

华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书

2022 年 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《华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 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对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	华林证券满堂红汇利 1 号 FOF 号集合资产管理计划
	类型	混合类集合资产管理计划。本集合计划为基金中基金资产管理计划（FOF）。
	运作方式	开放式
	投资目标	本集合计划以追求收益增值为目标，在有效控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期增值。
	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	本计划首个封闭期为产品成立之后的 60 日。本计划首个开放期为封闭期满后首个交易日，之后每周一为申购开放日和赎回开放日，委托人可参与或退出集合计划，遇节假日不开放。
	主要投资方向	本集合计划通过下列金融产品或工具，最终投资于标准化资产： （1）资产管理产品：公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金），本集合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。 （2）货币市场工具：包括银行存款、货币市场基金、债券逆回购。 特别提示：1、本集合计划可投资债券逆回购；2、本集合计划投资的资产管理产品可能存在委托私募证券投资机构担任投资顾问的情形。 集合计划在成立后备案完成前，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。
	风险等级及适合推广对象	本产品属于中风险[R3]投资品种，适合专业投资者及风险识别、评估、承受能力为 [C3（稳健型）、C4（积极型）、C5（激进型）] 的合格投资者。
	存续期	本集合计划存续期限为自集合计划成立日开始至 5 年后对应的同月同日止（遇法定节假日、休息日自动顺延）。若无对应日期，则以对应的同月的最后一个自然日为准（遇法定节假日、休息日自动顺延）。
	初始募集面值	每份 1.00 元
	最低、最高初始募	本计划的最低初始募集规模为 1000 万元

	集规模	
	参与的最 低金额	单个投资者首次参与本集合计划的初始认购金额为人民币【40】万元（不含认购费）。
	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	本集合计划通过下列金融产品或工具，最终投资于标准化资产： （1）资产管理产品：公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金），本集合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。 （2）货币市场工具：包括银行存款、货币市场基金、债券逆回购。 集合计划在成立后备案完成前，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。
	投资比例	（1）本计划为混合类基金中基金资产管理计划，投资于公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金）的比例（按市值计算）不低于计划总资产的80%。 （2）固定收益类资产：市值占资产管理计划总资产的比例为0-80%（不含）。固定收益类资产包括银行存款、货币市场基金、债券逆回购及固定收益类资产管理产品等； （3）权益类资产：市值占资产管理计划总资产的比例为0-80%（不含）。权益类资产包括权益类资产管理产品等。 （4）混合类资产管理产品：市值占资产管理计划总资产的比例为0-100%。 本计划运作期间投资于公募基金及私募基金的，根据其信息披露的程度与频率，按照穿透原则合并计算的投资同一类资产的比例，应符合上述投资比例要求。 本计划建仓期为集合计划成立之日起不得超过6个月，管理人将在建仓期内，使集合计划的投资组合比例符合上述约定。因证券市场波动、投资对象合并、集合计划规模变动等外部因素，致使本集合计划的组合投资比例不符合上述约定的，管理人将在15个交易日内进行调整（如遇相关证券不能上市交易的，上述时间期限自动顺延）。 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、托管人及与托管人有关关联方关系的公司发行或承销的证券。委托人同意管理人在进行上述各项关联交易前无需再征求委托人意见。交易完成5个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人网站告知委托人，并向证券交易所报告。 法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在获得托管人、所有资产委托

		人一致同意后，可以将其纳入本计划的投资范围，具体投资比例由所有资产委托人协商一致确定。
	投资策略	(1) 资产配置策略 本集合计划首先根据宏观环境分析、风险收益分析、资产相关性分析等多种因素对资产配置方案进行决策，用最优化方法形成目标资产配置。 (2) FOF 投资管理策略 管理人可以在符合投资目标和投资理念的情况下，由投资经理进行投资管理，管理的方式包括：1) 在投资范围和投资限制约束下，主动对底层资产进行直接投资管理；2) 对代表某类资产和投资风格的资产管理产品进行直接投资，本集合计划主要投资于公募中长期纯债基金，短债基金，同业存单指数基金，公募 REITs；投资以绝对收益为目标的量化对冲，宏观对冲，中性策略的公、私募基金等资管产品。 本产品投资决策如下： ① 精选大类资产进行组合配置。根据目标客户对于产品的风险收益水平目标，按照各类资产的历史风险收益特征等指标，结合管理人的对于未来各大类资产展望，通过资产配置模型，确定各大类资产在投资组合中的初步配置比例，再通过不同资产及策略的配置比例精选代表某类策略与投资风格的资产管理产品进行投资； ② 组合优化配置。根据结合产品的承受的风险水平，在投资团队对未来各类资产收益和风险的预期基础上，微调各类资产在投资组合中的配置比例； ③ 组合配置调整。定期回顾和跟踪底层各大类资产和管理人业绩表现，调整组合的资产配置比例，实现组合风险与收益的动态平衡。 (3) 货币市场工具投资策略 本集合计划通过对货币市场工具的组合操作，在保持本金的安全性及资产流动性的同时，追求相对稳健的当期收益。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。
	投资限制	为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为： (1) 本集合计划投资于其他资产管理产品的，所投资的资产管理产品不再投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。 (2) 本集合计划投资单只资产管理产品的投资比例：0%-25%。 (3) 本集合计划投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算后，投资同一资产的比例不得超过本资产管理计划资产净值的 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%。 (4) 本集合计划投资于其他资产管理产品的，计算集合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。本集合计划的总资产占净资产的比例不得超过 200% (5) 债券正回购余额不得超过本集合资产管理计划净资产的 100%。 (6) 证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。 若因为市场波动，导致集合计划出现超限的情况，管理人应于 15 个交易日内调整到本合同约定的限制之内。 如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。
	风险揭示	见风险揭示书
收益分配和风险控制安排	收益分配	(一) 收益的构成 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。 (二) 收益分配原则 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。

