

东方红-量化4号集合资产管理计划说明书

2014年3月

特别提示:

本说明书依据《证券公司客户资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(以下简称《实施细则》)、《东方红-量化4号集合资产管理合同》(以下简称《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。本说明书对集合计划未来的收益预测仅供委托人参考,不构成管理人、托管人和推广机构保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

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《管理办法》、《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	东方红-量化4号集合资产管理计划														
	目标规模	本集合计划推广期规模上限为50亿份(不含参与资金利息转增份额,下同),存续期不设规模上限。														
	管理期限	本集合计划不设固定存续期限。														
	推广期	本集合计划的具体推广期以管理人的推广公告为准。														
	封闭期	本集合计划成立后前三个月为封闭期,封闭期内不办理参与、退出业务。														
	开放期	本集合计划成立后前三个月为封闭期,封闭期结束后每个工作日开放,委托人可在开放日参与和退出集合计划。														
	份额面值	人民币1.00元。														
	最低金额	单个委托人首次参与本集合计划的最低参与金额为100万元人民币(含参与费,下同),追加参与的最低金额为人民币1万元。														
	相关费率	<p>1、认购/申购费(参与费):按认购/申购金额采用比例费率,投资者在一天之内如果有多笔认购/申购,适用费率按单笔分别计算。认购/申购费直接从认购/申购金额中扣除,不计入委托人认购/申购份额,不列入集合计划资产。</p> <table border="1" data-bbox="391 1288 1173 1478"> <thead> <tr> <th>认购/申购金额(M)</th> <th>适用认购/申购费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>M<500万</td> <td>1%</td> </tr> <tr> <td>M≥500万</td> <td>1000元/笔</td> </tr> </tbody> </table> <p>2、托管费:0.25%/年</p> <p>3、退出费/赎回费:委托人申请退出本集合计划时须按退出份额的持有期限缴纳退出费,退出费全部归入集合计划资产。具体退出费率如下:</p> <table border="1" data-bbox="391 1601 1173 1848"> <thead> <tr> <th>份额存续时间(L)</th> <th>适用赎回费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>L<7个自然日</td> <td>1.5%</td> </tr> <tr> <td>7个自然日≤L<30个自然日</td> <td>0.75%</td> </tr> <tr> <td>30个自然日≤L<365个自然日</td> <td>0.5%</td> </tr> </tbody> </table>		认购/申购金额(M)	适用认购/申购费率	M<500万	1%	M≥500万	1000元/笔	份额存续时间(L)	适用赎回费率	L<7个自然日	1.5%	7个自然日≤L<30个自然日	0.75%	30个自然日≤L<365个自然日
认购/申购金额(M)	适用认购/申购费率															
M<500万	1%															
M≥500万	1000元/笔															
份额存续时间(L)	适用赎回费率															
L<7个自然日	1.5%															
7个自然日≤L<30个自然日	0.75%															
30个自然日≤L<365个自然日	0.5%															

365个自然日≤L<730个自然日	0.3%
L≥730个自然日	0

4、管理费：1%/年
5、业绩报酬：上述费用、及其他费用的详细情况详见合同第十三部分“集合计划的费用、业绩报酬”的相关约定。

投资范围

1、投资范围
本集合计划的投资范围包括国内依法发行的股票、债券、证券投资基金、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债期货、股指期货、商品期货等证券期货交易所交易的投资品种以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可以参与融资融券交易，也可以将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司。本集合计划可以参与股票质押式回购业务，集合资产管理计划为融出方的，在股票质押回购中质权人登记为管理人。
本集合计划如需投资利率远期、利率互换、股权质押式回购、融资融券、国债期货、商品期货，需与托管人就账户开立、资金划付及保管、估值核算等事项协商并达成一致意见后方可投资。

