</td> <td>0</td> </tr> </table>	参与金额 M	参与费率	M < 300 万	1%	300 万 ≤ M < 500 万	0.5%	M ≥ 500 万	0	
参与金额 M	参与费率									
M < 300 万	1%									
300 万 ≤ M < 500 万	0.5%									
M ≥ 500 万	0									

	<p>投资者如果有多笔参与，费率按单笔分别计算。</p> <p>管理人有权调减参与费率，并在新的费率开始实施前1个工作日在管理人指定网站公告。</p> <p>(2) 存续期参与份额的计算： 参与费=参与金额/(1+参与费率)×参与费率 参与份额=(参与金额-参与费)/集合计划参与日份额净值 参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。</p>
认购资金利息	投资者的认购资金在初始募集期产生的利息将折算为计划份额归投资者所有，参与资金的利息以注册登记机构的确认结果为准。
退出的办理方式、程序	<p>(1) 退出的方式、价格和金额限制</p> <p>1) “未知价”原则，即退出集合计划份额的价格以退出申请日当日份额净值为基准进行计算。</p> <p>2) 采用份额退出的方式，即退出以份额申请。</p> <p>3) 单笔退出申请份额不低于1000份。投资者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。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，即100万，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。</p> <p>(2) 退出的程序和确认</p> <p>1) 退出申请的提出</p> <p>投资者可在原参与网点，在规定的开放期内办理退出申请，或登录原参与销售机构指定的网络系统以自主下单的方式申请退出集合计划。</p> <p>具体退出方式以管理人退出公告为准，如公告中采用自动退出或按比例自动退出方式等则由管理人为客户按公告约定的退出规则为管理人办理退出。</p> <p>2) 退出申请的确认</p> <p>销售机构指定营业网点受理申请后，检查投资者持有的集合计划份额，交注册登记机构确认；注册登记机构在T+2日内为投资者扣除权益并办理相应的注册登记手续。当日(T日)在交易时间内提交的申请，投资者通常可在T+3日到网点查询退出的确认情况。</p> <p>3) 退出款项划付</p> <p>退出款项将在T+10日内从托管账户划出，经销售机构划往投资者资金账户。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，可以将划拨日期相应顺延。由于交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则退出款顺延至管理人及托管人无法控制的因素消除后划往委托人账户。</p>
退出费用及退出份额的计算	<p>(1) 退出费率：0</p> <p>(2) 退出金额的计算：</p> <p>委托人退出金额为退出总额扣减退出费用和管理人业绩报酬后的余额，计量单位为人民币元，退出金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分所代表的资产归属集合计划资产。</p> <p>退出总额=退出份额×集合计划份额净值-管理人业绩报酬(如有)</p> <p>退出费用=退出总额×退出费率</p> <p>退出金额=退出总额-退出费用</p> <p>管理人业绩报酬计算方式详见“资产管理计划的费用与税收”章节。</p>
退出的限制	单笔退出申请份额不低于1000份。投资者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。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，即100万，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。
巨额退出、连续巨额退出、单客户大额退出	<p>1、巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(1) 巨额退出的认定</p> <p>单个开放日，本集合计划持有人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)超过上一工作日总份额数的10%时，即为巨额退出。</p> <p>(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>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、部分顺延退出或暂停退出；</p> <p>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。</p>

