

## 第一创业富利集合资产管理计划说明书

2026年9月

## 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》(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《运作管理规定》)、《第一创业富利集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称《资产管理合同》)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,保证出资财产的来源及用途合法,并已阅知本说明书和《资产管理合同》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受托资产,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《资产管理合同》且合同生效后,投资者即为《资产管理合同》的投资者,其认购或参与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》、《运作管理规定》、《资产管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

|                  |          |                                                                                                                                                                                                                                                   |
|------------------|----------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基<br>本<br>信<br>息 | 名称       | 第一创业富利集合资产管理计划                                                                                                                                                                                                                                    |
|                  | 类型       | 混合类集合资产管理计划                                                                                                                                                                                                                                       |
|                  | 最低初始募集规模 | 本计划成立时计划财产的初始资产净值不得低于人民币 1000 万元,本计划初始募集期及存续期不设规模上限。<br>管理人有权根据实际情况调整初始募集期及存续期规模上限,并在管理人指定网站公告。                                                                                                                                                   |
|                  | 管理期限     | 本计划的管理期限为 30 个月,从本计划成立日起算。在符合本合同约定的展期条件下可展期,但按照本合同约定出现本计划应当终止的情形时,本计划将提前终止并进行清算。                                                                                                                                                                  |
|                  | 份额面值     | 人民币 1.00 元。                                                                                                                                                                                                                                       |
|                  | 投资范围及比例  | 1、投资范围<br>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的固定收益类资产、现金类资产、权益类资产及中国证监会认可的其他投资品种等标准化资产:<br>(1) 权益类资产: 国内依法发行并在证券交易所交易的股票(含主板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票,含且不限于二级市场股票、新股申购、北京证券交易所战略配售股票、股票增发、通过询价转让/大宗交易等方式受让的上市公司股东转让的股票等)、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖 |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（“沪港通标的股票”）、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所市场的股票（“深港通标的股票”）；</p> <p>（2）固定收益类资产（含现金类资产）：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、债券逆回购等；</p> <p>（3）公开募集证券投资基金：货币市场基金、股票型基金。</p> <p>2、投资比例</p> <p>（1）资产配置比例</p> <p>1）权益类资产的投资比例为资产总值的 20%（含）-100%（不含）。</p> <p>2）固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例为资产总值的 0%（含）-80%（不含）。</p> <p>3）参与债券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>4）本计划投资于公开募集证券投资基金的，计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资公开募集证券投资基金的总资产，且按照穿透原则合并计算投资同类资产的金額需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资公开募集证券投资基金披露投资组合的频率，更新计算计划所投资资产的金額或比例。</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>本计划主要通过投资国内依法发行并在证券交易所交易的股票（含主板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票，含且不限于二级市场股票、新股申购、北京证券交易所战略配售股票、股票增发、通过询价转让/大宗交易等方式受让的上市公司股东转让的股票等）、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（“沪港通标的股票”）、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所市场的股票（“深港通标的股票”）以及股票型公募证券投资基金（运作方式为开放式）配置权益类资产，结合本计划的投资策略及管理人的持续跟踪研究，如管理人评估届时权益类资产具有较高投资价值，且目标标的具备相应的投资机会时，将提高对权益类资产的配置，此时权益类资产投资比例可能超过 80%。</p> <p>（2）总资产占净资产的比例</p> <p>本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%，计算总资产时，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，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>（3）组合投资要求比例</p> <p>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%；除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外，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%，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；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。全部投资者</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      | <p>均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者不包括募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品）且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划，以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划，不受前述关于投资于同一资产的比例限制。</p> <p>（4）投资比例超限的处理方式和流程</p> <p>如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主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者《资产管理合同》约定的投资比例的，管理人应自超标发生之日起在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的 20 个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告。</p>                                             |