2、资产配置比例
(1) 固定收益类资产：债券逆回购（期限大于7天）、政府债券（到期日在1年以上）、央行票据（到期日在1年以上）、公司债、企业债、可转换债券、可分离交易债券、短期融资券、中期票据、政策性金融债、债券型基金、资产支持证券、中期票据、中小企业私募债（限于有担保或者国有控股企业发行的中小企业私募债）、股票型及混合型分级基金的优先级份额、股票质押式回购业务、资产支持票据、非公开定向债务融资工具、利率远期、利率互换等银行间市场交易的投资品种等。占集合计划资产净值的0~140%。
(2) 权益类资产：股票、股票型基金、混合型基金等，占集合计划资产净值的0~100%。
(3) 现金类资产：包括现金、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、期限为7天内(含7天)的债券逆回购、到期日在1年内(含1年)的政府债券、到期日在1年内(含1年)的央行票据等高流动性短期金融产品等，占集合计划资产净值的0~140%。
(4) 衍生金融工具：包括权证、股指期货、商品期货、国债期货等。集合计划投资股指期货的，在任何交易日日终持有的权益类证券（包括股票、股票型和混合型基金）市值和买入股指期货合约价值总额扣除卖出股指期货合约价值总额的合计不超过资产净值的120%。在任何交易日日终，集合计划买入、卖出国债期货合约价值轧差计算后不超过资产净值的120%；集合计划投资股指期货和/或国债期货的，在任何交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约占用的交易保证金后，现金及到期日在一年以内的政府债券占集合资产管理计划资产净值不低于5%。
(5) 集合计划可以参与证券回购，但融入资金余额不得超过集合计划资产净值的40%。
管理人应按照《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引》及其他相关监管规定及监管机构要求做好相关准备后，方可按照本合同的约定参与国债期货，管理人投资国债期货无须另行征求委托人意见。委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产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或与管理人有关关联方关系的公司承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。管理人应当遵循客户利益优先原则，交易完成5个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所报告。
如因一级市场申购或大宗交易发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起十个工作日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、投资对象合并、计划规模变动等管理人之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的十个工作日内将投资比例降至许可范围内，法律法规另有规定时，从其规定。
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。

	风险收益特征	本集合计划属风险和期望收益中等的产品。
	适合推广对象	<p>面向合格投资者推广，合格投资者累计不得超过 200 人。合格投资者是指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力且符合下列条件之一的单位和个人：</p> <p>1、个人或者家庭金融资产合计不低于 100 万元人民币；</p> <p>2、公司、企业等机构净资产不低于 1000 万元人民币。</p> <p>依法设立并受监管的各类集合投资产品视为单一合格投资者。</p> <p>委托人在此申明签署合同即表明委托人为已具备《证券公司客户资产管理业务管理办法》规定要求的合格投资者。</p>
当 事 人	管 理 人	<p>机构名称：上海东方证券资产管理有限公司</p> <p>法定代表人：王国斌</p> <p>通信地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层</p> <p>邮政编码：200010</p> <p>联系电话：021-63325888</p>
	托 管 人	<p>机构名称：中国工商银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号</p> <p>法定代表人：姜建清</p> <p>联系人：赵会军</p> <p>联系方式：010-66105799</p>
	推广机构	<p>1、上海东方证券资产管理有限公司</p> <p>住所：上海市中山南路 318 号</p> <p>法定代表人：王国斌</p> <p>2、东方证券股份有限公司（以下简称“东方证券”）</p> <p>住所：上海市中山南路 318 号</p> <p>法定代表人：潘鑫军</p> <p>3、中国工商银行股份有限公司</p> <p>住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号</p> <p>法定代表人：姜建清</p>
集 合 计 划 的 参 与	办理时间	<p>（1）推广期参与</p> <p>在推广期内，投资者在工作日内可以参与本集合计划。本集合计划的具体推广期以管理人的推广公告为准。管理人可根据集合计划销售情况在募集期限内适当延长或缩短集合计划的发售时间，并及时公告。</p> <p>（2）存续期参与</p> <p>本集合计划成立后前三个月为封闭期，封闭期结束后每个工作日开放，委托人可在开放日参与集合计划。管理人可根据集合计划参与及投资运作情况暂停集合计划申购，并及时公告。</p>
	办理方式、程序	<p>1、投资者按推广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；</p> <p>2、投资者应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔参与申请；</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、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、投资者于 T 日提交参与申请后，可于 T+ 2 日后在办理参与的推广机构网点查询参与确认情况。</p>
	参与费	<p>1、认购/申购费（参与费）：按认购/申购金额采用比例费率，投资者在一天之内如果有多笔认购/申购，适用费率按单笔分别计算。认购/申购费直接从认购/申购金额中扣除，不计入委托人认购/申购份额，不列入集合计划资产。</p>