		<p>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份额净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。</p> <p>(3) 告知客户的方式</p> <p>发生巨额退出并延期办理时，管理人应在 5 个自然日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。</p> <p>(4) 单客户大额退出的认定及处理</p> <p>单个开放日，本集合计划单个持有人退出申请份额符合上述情形的，管理人有权对该单客户超出该比例的退出申请实施延期办理，对于该单客户的剩余退出申请管理人有权根据前文(2)中“全额退出”或“部分顺延退出”与其他集合计划份额持有人的退出申请一并办理。延期的退出申请与下一开放日退出申请一并处理，无优先权并以下一开放日的集合计划单位份额净值为基础计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。但是，对于未能退出部分，如该单客户在提交退出申请时选择取消退出，则其当日未获受理的部分退出申请将被撤销。</p> <p>2、连续巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(1) 连续巨额退出的认定</p> <p>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。</p> <p>(2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按本合同载明的规定，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 20 个工作日，并在管理人指定网站上进行公告。</p>
拒绝或暂停参与、退出		<p>发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的参与申请：</p> <p>(1) 本集合计划份额接近或达到规模上限；</p> <p>(2) 本集合计划委托人数接近或达到法律、行政法规和资产管理合同规定的上限；</p> <p>(3) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；</p> <p>(4) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能影响或损害现有委托人利益时；</p> <p>(5) 法人或者依法成立的其他组织用筹集的资金参与集合计划而未提供管理人要求的合法筹集资金的证明文件；</p> <p>(6) 法律、行政法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>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：</p> <p>(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；</p> <p>(2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；</p> <p>(3) 管理人认为退出申请可能会影响或损害现有投资者利益时；</p> <p>(4) 因非管理人原因，导致本集合计划的现金支付出现困难时；</p> <p>(5) 连续巨额退出；</p> <p>(6) 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在本合同及说明书中载明的特殊情形。</p>
管理人自有资金参与情况		<p>1、自有资金参与的条件</p> <p>管理人在初始募集期和存续期均可以自有资金参与本集合计划。管理人以自有资金参与本集合计划，应符合法律、行政法规、中国证监会、中国证券投资基金业协会和本合同的相关规定，并按照《公司法》和公司章程的规定获得相应授权程序的批准。</p> <p>2、自有资金参与的金额和比例</p> <p>在集合计划存续期内，管理人自有资金参与本集合计划的份额不得超过本计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合资产管理计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。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限的，管理人应在具备退出本计划条件时将自有资金比例降至适合比例，并在退出本计划前 5 个工作日以网站公告的形式告知托管人和集合计划持有人。</p> <p>3、自有资金的责任承担方式与收益分配</p>

	<p>管理人自有资金参与集合计划，按照其参与份额比例分享同等收益、承担同等风险。</p> <p>自有资金的参与和退出时应当符合法律、行政法规和中国证监会的规定。</p> <p>4、管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于6个月。在满足持有期不少于6个月等监管规定的前提下，管理人有权退出以自有资金参与的本集合计划的份额，管理人参与、退出时应当提前5个工作日以网站公告的形式告知托管人和集合计划持有人。</p> <p>为应对集合资产管理计划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合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受上述限制。</p> <p>集合计划存续期内，当法律法规或有关自有资金参与集合计划的规定或政策发生变更，管理人经与托管人协商一致并公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整。投资者对修改或调整的内容有异议，可在修改或调整的内容生效前按照本合同规定申请退出集合计划。投资者未退出的，视为同意修改或调整的内容。</p>
集合计划成立的条件、时间	<p>集合计划的参与资金总额（不含参与费）不低于1000万元人民币且投资者人数为2人（含）以上200人以下，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集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人公告本集合计划成立。</p> <p>集合计划设立完成前，投资者的认购资金只能存入注册登记机构指定的募集账户或为本集合计划开立的托管账户，不得动用。</p>
集合计划设立失败（本金及利息返还方式）	<p>集合计划初始募集期结束，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人的条件下，集合计划设立失败，管理人以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并在募集期届满后三十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。</p>
集合计划份额转让、非交易过户和冻结	<p>（一）集合计划份额的转让</p> <p>在技术条件成熟的前提下，经管理人申请并开通份额转让事宜后，本集合计划份额可以转让。集合计划存续期间，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。投资者在此授权，当集合计划获得份额转让资格后，管理人可根据份额转让交易平台的规则，为满足份额转让实现和符合合同规定，为投资者办理份额转托管等相关业务。</p> <p>（二）集合计划份额的非交易过户</p> <p>非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一投资者集合计划账户转移到另一投资者集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的有关规定办理。</p> <p>（三）集合计划份额的冻结</p> <p>集合计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。</p>
费用、报酬	<p>费用种类（计提标准、方法、支付方式）</p> <p>1、集合计划管理人的管理费</p> <p>本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的1%年费率计提，计算方法如下：</p> $T = E \times 1\% \div \text{当年天数}$ <p>T为每日应计提的管理费</p> <p>E为前一日集合计划资产净值</p> <p>集合计划管理费每日计提，按自然季度支付。经管理人与托管人双方核对无误后，管理人向托管人出具划款指令于每季度前5个工作日内将上季度计提的管理费从集合计划资产中一次性支付给管理人。管理人有权根据情况下调管理费率，并于费率下调日前至少1个工作日公告。自下调日起，管理费按照新费率执行。</p> <p>2、集合计划管理人的业绩报酬</p> <p>（1）业绩报酬的计提原则：</p> <p>投资者在不同时间多次参与本计划的，管理人对投资者按每笔参与份额分别考核，对超过业绩报酬计提基准的超额收益部分按约定的业绩报酬计提比例计提。</p> <p>在本计划成立后每个收益分配、份额退出、计划终止时，管理人根据本计划合同约定的提取条件和方式计提业绩报酬。其中：</p> <p>1) 收益分配时计提业绩报酬的，管理人将从分红金额中收取</p>

