

华林证券季季安鑫集合资产管理计划说明书

2022年9月 日

特别提示：

本说明书依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》等法律、行政法规和中国证监会、中国证券投资基金业协会的有关规定、自律规则，和《华林证券季季安鑫集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》或合同）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。

投资者承诺已充分理解《资产管理合同》条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应就资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

管理人承按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，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。

《资产管理合同》是约定合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者的认购或申购集合计划份额的行为本身即表明其对《资产管理合同》及本说明书的承认和接受。投资者将按照《管理办法》、《运作规定》、《资产管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

基本情况	名称	华林证券季季安鑫集合资产管理计划
	类型	固定收益类集合资产管理计划
	运作方式	开放式
	投资目标	本计划以固定收益类品种为主要投资对象，以资产安全性为前提，通过科学合理的资产配置、期限判断与信用分析，为投资者谋求稳定的投资回报。
	推广期	本集合计划将自推广开始之日起60日内完成集合计划的推广、设立活动，具体时间见管理人公告。
	封闭期	本集合计划存续期内除开放期外为封闭期，在每个封闭期内封闭运作，封闭期内原则上不办理集合计划的参与和退出业务（管理人公告临时开放的情况除外）。
	开放期	本集合计划成立后，每个自然周的周三开放，每个开放日可办理份额申购业务以及锁定期满的份额赎回业务。若开放期遇法定节假日、非工作日，则当日不开放，且开放期不顺延。 委托人每笔资金自参与日（含）（初始募集期认购的为本计划成立日，存续期申购及红利再投资参与的为份额参与申请日）起需锁定90天，委托人可于锁定期满90天的自然周对日申请退出集合计划，若该日为非开放日，则委托人可于此后任一个开放日申请退出集合计划。退出申请的持有期限未满足90天时，该笔退出申请无效，管理人将不予确认（投资者部分退出后的份额资产净值少于30万元，导致全部剩余份额强制退出；或由于投资者不同意合同变更，通过临时开放期一次性退出其持有的全部份额等存在强制退出的情况除外）。 管理人可以根据业务实际情况，设置临时开放期。管理人应提前至少1个工作日在管理人网站公告具体安排。
主要投资方向	（1）银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债券类资产，包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债、资产支持证券优先级（ABS），债券正回购、债券逆回购，债券借贷，国债期货等； （2）公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）（如货币基金、债券型基金、股票基金、混合基金、ETF基金、LOF基金、分级基金、权益类QDII基金等）。	
风险等级及适合推广对	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，本计划的产品风险等级为R3（中风险），适合合格投资者中的【专业投资者	

	象	和风险承受能力评估结果为 C3、C4、C5（稳健型、积极性、激进型）的普通投资者，具体以销售机构确认的风险等级为准。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。
	存续期	本计划存续期限为自成立之日起【10】年，存续期限届满可展期。 根据合同约定，本计划可提前终止。
	初始募集面值	每份 1.00 元
	最低、最高初始募集规模	本计划的最低初始募集规模为 1000 万元
	参与的最低金额	首次参与的最低金额为人民币 30 万元（不含参与费用）。
	注册登记服务机构	华林证券股份有限公司
当事人的概括	管理人概况	机构名称：华林证券股份有限公司 住址：拉萨市柳梧新区国际总部城 3 幢 1 单元 5-5 通讯地址：深圳市南山区粤海街道深南大道 9668 号华润置地大厦 C 座 32 层 法定代表人：林立 邮政编码：518000 联系电话：0755-80707888
	托管人概况	机构名称：宁波银行股份有限公司 住址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号宁波银行大厦 通讯地址：浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号宁波银行大厦 法定代表人：陆华裕 邮政编码：315100 联系电话：0755-22661998
	投资顾问	无
集合计划的投资	投资范围	（1）银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债券类资产，包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债、资产支持证券优先级（ABS），债券正回购、债券逆回购，债券借贷，国债期货等； （2）公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）（如货币基金、债券型基金、股票基金、混合基金、ETF 基金、LOF 基金、分级基金、权益类 QDII 基金等）。 特别提示：本计划投资范围包含债券回购，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。
	投资比例	（1）本计划投资于存款、债券等债权类资产（包括货币基金、债券型基金）的比例不低于资产管理计划总资产的 80%。为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。 （2）本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。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。单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算。