		<table border="1"> <tr> <th>认购/申购金额 (M)</th> <th>适用认购/申购费率</th> </tr> <tr> <td>M<500 万</td> <td>1%</td> </tr> <tr> <td>M≥500 万</td> <td>1000 元/笔</td> </tr> </table> <p>2、参与份额的计算方法</p> <p>(1) 推广期参与</p> <p>认购费 = 认购金额 × 认购费率</p> <p>净认购金额 = 认购金额 - 认购费 + 认购金额在推广期内产生的利息</p> <p>认购份额 = 净认购金额 ÷ 集合计划份额面值</p> <p>(2) 开放期参与</p> <p>申购费 = 申购金额 × 申购费率</p> <p>净申购金额 = 申购金额 - 申购费</p> <p>申购份额 = 净申购金额 ÷ 申购价格</p> <p>集合计划份额面值为 1.00 元。委托人多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。</p>	认购/申购金额 (M)	适用认购/申购费率	M<500 万	1%	M≥500 万	1000 元/笔					
认购/申购金额 (M)	适用认购/申购费率												
M<500 万	1%												
M≥500 万	1000 元/笔												
	认购资金利息	委托人的参与资金在推广期产生的利息将折算为计划份额归委托人所有，参与资金的利息以注册登记机构的记录结果为准。											
集 合 计 划 的 退 出	办理时间	<p>退出在开放期办理。</p> <p>如果本集合计划合同变更时，管理人可在管理人指定网站发布有关临时开放期的公告，允许委托人可在临时开放期退出集合计划。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。</p> <p>若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，管理人将视情况对前述退出办理的日期及时间进行相应的调整并公告。</p>											
	办理方式、程序	<p>1、退出申请的提出</p> <p>委托人可在原参与网点，在规定的开放期内办理退出申请，或登录原参与推广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>2、退出申请的确认</p> <p>当日 (T 日) 在交易时间内提交的申请，管理人及注册登记机构在收到委托人退出申请的 T+1 日对该交易的有效性进行确认，委托人通常可在 T+2 日到网点查询退出的确认情况。巨额退出、连续巨额退出的情形另行约定。</p> <p>3、退出款项划付</p> <p>委托人的退出申请确认后，退出款项将在 T+2 日内从托管账户划出。如集合计划出现本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。</p>											
	退出费	<p>1、退出费/赎回费率：</p> <p>委托人申请退出本集合计划时须按退出份额的持有期限缴纳退出费，退出费全部归入集合计划资产。具体退出费率如下：</p> <table border="1"> <tr> <th>份额存续时间 (L)</th> <th>适用赎回费率</th> </tr> <tr> <td>L<7 个自然日</td> <td>1.5%</td> </tr> <tr> <td>7 个自然日 ≤ L<30 个自然日</td> <td>0.75%</td> </tr> <tr> <td>30 个自然日 ≤ L<365 个自然日</td> <td>0.5%</td> </tr> <tr> <td>365 个自然日 ≤ L<730 个自然日</td> <td>0.3%</td> </tr> <tr> <td>L ≥ 730 个自然日</td> <td>0</td> </tr> </table>	份额存续时间 (L)	适用赎回费率	L<7 个自然日	1.5%	7 个自然日 ≤ L<30 个自然日	0.75%	30 个自然日 ≤ L<365 个自然日	0.5%	365 个自然日 ≤ L<730 个自然日	0.3%	L ≥ 730 个自然日
份额存续时间 (L)	适用赎回费率												
L<7 个自然日	1.5%												
7 个自然日 ≤ L<30 个自然日	0.75%												
30 个自然日 ≤ L<365 个自然日	0.5%												
365 个自然日 ≤ L<730 个自然日	0.3%												
L ≥ 730 个自然日	0												