	<p>2) 份额退出时计提业绩报酬的, 管理人将从退出金额中收取;</p> <p>3) 计划终止时计提业绩报酬的, 管理人将从清算财产中收取。</p> <p>(2) 业绩报酬 (R) 的计算方法</p> $R = F \times NAV'_0 \times \left[\frac{NAV_t - NAV_0}{NAV_0} - B \times T / 365 \right] \times P\%$ <p>其中:</p> <p>F 为提取业绩报酬的份额;</p> <p>NAV'_0 为上一个业绩报酬计提日的计划份额净值 (如为首次计提业绩报酬, 认购参与的为本计划初始发售面值, 申购参与的为申购参与的份额净值);</p> <p>NAV_t 为本次业绩报酬计提日的计划累计份额净值;</p> <p>NAV_0 为上一个业绩报酬计提日的计划累计份额净值;</p> <p>B 为业绩报酬计提基准 (年化);</p> <p>P% 为业绩报酬计提比例;</p> <p>T 为上一个业绩报酬计提日 (如为首次计提业绩报酬, 认购参与的为本计划成立日, 申购参与的为申购参与当日) 到本次业绩报酬计提日的自然日天数;</p> <p>(3) 业绩报酬计提基准和计提比例</p> <p>业绩报酬计提基准: 本集合计划业绩报酬计提基准 (年化) 为 8%。</p> <p>业绩报酬计提比例 15%。</p> <p>(4) 业绩报酬的计算和支付</p> <p>本集合计划的业绩报酬由注册登记机构根据本合同约定的方法计算, 并通过注册登记数据文件发送。</p> <p>托管人根据管理人的指令将业绩报酬划拨给注册登记机构, 由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人。</p> <p>3、集合计划托管人的托管费</p> <p>本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.01% 年费率计提, 计算方法如下:</p> $T = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$ <p>T 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, 按自然季度支付。于每季度前 5 个工作日内经管理人与托管人双方核对无误后, 管理人向托管人出具划款指令将上季度计提的托管费从集合计划资产中一次性支付给托管人。</p> <p>托管费收入账户:</p> <p>户名: 其他应付款 - 托管费收入</p> <p>账号: 912550120620091010</p> <p>开户银行: 招商银行南京分行运营管理部</p> <p>4、计划成立后与计划相关的会计师费</p> <p>本集合计划的年度财务会计报告审计费, 按与会计师事务所签定协议所规定的金额, 在被审计会计期间, 按直线法在每个自然日内平均摊销。</p> <p>5、上述“一、集合计划费用的种类”中的第 5-8 项费用, 根据有关法规及相应协议规定, 按费用实际支出金额通过一次计入或摊销方式列入当期费用。</p>
不由集合计划承担的费用	<p>计划成立前以及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销售有关的费用, 不得列入计划费用。</p> <p>集合计划管理人和集合计划托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失, 以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不列入集合计划费用。</p>