	<p>(3) 本计划债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过其上一日净资产 100%。</p> <p>(4) 本计划参与证券回购融入资金余额不得超过本计划资产净值的 100%，本计划总资产不得超过计划净资产的 200%。</p> <p>(5) 本计划投资于国债期货的合约价值不超过计划总资产的 20%，且不超过本计划持有债券类资产总市值的 100%。</p> <p>(6) 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该资产管理计划资产净值的 20%。</p> <p>(7) 本计划开放退出期内，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 10%。</p> <p>管理人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>
投资策略	<p>本集合计划在投资策略上充分发挥管理人在资产配置方面的特长，根据不同的市场行情调整债券投资策略，以期能为投资者创造长期稳健的投资回报。通过对投资债券、回购做出规划（包括债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排等），综合运用期限结构管理策略、久期管理策略、信用债策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理；同时跟踪市场行情，及时调整策略，在做好风险控制的同时，获取组合收益。</p> <p>(1) 债券组合投资策略</p> <p>通过全面研究 GDP、物价等主要经济变量，分析宏观经济运行的可能情景，并预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，预测利率水平变动趋势以及收益率曲线形状变化趋势。在定性分析的基础上，结合定量分析工具以确定组合的久期及期限结构管理策略。</p> <p>a) 久期策略</p> <p>分析未来较长一段时间市场利率的变化趋势，当预期市场利率将上升，导致中长债持有期收益低于短期债券或者货币市场工具收益时，降低债券组合久期；而当预期利率水平稳定或者下降，导致中长期债券持有收益高于短期债券和货币市场工具收益时，上调债券组合久期。</p> <p>b) 期限结构管理策略</p> <p>在确定组合久期的基础上，本集合计划针对收益率曲线形态变化确定合理的组合期限结构，在长期、中期和短期债券间进行动态调整。一般而言，在预期收益率曲线变陡、变平、不变或平行移动时，分别采用子弹策略、哑铃策略和梯形策略。</p> <p>c) 信用债投资策略</p> <p>通过研究市场整体信用风险趋势，结合信用债券的供需情况以及替代资产相对吸引力，分析信用利差趋势，并结合利率风险，确定组合的信用债投资比例，然后依据信用风险和流动性风险进行个券选择。根据经济运行周期阶段，分析发行主体所处行业发展前景、财务状况、债务水平等因素，评价发行人的信用风险，并根据发行条款，分析债券的信用级别。根据债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度，结合其期限、信用等级、流动性等因素，确定其相对投资价值，在相似的信用风险下，选择具有相对价值的品种进行投资。</p> <p>(2) 可转债投资策略</p> <p>可转债不同于一般的企业债券，其投资人具有在一定条件下转股、回售的权利，因此其理论价值等于作为普通债券的基础价值加上可转债内含选择权的价值。本集合计划投资于可转债，主要目标是在控制本集合计划净值下行风险的同时，分享股票升值的收益潜力。可转换债券的价值主要取决于其债券价值和转股权价值，本集合计划将对可转换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券。</p> <p>通过对发行公司的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等，并参考同类公司的估值水平，判断可转换债券的股权投资价值；基于对利率水平、票息率、派息频率及信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用国外成熟的量化分析定价模型，估算</p>