	<p>2、退出金额的计算公式</p> <p>退出金额为退出总额扣减退出费后的余额，计算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。</p> <p>退出总额=退出份额×单位净值-业绩报酬</p> <p>退出费=退出总额×退出费率</p> <p>退出金额=退出总额-退出费</p> <p>3、收取方式</p> <p>委托人退出申请被确认后，退出费按实际被确认的退出总额和退出费率为基准计算。退出费直接从退出总额中扣除。</p>
<p>单个委托人 大额退出及预 约申请</p>	<p>本集合计划不设单个委托人大额退出限制条款。</p>
<p>巨额退出（认 定标准、退出 顺序、退出价 格确定、退出 款项支付、告 知委托人的方 式）</p>	<p>1、巨额退出的认定</p> <p>单个开放日，委托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）超过上一工作日计划总份额数的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：</p> <p>全额退出：当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时，按正常退出程序办理。</p> <p>部分顺延退出：当管理人认为支付委托人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上一日总份额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，委托人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。</p> <p>3、告知客户的方式</p> <p>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。</p>
<p>连续巨额退出 （认定标准、 退出顺序、退 出价格确定、 退出款项支 付、告知委托 人的方式）</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。</p>
<p>管理人自有资金 参与情况</p>	<p>管理人以自有资金参与本集合计划的：</p> <p>1、自有资金参与的条件：</p> <p>在本集合计划推广期起始日至集合计划终止日内，管理人可以以自有资金参与本集合计划。</p> <p>在本集合计划存续期间，为应对集合计划巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人可以自有资金参与本集合计划，但需事后及时告知委托人和托管人，并向住所地中国证监会派出机构及中国证券业协会报告。</p> <p>管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《管理办法》、《细则》、《规范》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。</p> <p>2、自有资金参与的金额和比例：</p> <p>管理人自有资金持有本集合计划份额不超过集合计划总份额的20%。</p> <p>3、自有资金收益分配、责任承担方式和金额：</p> <p>管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也有承担与计划份额相对</p>