收益分配	<p>(一) 计划利润的构成</p> <p>计划利润指计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，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>(二) 计划可供分配利润</p> <p>计划可供分配利润指截至收益分配基准日计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；</p> <p>(三) 计划收益分配原则</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、在符合收益分配原则的前提下，计划管理人每年最多进行2次收益的分配； 2、计划收益分配基准日的份额净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值； 3、每一计划份额享有同等分配权； 4、每次收益分配不得低于基准日可供分配收益的20%； 5、法律法规另有规定的从其规定。 <p>在符合法律法规和计划合同约定，并对计划份额持有人利益无实质不利影响的前提下，管理人在与委托人协商一致后可对收益分配原则进行调整，并在管理人网站上公告。</p> <p>(四) 收益分配方案的确定与通知</p> <p>收益分配方案应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</p> <p>收益分配方案由管理人拟定，并通知托管人，在R-2日（R为权益登记日）前公告。</p> <p>计划红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）的时间原则上不得超过15个工作日。</p> <p>(五) 收益分配的执行方式</p> <p>本集合计划的分红方式为现金分红。现金分红时，管理人将现金红利款划往销售机构账户，再由销售机构划入委托人账户，自红利发放之日起7个工作日内到达委托人账户。</p> <p>计划收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，计划登记机构可将计划份额持有人的现金红利自动转为计划份额。</p>
信息披露	<p>(一) 本计划的信息披露应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、计划合同及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本计划从其最新规定。</p> <p>(二) 管理人披露信息</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、计划份额净值 <p>计划成立后，在封闭期内，计划管理人应当至少每周披露一次计划份额净值；计划成立后的每个开放期内，计划管理人在每个开放日后两个工作日内披露开放日的计划份额净值。</p> <p>计划份额净值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，管理人将提前在原网站进行公告。</p> <ol style="list-style-type: none"> 2、计划定期报告，包括年度报告、季度报告 <p>管理人应当在每年结束之日起4个月内，编制完成经托管人复核的计划年度报告，并将年度报告在管理人指定网站上披露，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计划的年度报告进行审计。</p> <p>管理人应当在每个季度结束之日起一个月内，编制完成经托管人复核的计划季度报告，并将季度报告在管理人指定网站上披露。</p> <p>计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月的，管理人可以不编制当期的季度报告和年度报告。</p> <p>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) 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。 <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>

	<p>3、临时报告</p> <p>集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当于5日内以管理人网站通告等方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>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；</p> <p>2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>3) 发生巨额退出并延期办理；</p> <p>4) 集合计划终止和清算；</p> <p>5) 集合计划存续期满并展期；</p> <p>6) 管理人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) 集合计划投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券；</p> <p>10) 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>11) 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>12) 其他可能影响投资者权益的重大事项。</p> <p>13) 其他依据法律法规需要披露的情形。</p> <p>(三) 管理人提供的其他服务</p> <p>1、对账单</p> <p>管理人每个季度通过网站或交易客户端等方式向投资者提供对账单，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。</p> <p>(四) 投资者查询的方式和途径</p> <p>1、管理人网站信息披露</p> <p>本计划说明书、资产管理合同、其他备查文件、相关报告、相关公告等有关集合计划的信息，将在集合计划管理人网站上披露，投资者可随时查阅。</p> <p>管理人网址：htamc.htsc.com.cn</p> <p>2、管理人、其他销售机构指定营业网点查询</p> <p>本计划说明书、资产管理合同、其他备查文件、相关报告等文本存放在集合计划管理人和集合计划其他销售机构的住所，投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，集合计划管理人和集合计划托管人保证其内容与所披露的内容完全一致。</p> <p>3、华泰证券资产管理客服电话</p> <p>本集合计划披露的有关集合计划的信息，投资者可以通过华泰证券资产管理客服电话（4008895597）查询。</p>	
集合计划展期	是否可以展期	本集合计划可以展期。
终止和清算		<p>(一) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <p>1、资产管理计划存续期届满且不展期；</p> <p>2、经全体投资者、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承接；</p> <p>5、持续五个工作日投资者少于2人的；</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、战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；</p> <p>8、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情形。</p> <p>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6项约定的情形除外。</p>