		<p>可转换债券的转股权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。</p> <p>此外，本计划还将根据新发可转债的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转债新券的申购。</p>
	<p>投资限制和投资禁止</p>	<p>1、投资限制</p> <p>(1) 投资于信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别；</p> <p>(2) 资产支持证券（ABS）及资产支持票据（ABN）仅限于投资优先级，投资份额评级为 AA（含）以上；</p> <p>(3) 投资于同业存单的主体评级不得低于 AA 级；</p> <p>(4) 本计划参与债券等证券发行申购时，所申购的金额不得超过集合计划资产总值，所申购的数量不得超过发行公司本次发行的总量；</p> <p>(5) 相关法律法规、国家政策和本合同约定限制从事的其他投资。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>本集合计划的禁止行为包括：</p> <p>(1) 不得直接投资商业银行信贷资产。</p> <p>(2) 不得违规为地方政府及其部门提供融资。</p> <p>(3) 不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保。</p> <p>(4) 不得利用资产管理计划从事内幕交易、操纵市场或者其他不当、违法的证券期货业务活动。</p> <p>(5) 不得从事非公平交易、利益输送等损害投资者合法权益的行为。</p> <p>(6) 不得侵占、挪用资产管理计划财产。</p> <p>(7) 不得以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用资产管理计划财产进行不必要的交易。</p> <p>(8) 不得直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域。</p> <p>(9) 不得直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：</p> <p>投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录；</p> <p>投资项目违反国家环境保护政策要求；</p> <p>通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。</p> <p>(10) 所投资资产支持证券基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权；</p>
	<p>风险揭示</p>	<p>见风险揭示书</p>
<p>收益分配和风险控制安排</p>	<p>收益分配</p>	<p>(一) 收益的构成</p> <p>本集合计划收益指集合计划利息收入、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，集合计划已实现收益指集合计划收益减去公允价值变动收益后的余额。</p> <p>(二) 收益分配原则</p> <p>1、集合计划在分红、退出、终止时按本合同约定分配计划份额收益。</p> <p>2、每份集合计划份额享有同等分配权（因管理人业绩报酬的存在，每份份额集合计划实际得到的分红金额可能有所不同）</p> <p>3、本合同中关于“利益”、“收益”的表述，并不意味着管理人保证委托人取得相应数额的利益，不意味着管理人保证集合计划资金不受损失。</p> <p>(三) 收益分配方案的确定与披露：</p> <p>在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，收益在计划存续期内每年最多分配 2 次。</p> <p>本集合计划收益分配方案由管理人拟定，包括集合计划收益的范围、集合计划净收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，由托管人核实后确定，并在确定之日起 3 个工作日内由管理人以至少一种指定方式进行信息披露。</p> <p>(四) 收益分配方式</p> <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。</p>

		<p>委托人同意遵守登记结算机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制定的规则）。管理人分红时以登记结算机构登记的分红方式为准。</p> <p>委托人选择红利再投分红方式的，分红资金在扣减管理人业绩报酬（若有）后，按分红除权日的集合计划每份净值转成本集合计划份额，免收参与费（红利再投资不受本计划份额上限的限制）。集合计划份额计算保留到小数点后两位，以后的部分采用去尾法，由此产生差额计入集合计划资产的损益。</p> <p>（五）收益分配的执行方式</p> <p>在收益分配方案公布后，管理人依据具体方案的规定就支付的现金收益向托管人发送划款指令，托管人按照管理人的指令及时将现金收益划付至管理人账户。</p> <p>托管人仅依据合同约定及管理人指令，对收益分配方案中的收益范围、分配方式、分配金额等要素进行核对。若划至管理人账户，托管人对于收益分配方案的复核内容仅限于对收益分配的总金额进行复核，对于在不同投资者之间分配的金额、分配顺序不承担复核义务，托管人不对向受益人划转资金本息的及时性、准确性负责。</p> <p>收益分配时，如有银行转账或其他手续费的，由投资者自行承担。</p>
	风险承担	投资者自行承担投资风险和损失
集合计划的费用	费用种类	<ol style="list-style-type: none"> 1、管理人的管理费及业绩报酬； 2、托管人的托管费； 3、证券交易费用； 4、证券账户开户费； 5、本集合计划成立后的信息披露费用； 6、本集合计划成立后的会计师费、审计费和律师费； 7、因集合计划资金划付支付的银行汇划费； 8、集合计划运营过程中发生的增值税及附加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，管理人和托管人不对投资者承担的各类税负进行代扣代缴； 9、清算费用； 10、按照国家有关规定可以列入的其他费用。
	管理费	<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【0.8%】。计算方法如下：</p> $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ <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>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，由托管人根据管理人出具的划款指令于次月首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。</p>
	托管费	<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【0.006%】。计算方法如下：</p> $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的集合计划托管费 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，由托管人根据管理人的划款指令于次月首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。</p>
	业绩报酬	<p>a、收取业绩报酬的原则</p> <p>集合计划存续期间，管理人主动提取业绩报酬，本集合计划仅在投资者退出日、本集合计划分红日和本集合计划终止日计提业绩报酬并于投资者退出日和本集合计划终止日后的 5 个工作日内支付业绩报酬。业绩报酬的提取频率不得超过每 6 个月一次，因投资者退出资产管理计划，管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。</p>

b、业绩报酬的计提方法

本计划每期资产的业绩报酬计提基准为【4.5%】。原则上，集合计划存续期间，如管理人修改业绩报酬计提基准，需于每一个运作周期开始前5个工作日公告变更后的业绩报酬计提基准。如果投资人不认可变更后的业绩报酬计提基准，可以选择在最近的开放日申请退出。