	<p>应损失的责任。</p> <p>4、自有资金退出的条件： 管理人自有资金参与部分在出现以下情况之一时，可以退出本集合计划： （1）管理人自有资金参与份额，满足参与时间不少于 6 个月条件时，可与其他委托人同样办理退出业务。 （2）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、法规及本合同规定比例。 （3）法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。</p> <p>5、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，参与、退出时应当提前 5 个工作日告知委托人和托管人。</p> <p>6、为应对巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，但需事后及时告知委托人和托管人。</p> <p>7、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时的处理原则及处理措施： 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的比例超过计划总份额的 20%时，管理人在具备参与、退出本计划条件之日起 10 个工作日内可以将自有资金比例降至许可范围内。</p> <p>8、风险揭示：管理人自有资金退出，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，控制风险。</p> <p>9、信息披露：管理人及时在管理人指定网站公告超限情况。</p>
<p>集合计划成立的条件、时间</p>	<p>集合计划的参与资金总额不低于 3000 万元人民币且其委托人的人数为 2 人（含）以上，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，管理人宣布本集合计划成立。</p> <p>集合计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入证券登记结算机构指定的专门账户，不得动用。</p>
<p>集合计划设立失败（本金及利息返还方式）</p>	<p>集合计划推广期结束，在集合计划规模低于人民币 3000 万元或委托人的人数少于 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，管理人承担集合计划的全部推广费用，并将已认购资金及同期利息（以注册登记机构的记录为准）在推广期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人，退还完毕各方互不承担其他责任。</p>
<p>集合计划份额转让</p>	<p>集合计划存续期间，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。</p>
<p>费用、报酬</p>	<p>费用种类（计提标准、方法、支付方式）</p> <p>（一）集合计划费用的种类</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人的管理费和业绩报酬； 2、托管人的托管费； 3、证券交易费用； 4、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用； 5、本集合计划成立后的会计师费和律师费； 6、证券账户开户费； 7、因集合计划资金划付支付的银行汇划费； 8、与集合计划缴纳税收有关的手续费、汇款费等。除法律法规另行规定外，管理人不对委托人承担的各类税负进行代扣代缴； 9、电子合同费、TA 服务费； 10、按照国家有关规定可以列入的其他费用。 <p>（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、托管费： <ol style="list-style-type: none"> （1）按资产净值的 0.25% 年费率计提。 （2）按前一日计划资产净值计算，按日计提，按季支付。在每个季度最后一个工作日收市后，由管理人向托管人发送集合计划托管费划付指令，托管人复核后于次季首日起 5 个工作日内从集合计划中支

		<p>付给托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。</p> <p>(3) 托管费计算方法如下： $C = i \times \text{年托管费率} \div \text{当年实际天数}$ 注：C 为每日应计提的托管费，i 为前一日的资产净值。</p> <p>2、管理费： (1) 按资产净值的 1% 年费率计提。 (2) 按前一日计划资产净值计算，按日计提，按季支付。在每个季度最后一个工作日收市后，由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，托管人复核后于次季首日起 5 个工作日内从集合计划中支付给管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。 (3) 管理费计算方法如下： $G = i \times \text{年管理费率} \div \text{当年实际天数}$ 注：G 为每日应计提的管理费，i 为前一日的资产净值。</p> <p>3、管理费和托管费的调整 管理人和托管人可协商调减管理费和托管费，并在新的费率开始实施前 3 个工作日在管理人指定网站公告。</p> <p>4、证券交易费用 集合计划投资运作期间发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，在收取时从集合计划中扣除。交易佣金的费率由管理人本着保护委托人利益的原则，按照法律法规的规定确定，本集合计划不设置最小佣金限制。</p> <p>5、集合计划成立后的信息披露费用、会计师费和律师费，以及按照国家有关规定可以列入的其他费用。由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。并由托管人根据法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期计划费用。</p>			
	不由集合计划承担的费用	<p>计划推广期发生的信息披露费、会计师费、律师费等相关费用，不得列入计划费用。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或计划资产的损失，以及处理与计划运作无关事项发生的费用等不列入计划费用。</p>			
	业绩报酬	<p>1、管理人收取业绩报酬的原则 (1) 按委托人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。 (2) 符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红日、委托人退出日和本集合计划终止日计提业绩报酬。 (3) 集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。在委托人退出和集合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>2、业绩报酬的计提方法 业绩报酬计提日为本集合计划分红日、委托人退出日或本集合计划终止日。以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与当日）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准。</p> $R = \frac{A - B}{C} \times \frac{360}{D} \times 100\%$ <p>A 为业绩报酬计提日的累计单位净值； B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值； C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值； D 为上一业绩报酬计提日与本次业绩报酬计提日间隔天数；</p> <table border="1" data-bbox="443 1937 1396 2004"> <tr> <td data-bbox="443 1937 686 2004">年化收益率 (R)</td> <td data-bbox="686 1937 853 2004">计提比例</td> <td data-bbox="853 1937 1396 2004">业绩报酬 (H) 计算方法</td> </tr> </table>	年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法
年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法			