	<p>(二) 集合计划的清算</p> <p>1、集合计划的清算小组</p> <p>(1) 自集合计划终止之日起五个工作日内成立清算小组，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。</p> <p>(2) 集合计划清算小组负责本集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划清算小组可以依法以集合计划的名义进行必要的民事活动。</p> <p>2、集合计划清算程序</p> <p>(1) 集合资产管理计划终止日后五个工作日管理人开始组织清算本集合计划财产；</p> <p>(2) 集合计划清算小组统一接管集合计划；</p> <p>(3) 对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；</p> <p>(4) 对集合计划财产进行估值和变现；</p> <p>(5) 制作清算报告；</p> <p>(6) 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计；</p> <p>(7) 对计划剩余财产进行分配和办理相关账户注销事宜；</p> <p>(8) 清算程序结束后五个工作日内，清算结果报证券投资基金业协会备案。</p> <p>3、清算费用</p> <p>清算费用是指清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用（包括但不限于审计费、诉讼费、仲裁费、律师费、财产保全费、公证费、拍卖费及其他形式的资产处置费等费用），清算费用由清算小组从集合计划财产中优先支付。</p> <p>4、集合计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用、税款及其他债务后，按份额持有人持有的份额比例进行分配。清算期间，管理人可以根据委托财产清算安排和投资者服务需要，对同一级别计划财产按份额持有人持有的份额比例进行分次做清算分配。</p> <p>对于本计划因证券交易等原因按登记结算机构规定缴纳的保证金（包括但不限于最低结算备付金和交易单元保证金）、以及保证金和存款账户的未结利息等资产，需要在登记结算机构退回保证金及利息结束后才能收回。管理人可选择在上述资产收回后或以管理人财产先行垫资方式，将剩余委托财产分配给投资者。本计划归属投资者所有的权益全部清算分配后，本计划自投资者款项划出日起至托管账户销户完成期间产生的孳息损益归属管理人享有承担。</p> <p>若本计划在终止之日因委托财产流动性受限等原因需要延期清算的，管理人应及时向证券投资基金业协会报告，并通过管理人网站进行披露。</p> <p>对于本计划在终止之日流动性受限的委托财产，管理人将在对应委托财产恢复流通或交易后及时进行变现，扣除相关费用后按份额持有人持有的份额比例进行分配，清算期间变现的委托财产不得再进行投资。</p> <p>5、集合计划清算的公告</p> <p>管理人应当在集合计划清算程序终止后五个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案。管理人应将清算结果及清算过程中的有关重大事项及时在管理人网站披露。</p> <p>6、销户</p> <p>本计划终止后，按照委托财产变现清算情况，管理人和托管人应按监管要求和相关机构规定及时注销各类证券投资交易账户（如有，包括但不限于银行间市场交易账户、沪深市场股东账户、期货账户等），最后注销托管账户。</p> <p>7、集合计划财产清算账册及文件的保存</p> <p>集合计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。</p>
风险承担安排	委托人自行承担投资风险和损失
风险揭示	<p>本集合计划面临包括但不限于以下风险：</p> <p>(一) 一般风险揭示</p> <p>1、本金损失风险</p>

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（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

2、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：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、衍生品风险等。

3、管理风险

资产管理计划运作过程中，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。

4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

5、信用风险

交易对手方未能实现交易时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

6、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。

管理人的责任承担方式：

(1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

(2) 在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十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。

7、税收风险

资产管理计划所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

资产管理计划运营过程中需要缴纳增值税应税的，将由委托财产承担并从委托资产中支付，按照税务机关的规定以资产管理人为增值税纳税人履行纳税义务，因此可能增加资产委托人的投资税费成本。

8、合规风险

在资产管理计划管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者资产管理计划投资范围、投资比例等违反法规及集合资产管理合同有关规定的风险。管理人可能因此被监管机构采取监管措施或被责令调整资产管理计划投资范围及比例，从而影响资产管理计划的具体运作和投资收益。

9、无法履约风险

管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

10、关联交易风险

根据本合同的约定，本计划管理人可以将本计划资产投资于管理人、托管人及其控股股东、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，或从事其他类型的关联交易，可能存在一定的风险。