管理人特别声明：此业绩报酬计提标准不是预期收益和保证收益率。投资者已知悉，资产管理合同所提及的业绩报酬计提标准仅是管理人计提业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人对委托财产收益状况的任何承诺或担保，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。

在本集合计划的分红权益登记日、投资者退出日和本集合计划终止日，将根据投资者的期间年化收益率（R），对其超过当期业绩报酬计提基准的部分收取管理人业绩报酬。每一个投资者的期间年化收益率R的计算公式：

$$R = \frac{A - B}{C} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

A为本次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（不含）与本次业绩报酬计提日（含）之间的天数；

年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬（H）计算方法
R≤4.5%	0	H=0
R>4.5%	50%	H=（R-4.5%）×50%×C×F×D/365

注：F为提取业绩报酬的份额。

其他

1、证券交易费用

本集合计划投资运作期间所发生的经手费、证管费、过户费、印花税、交易单元费和证券结算风险基金等，直接计入投资成本或者作为当期费用，其费率由管理人根据有关政策法规确定。本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已经扣除风险金），并在发生投资交易时按每笔成交金额计提，在每季度首日起10个工作日内支付给提供交易单元的券商。

2、其他费用

- (1) 银行结算费用、银行账户维护费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。
- (2) 银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在发生时一次性计入本集合计划费用。
- (3) 开户费、银行间交易相关维护费用、转托管费用、注册登记相关费用（包括但不限于服务月费、登记结算费、年度电子合同服务费等）等集合计划运营过程中发生的相关费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。
- (4) 在本集合计划存续期间发生的、与集合计划相关的审计费（按与会计师事务所签定协议所规定的金额）、律师费（按与律师事务所签定协议所规定的金额，签订协议前需向投资者披露）、信息披露费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，在相应的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。
- (5) 在本集合计划清算过程中因处置未变现集合计划资产而产生的全部费用（包括但不限于诉讼费、仲裁费、律师费（按与律师事务所签定协议所规定的金额，签订协议前需向投资者披露）、公证费、拍卖费及其他形式的资产处置费等费用），在发生时可计入本集合计划费用。
- (6) 其他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，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。本合同项下的管理费、业绩报酬、托管费及其他管理人或托管人收取的各类费用均为包含增值税的含税价。

3、清算费用

本集合计划进入清算程序后，管理人和托管人应当在扣除清算费用（包括但不限于审计费、银行汇划费）、管理费、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。
	不列入本计划费用的项目	集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与销售有关的费用，不得在集合计划资产中列支。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得列入集合计划费用。
投资者承担的参与、退出费用和费率	认购费	无
	参与费	无
	退出费	无
投资者的权利和义务	投资者的权利	<p>投资者的权利包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、分享资产管理计划财产收益； 2、取得分配清算后的剩余资产管理计划财产； 3、按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额； 4、根据本合同的规定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会，行使相关职权（如有）； 5、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； 6、监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况； 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。
	投资者的义务	<p>投资者的义务包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、认真阅读并遵守资产管理合同，保证委托资金的来源及用途合法； 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； 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； 4、认真阅读并签署风险揭示书； 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； 6、在持有的集合计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任； 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； 8、不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为； 9、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； 10、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； 11、如投资者资金来源为募集资金，投资者保证委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；如相关监管机构或自律组织要求管理人提供本计划向上穿透后的投资者信息资料标的，投资者应配合提供；投资者承诺投资本计划后不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本计划从事规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道业务等违法违规行为； 12、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、