		<table border="1"> <tr> <td>$R \leq 10\%$</td> <td>0</td> <td>$H = 0$</td> </tr> <tr> <td>$R > 10\%$</td> <td>30%</td> <td>$H = (R - 10\%) \times 30\% \times C \times F \times \frac{D}{360}$</td> </tr> </table> <p>注：F 为提取业绩报酬的份额。</p> <p>管理人在集合计划分红日计提业绩报酬的，可减免部分按照上述方式计算的业绩报酬或保留部分业绩报酬留待以后提取。具体业绩报酬计提金额以管理人公告或对账单为准。</p> <p>3、业绩报酬支付</p> <p>由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于 5 个工作日内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。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</p> <p>管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。</p>	$R \leq 10\%$	0	$H = 0$	$R > 10\%$	30%	$H = (R - 10\%) \times 30\% \times C \times F \times \frac{D}{360}$
$R \leq 10\%$	0	$H = 0$						
$R > 10\%$	30%	$H = (R - 10\%) \times 30\% \times C \times F \times \frac{D}{360}$						
收益分配	收益构成	<p>收益包括：集合计划投资证券所得红利、股息、债券利息、基金红利、买卖证券差价、银行存款利息以及其他合法收入。</p> <p>计划净收益是计划收益扣除按国家有关规定可以在计划收益中提取的有关费用等项目后得出的余额。期末可供分配利润指截止收益分配基准日未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低者。</p>						
	分配原则	<p>1、收益采用现金分配或红利再投资方式，每位委托人获得的分红收益金额或再投资份额保留小数点后两位，第三位四舍五入。</p> <p>2、每一集合计划份额享有同等分配权。</p> <p>3、计划收益分配基准日的单位净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于初始面值。</p> <p>4、本集合计划的默认分红方式为现金分红，委托人可以选择现金分红或者红利再投资分红方式。选择采取现金分配的，管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令将收益分配款项划入注册登记机构，注册登记机构将收益分配款划入相应推广机构结算备付金账户，由推广机构划入委托人的交易账户，现金红利在 T+7 日内划转到委托人的交易账户；选择采取红利再投资方式的，分红资金按 T 日的单位净值转成相应的集合计划单位。</p> <p>5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担。</p> <p>6、法律法规另有规定的从其规定。</p>						
	分配方式	<p>本集合计划的默认分红方式为现金分红，委托人可以选择现金分红或者红利再投资分红方式。选择采取现金分配的，管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令将收益分配款项划入注册登记机构，注册登记机构将收益分配款划入相应推广机构结算备付金账户，由推广机构划入委托人的交易账户，现金红利在 T+7 日内划转到委托人的交易账户；选择采取红利再投资方式的，分红资金按 T 日的单位净值转成相应的集合计划单位。</p>						
	分配方案	<p>集合计划收益分配方案中将载明集合计划收益的范围、可供分配利润、收益分配对象、分配原则、权益登记日和除权除息日、红利发放日、分配数额及比例、分配方式等内容。</p> <p>集合计划收益分配方案由管理人拟定，经托管人复核后确定，并在确定之日起 3 个工作日内在管理人网站进行信息披露。</p>						
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、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格，而无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的；</p> <p>2、托管人因重大违法、违规行为，被监管机关取消业务许可，不能继续担任集合计划托管人，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的；</p> <p>3、管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，而无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的；</p> <p>4、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、</p>							

	<p>义务的；</p> <p>5、集合计划存续期间，本集合计划委托人少于 2 人；</p> <p>6、不可抗力发生导致本集合计划不能存续；</p> <p>7、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。</p> <p>(二) 集合计划的清算</p> <p>1、集合计划达到终止条件管理人应通知托管人准备进入清算程序。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，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；</p> <p>2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</p> <p>3、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、管理费及托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有集合计划相应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委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户；</p> <p>4、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；</p> <p>5、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，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在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有相应份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给委托人。</p>
<p>特别说明</p>	<p>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。</p>