11、适当性相关风险

(1) 委托人有义务保证其提供的相关信息及材料真实、准确、完整。管理人及销售机构（如有）评定委托人的风险承受能力、作出适当性匹配意见系基于委托人提供的相关信息及证明材料真实、准确、完整的前提下作出；如委托人提供的信息及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，可能会导致委托人的风险承受能力评定、适当性匹配意见存在偏差、与实际不符的风险，管理人及销售机构（如有）有权拒绝为委托人提供服务或拒绝接受委托人的交易申请、业务申请，相关风险、责任、损失由委托人自行承担。

管理人及销售机构（如有）禁止其工作人员为影响评估结果在投资者填写基本信息表、风险承受能力评估问卷时进行提示、暗示、诱导。委托人知晓管理人及销售机构（如有）工作人员存在前述行为，仍遵照配合致使所提供的信息及材料不真实、不准确、不完整，或存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏等情形的，视为委托人违反其应履行的适当性义务，委托人应承担由此产生的后果、损失、责任。

(2) 委托人在其信息发生重要变化、可能影响管理人及销售机构(如有)对其作出的投资者类别划分、风险承受能力认定时,应主动告知管理人及销售机构(如有),以便管理人及销售机构(如有)作出调整。若委托人未能及时有效告知管理人及销售机构(如有),则存在适当性匹配意见与实际不符的风险,进而可能产生应由委托人自行承担的相应风险、责任、损失。

(3) 委托人或产品的信息发生变化时,管理人及销售机构(如有)有权主动调整委托人的投资者分类、产品的风险等级以及适当性匹配意见。管理人及销售机构(如有)作出主动调整的,委托人的交易或者购买产品的资格可能受到影响,进而产生相应的风险。

12、其他风险

包括但不限于:

(1) 技术风险。在本集合计划的日常交易中,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投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自本集合计划管理人、托管人、证券交易所以及证券注册登记机构等。

(2) 操作风险。本集合计划管理人、托管人、证券交易所以及证券注册登记机构等在业务操作过程中,因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

(3) 因制度建设、人员配备以及内控制度建立等方面不完善而产生的风险。

(4) 因人为因素而产生的风险、如内幕交易以及欺诈行为等产生的风险。

(5) 对主要业务人员如投资经理的依赖而可能产生的风险。

(6) 因业务竞争压力可能产生的风险。

(7) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致委托资产的损失,从而带来风险。

(8) 其他意外导致的风险。

(二) 特殊风险揭示

1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本资产管理计划因投资或其他特殊需要,证券投资基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》(以下简称《集合指引(试行)》)部分具体要求对本资产管理计划投资者不适用,可能存在资产管理合同部分条款与《集合指引(试行)》不一致的情况。

2、资产管理计划份额转让所涉风险;

本资产管理计划份额允许通过证券交易所以及中国证监会认可的交易平台依法转让,存在因转让场所规则限制、投资者持有份额被司法冻结、投资者未满足资产管理合同最低参与金额要求或其他不可抗力的因素等造成的转让失败风险。

3、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险;

本资产管理计划成立后需在基金业协会进行备案。除非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外,本计划在完成基金业协会备案前不得开展投资活动。

因此,即使本资管计划成立,并不意味着本计划必然能获得基金业协会的备案。而该等备案过程可能会受到相应监管政策的影响,包括备案时间所需时间、能否通过备案都存在一定的不确定性。如果在计划成立后不能及时完成备案,将可能导致本计划错过市场行情或投资机会;如果本计划在成立后无法获得基金业协会的备案,则将直接影响本计划设立目的的实现。当出现无法通过基金业协会备案的情形,资产管理人将有权决定提前终止本计划,由此直接影响委托人参与本计划的投资目的。

4、采用电子签名合同管理方式所带来的风险

本集合计划采用电子签名方式进行集合计划资产管理合同的签署、核对、收集、整理和保管,在运用电子签名方式进行集合计划合同管理过程中,由于系统故障、人员操作失误、相关机构之间衔接不畅等原因,可能导致投资者参与申请无法及时确认、投资者资料信息错误、投资者无法查询交易信息等情形,从而导致风险。