	<p>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>13、投资者转让本合同中的权利和义务和集合计划份额应事先取得管理人的同意，不得违规转让其所拥有的集合计划份额（法律法规另有规定的除外）；</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理合同约定的其他义务。</p>
<p>信息披露的内容、方式、频率</p>	<p>（一）信息披露的种类及内容</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、集合计划合同、计划说明书和风险揭示书 2、集合计划净值 3、集合计划定期报告，包括季度报告和年度报告 4、集合计划临时报告 5、清算报告 <p>（二）集合计划份额净值</p> <p>披露时间：本集合计划成立后的每个交易日披露集合计划份额净值、累计净值。</p> <p>披露方式：本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、《运作规定》、本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通过管理人网站公告形式向投资者披露，除非法律法规另有强制性规定，通过上述形式之一进行披露即视为管理人向投资者送达了相关信息披露事项的通知并履行了对投资者的信息披露义务。投资者可向管理人查询参与和退出的成交确认结果、打印成交确认单。</p> <p>（三）集合计划定期报告</p> <p>定期报告包括集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告和年度财务会计报告。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告 <p>管理人每季度向投资者提供一次准确、完整的管理季度报告，资产管理季度报告由管理人根据监管要求编制，经托管人复核财务数据后由管理人公告，并报相关监管机构或自律组织。托管人每季度向投资者提供一次季度托管报告。上述报告应由管理人于每季度截止日后1个月内通过管理人网站披露，同时报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会。</p> <ol style="list-style-type: none"> 2、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告 <p>管理人每年度向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告，资产管理年度报告由管理人根据监管要求编制，经托管人复核财务数据后由管理人公告，并报相关监管机构或自律组织等备案。托管人每年度向投资者提供一次托管报告。上述报告应由管理人于每年度截止日后4个月内通过管理人网站披露，同时报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会。集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月时，可以不编制当期的年度报告。集合计划的年度报告内容包括下列信息：</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（6）之外的其他信息，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。</p> <p>若中国证监会等监管机构对集合资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。</p> <ol style="list-style-type: none"> 3、年度财务会计报告 <p>集合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。</p>

	<p>(四) 集合计划临时报告</p> <p>集合计划存续期间, 发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事项, 管理人应当在事项发生之日起五个工作日内及时通过管理人网站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, 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;</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支付;</p> <p>(4) 集合计划终止和清算;</p> <p>(5) 管理人以自有资金参与和退出;</p> <p>(6) 合同的补充、修改与变更;</p> <p>(7) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项;</p> <p>(8) 负责本集合计划的代理销售机构发生变更;</p> <p>(9) 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>(10) 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>(11) 集合计划收益分配;</p> <p>(12) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更;</p> <p>(13) 其他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, 以及根据法律法规及本合同约定应当披露的情形。</p> <p>以上事项应在发生之日起五个工作日内按监管要求向中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会报送。</p> <p>(五) 资产管理人、资产托管人应当保证投资者能够按照资产管理合同约定的时间和方式查询委托资产的投资运作、托管等情况。</p> <p>(六) 集合计划管理人的董事、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集合计划, 应通过管理人指定网站向客户充分披露, 同时报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会。</p> <p>(七) 管理人、托管人向监管机构报告的种类、内容、时间和途径</p> <p>管理人、托管人将根据《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》及其他法律、行政法规、监管规定及要求及时进行报告。</p>
<p>利益冲突情况及可能影响投资者合法权益的其他重要事项</p>	<p>本计划存在的或可能存在利益冲突的情形</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人可能将本计划的资产投资于管理人、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承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易; 2、管理人及其附属机构有权以自有资金参与本集合计划; 3、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均有权参与本集合计划; 4、法律法规、中国证监会等监管机构规定的其他情形。 <p>集合计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容及披露频率</p> <p>管理人需建立健全内部审批机制和评估机制, 并遵循投资者利益优先的原则, 采取切实有效措施, 防范利益冲突, 保护投资者合法权益; 管理人应当事先取得投资者的同意, 事后告知投资者和托管人。</p> <p>投资人签署本合同即视为同意管理人可以将本计划的资产投资于管理人、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, 管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过管理人网站进行披露。集合计划存续期间, 管理人自有资金参与计划的持有期限不得少于6个月, 参与、退出时, 提前5个工作日通过管理人网站公告告知投资者和托管人。如管理人的董事、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本集合计划, 该部分投资者参与份额与集合计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险, 管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过管理人网站进行披露。</p>
<p>特别说明</p>	<ul style="list-style-type: none"> ● 本说明书作为《资产管理合同》的重要组成部分, 与《资产管理合同》具有同等法律效力。若本说明书中的内容与《资产管理合同》中的相关内容不一致的, 以《资产管理合同》的表述为准。