		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） 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，并不意味着管理人保证集合计划资金不受损失。 （三）收益分配方案的确定与披露： 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。 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。 （四）收益分配方式 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。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。 委托人选择红利再投资分红方式的，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。 （五）收益分配的执行方式 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进行现金收益的划付。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。我行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。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。
	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	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	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【0.6%】。计算方法如下： $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ 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 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。
	托管费	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【0.01%】。计算方法如下： $H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$

		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 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。									
	业绩报酬	a、收取业绩报酬的原则： 集合计划存续期间，管理人不得主动提取业绩报酬，本集合计划仅在投资者退出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。 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根据管理人开放公告确认。 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。投资者承认，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。 在本集合计划的投资者退出日和本集合计划终止日，R 为每笔份额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，初始募集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，年化收益率在业绩报酬计提基准以上管理人则提取的业绩报酬。 按公式表示如下： $R = \frac{A - B}{C} \times \frac{365}{D} \times 100\%$ 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； <table border="1"> <thead> <tr> <th>年化收益率（R）</th><th>计提比例</th><th>业绩报酬（H）计算方法</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>R≤5%</td><td>0</td><td>H= 0</td></tr> <tr> <td>R>5%</td><td>20%</td><td>H=（R-业绩报酬计提基准）×20%×C×F×D/365</td></tr> </tbody> </table> 注：F 为提取业绩报酬的份额。 具体业绩报酬计提金额以管理人公告为准。	年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬（H）计算方法	R≤5%	0	H= 0	R>5%	20%	H=（R-业绩报酬计提基准）×20%×C×F×D/365
年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬（H）计算方法									
R≤5%	0	H= 0									
R>5%	20%	H=（R-业绩报酬计提基准）×20%×C×F×D/365									
	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，在相应的会计期间进行预提。资产管理人应根据银行间费用相关法律法规及本合同约定，将账户开户、结算管理等各项费用列入或摊入当期委托财产运作费用，经管理人和托管人核对无误后，由管理人授权后划付，管理人收到托管人通知后一个月内未授权划付的，由托管人从委托资产中扣划，无须资产管理人出具指令。资产委托人和资产管理人在此申明已了解委托资产投资会产生的银行费用，并确保账户中有足够资金用于银行费用的支付，如因托管账户中的资金不足以支付银行费用影响到指令的执行，资产托管人不承担由此产生的损失和									

		责任。如委托资产未起始运作，由管理人在收到托管人的缴费通知后完成支付，托管人不承担垫付费用义务。 （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	认购费率：0.5 %。 管理人及销售机构可以在不违反法律法规且公平对待投资者的情况下对认购费进行调整。							
	参与费	参与费率：0.5%。 管理人及销售机构可以在不违反法律法规且公平对待投资者的情况下对参与费进行调整。参与费用不列入集合计划财产。							
	退出费	退出费率：投资者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并计入集合计划资产，退出费率如下：							
		<table><tr><th>持有天数 N</th><th>退出费率</th></tr><tr><td>N<60 天</td><td>1.5%</td></tr><tr><td>360 天>N>=60 天</td><td>0.5%</td></tr><tr><td>N>=360 天</td><td>0%</td></tr></table>	持有天数 N	退出费率	N<60 天	1.5%	360 天>N>=60 天	0.5%	N>=360 天
持有天数 N		退出费率							
N<60 天		1.5%							
360 天>N>=60 天	0.5%								
N>=360 天	0%								
	管理人及销售机构可以在不违反法律法规且公平对待投资者的情况下对退出费进行调整。								
投资者的权利和义务	投资者的权利	投资者的权利包括但不限于： 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。							
		投资者的义务包括但不限于：							

	投资者的义务	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、投资者转让本合同中的权利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）； 12、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。
信息披露的内容、方式、频率		（一）集合计划单位净值报告 披露时间：本集合计划成立后，每日披露集合计划份额净值、累计净值，管理人在下一个工作日内向投资者报告前一交易日经托管人对财务数据复核的计划财产净值。 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指定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。 （二）集合计划定期报告 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。 1、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告 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，经托管人对财务数据复核后由管理人公告，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。集合计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月时，可以不编制当期的季度报告。 集合计划的季度报告内容包括下列信息： （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； （7）资产管理计划投资收益分配情况； （8）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； （9）中国证监会规定的其他事项。 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。

	2、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告 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： (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。 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。 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。 3、年度财务会计报告 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。 （三）集合计划临时报告 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： (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； (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) 管理人以自有资金参与和退出； (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) 负责本集合计划的代理销售机构发生变更； (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； (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； (11) 集合计划收益分配； (12) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更； (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。 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。 （四）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。 （五）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。
--	---

利益冲突情况及其他重要事项	本计划存在的或可能存在利益冲突的情形	1、本集合计划存在的或可能存在利益冲突的情形，包括但不限于： （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，可能存在利益冲突的情况； （2）FOF 产品投资于管理人及管理人关联方所设立的资产管理产品（如涉及）； （3）法律法规、中国证监会等监管机构规定的其他情形。
	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	1、集合计划存在利益冲突的处理方式 当管理人利益与投资者利益冲突时，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。 2、集合计划存在利益冲突的披露事项 集合计划发生合同约定可能存在利益冲突情形的，管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过公司官网向投资者披露可能存在利益冲突的具体情形，同时应在该事项发生之日起五个工作日内报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会。
特别说明		● 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。