5、自有资金参与退出风险

鉴于本集合计划管理人在存续期自有资金的参与可能造成投资者收益稀释或者由于自有资金退出致使管理人被动变现集合计划资产导致集合计划净值受损,从而产生自有资金参与退出风险。为此,管理人提请投资者注意该风险。

6、其他特殊风险。

	<p>(1) FOF 产品管理模式特有风险</p> <p>各类不同资产及投资策略在不同的市场环境下表现不同,管理人根据资产配置模型进行大类资产配置,并筛选市场上各个策略的投资策略资产进行投资。各个策略资产的表现可能高于预期,也可能低于预期;可能由于管理人对策略资金分配不当,导致集合计划资产亏损。反之,也可能出现管理人资金分配合理,但由于具体策略的投资管理人投资管理能力不佳造成的资产亏损。</p> <p>(2) 投资金融产品的风险</p> <p>本集合计划部分资产将配置于金融监管部门批准或备案发行的金融产品(包括证券投资基金、基金管理公司特定多个客户资产管理计划、期货公司集合资产管理计划、基金管理公司子公司特定多个客户资产管理计划、经备案的投资于证券市场的契约型私募基金及法律法规允许的其他金融产品等),投资上述金融产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响,请委托人知悉。</p> <p>1) 金融产品管理人风险</p> <p>金融产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险是指因管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内控等因素导致公司经营不善,极端情况下甚至破产倒闭,可能对其管理人的产品业绩造成不利影响。另外,对于约定了止损条款的金融产品,可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。</p> <p>2) 金融产品投资风险</p> <p>本集合计划所投资的金融产品可能由于其管理人对市场判断失误、买入标的市场表现不佳、风险控制失效等原因造成产品净值的下降,从而造成集合计划净值下降,最终导致集合计划委托人资产损失;</p> <p>3) 策略模型风险</p> <p>在实际运作中,因金融产品的投资经理变更导致模型无法有效运作,开发的策略或模型不再有效或者在运作过程中与产品期初投资策略和投资风格发生偏离,进而影响产品投资业绩。</p> <p>4) 赎回金融产品面临的流动性风险</p> <p>因本计划委托人赎回或资产配置调整需要,管理人赎回金融产品时,可能触发所投资的金融产品大额赎回或巨额赎回条款,或所投资的金融产品处在封闭期,导致赎回资金延迟到账的风险。</p> <p>5) 投资金融产品可能面临双层收费的风险</p> <p>本集合计划委托人需要承担双层费用,即集合计划费用及集合计划所投资的金融产品自身需要承担费用。集合计划所投资的金融产品自身需要承担费用包括金融产品的管理费、托管费、业绩报酬(如有)、认购费(如有)、赎回费(如有)等,以上费用在计提时将会扣减金融产品的资产净值,从而造成集合计划净值下降。</p> <p>6) 投资金融产品的估值风险</p> <p>本集合计划的投资多个底层金融产品,每个金融产品的估值时间可能不一致,且披露时间可能不一致,本集合计划按照金融产品估值日最近的份额净值进行估值。在存续期间,集合计划份额净值可能无法反映真实投资管理情况。</p> <p>此外,为消除底层金融产品计提业绩报酬对本计划资产净值的影响,本计划在估值方法上已采取适当的措施与安排,但仍不排除在本计划的封闭期内,由于无法在每个估值日及时准确获取金融产品预估业绩报酬或扣除预估业绩报酬后的净值,导致封闭期披露的集合计划份额净值未充分体现底层金融产品计提业绩报酬的影响,当底层金融产品发生业绩报酬提取或在本计划开放日发生管理人根据金融产品约定的业绩报酬计提方法预估业绩报酬并调整本计划份额净值的情形时,可能造成集合计划份额净值波动的风险。</p> <p>7) 底层金融产品提取业绩报酬对产品净值造成下跌的风险</p> <p>由于本计划投资多个金融产品,每个金融产品在业绩报酬计提方式、业绩报酬计提时间以及产品估值时间与本集合计划层面可能不一致,当底层金融产品提取业绩报酬后造成集合计划净值下降、委托人持有集合计划份额期间收益下降的风险。</p>
特别 说明	<ul style="list-style-type: none"> ● 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。如有与《管理合同》不一致的,以《管理合同》为准。