| 投资限制 | <p>（1）管理人管理的全部资产管理计划合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%。</p> <p>（2）本计划投资于上市公司定增股票、询价转让股票及北交所战略配售股票等具有一定期限限售期的股票的解禁日不得晚于资管计划的到期日。</p> <p>（3）本计划参与股票等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过本计划的总资产，且所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>（4）本计划投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过该上市公司总股本的 4.99%，不得超过该上市公司流通股本的 10%。</p> <p>（5）现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；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，本计划可相应调整投资组合限制的规定。</p>                                             |
| 投资策略 | <p>1、管理人的决策依据</p> <p>本计划以国家有关法律、法规和《资产管理合同》的有关规定为决策依据，并以维护本计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：</p> <p>（1）《管理办法》、《运作管理规定》等有关法律法规及《资产管理合同》等法律文件；</p> <p>（2）宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势，为本计划投资决策的市场基础；</p> <p>（3）投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本计划维护投资者利益的重要保障。针对产品的特点，在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，力争保护投资者的本金安全，在此基础上为投资者争取较高的收益。</p> <p>2、管理人的决策程序</p> <p>管理人资产管理业务投资决策体系由管理人资产管理业务委员会、资产管理业务部门、投资经理三级体系组成。</p> <p>管理人资产管理业务委员会是管理人资产管理业务的最高决策机构，下设投资管理委员会负责确定以下事项：</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>(1) 在资产管理业务委员会授权范围内，对资产管理业务部门的投资品种、投资规模等进行授权；</p> <p>(2) 审议资产管理业务部门超出授权限额但未超过监管规定限额的投资；</p> <p>(3) 核准资产管理业务部门投资经理的履职资格；</p> <p>(4) 讨论与决定其他涉及客户资产管理投资业务的重大事宜。</p> <p>资产管理业务部门的主要职责是：</p> <p>(1) 确定客户资产管理业务投资、研究工作的政策，约束客户资产投资管理的整体过程；</p> <p>(2) 讨论、提名投资经理人选，并报公司资产管理业务委员会下设的投资管理委员会审批；</p> <p>(3) 对投资经理进行适当的定级和授权；</p> <p>(4) 审批超过投资经理授权权限但未超过投资管理委员会授权权限的投资事宜；</p> <p>(5) 制定客户资产管理相关的具体投资研究交易制度；</p> <p>(6) 建立和维护投资品池；</p> <p>(7) 讨论与决定其他涉及客户资产管理业务的具体事宜。</p> <p>投资经理是资产管理业务具体产品的直接管理人，在管理人授权范围内进行投资管理。</p> <p>3、管理人投资管理的方法和标准</p> <p>本计划将充分发挥管理人的研究和投资管理优势，在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上，在资产配置、类属配置和交易策略层面实施积极管理策略；在严格控制风险的前提下，力争实现组合风险和收益的最优配比。</p> <p>(1) 资产配置策略</p> <p>本计划主要通过投资国内依法发行并在证券交易所交易的股票（含主板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票，含但不限于二级市场股票、新股申购、北京证券交易所战略配售股票、股票增发、通过询价转让/大宗交易等方式受让的上市公司股东转让的股票等）、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（“沪港通标的股票”）、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所市场的股票（“深港通标的股票”）以及股票型公募基金（运作方式为开放式）配置权益类资产，此外管理人将在产品合同约定的投资范围内结合定性以及定量分析，自上而下地实施整体资产配置策略，通过预测各大类资产未来收益率变化情况，在不同的大类资产之间进行动态调整和优化，力争规避市场风险，提高本计划资产收益率。</p> <p>(2) 现金资产及债券逆回购投资策略</p> <p>本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及债券逆回购的配置，并定期对现金类资产组合及债券逆回购组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。</p> <p>(3) 网上新股申购及北交所战略配售策略</p> <p>本计划基于对宏观经济、资本市场的深入分析和理解，通过对中国境内证券交易所</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>网上新股申购股票及北京证券交易所首次公开发行人民币普通股股票进行战略配售股票深入研究,精选具有估值优势和成长优势的网上新股申购股票及北交所战略配售股票进行投资,追求产品资产的长期稳定增值。通过对网上新股申购股票及北交所战略配售股票所属行业公司的估值指标(如 PE、PB、PE/GPS、股息率等)、成长性指标(主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率、净利润现金保障倍数等)、现金流量指标和其他财务指标进行分析,从中选出价值相对低估、成长性确定、现金流量状况好、盈利能力和偿债能力强的公司,作为本产品的备选网上新股申购股票及北交所战略配售股票;再通过与市场整体估值水平、行业估值水平主要竞争对手估值水平的比较,确定拟参与网上新股申购股票及北交所战略配售股票申购的价格和数量。</p> <p>(4) 定向增发股票及询价转让投资策略</p> <p>管理人将根据行业所处的生命周期、行业的竞争结构、竞争结构的演变态势、行业景气程度、以及政府的产业政策等宏观政策,对行业的相对投资价值进行排序,从而确定初步的行业配置方案。</p> <p>本计划从估值水平和发展前景两个角度出发,分析不同类别的定向增发及询价转让项目对企业基本面与所处行业的影响。采取定性和定量分析相结合的方法对影响上市公司(含主板、创业板、科创板、北交所)定向增发及询价转让项目未来的价值进行全面的分析,精选股价受益或未能充分体现定向增发及询价转让项目发展潜力的股票。</p> <p>本计划的股票定量分析方法将在现有定向增发及询价转让项目的基础之上,分析市场现有定向增发及询价转让项目中各行业公司的估值指标、成长性指标、现金流指标和其他财务指标,从中选出价值相对低估、成长性确定、现金流量状况好、盈利能力和偿债能力强的公司,作为本计划的备选定向增发及询价转让股票;再通过分析备选股票所带来的公司资产收益率、资产周转率等变量的时间序列,以及通过对市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平的比较,并参考国际市场估值水平来评估其投资价值。</p> <p>在定量分析的基础上,从定向增发及询价转让项目目的、定向增发及询价转让受让方的对象结构、定向增发及询价转让项目类别,多层面地分析备选定向增发及询价转让项目所对应的公司的业务环节的竞争优势和劣势、分析定向增发及询价转让项目对公司未来的影响,公司管理方面的优势和劣势等,经过严格的定量分析和定性分析,从战略角度评估参与定向增发及询价转让的可能损益和风险成本,形成是否参与的意见。管理人根据初步确定的行业配置方案,从中挑选出合适的投资标的,在符合监管规定的前提下,本计划可能全部投资于单一标的股票的定增及询价转让。</p> <p>在定向增发及询价转让股票锁定期结束后,管理人将根据对股票内在投资价值和成长性的判断,结合股票市场环境的分析,选择适当的时机卖出。</p> <p>(5) 二级市场股票投资策略</p> <p>本计划主要通过二级市场竞价交易、大宗交易投资于二级市场股票。管理人多种理念方式精选个股,通过企业价值的快速成长或重新估值实现投资资产的增值。深入研究,对企业、行业的发展脉络进行全方位的分析,对上市公司业绩尤其是业绩的质量进行分析,基于对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的综合权衡,选出中长期持续增长或未来阶段性高速增长且价值被低估的优质企业作为投资对象。在深入研究基本面的基</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|             |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-------------|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|             |        | <p>础上,坚持价值投资理念,准确把握投资机会,不为短期波动影响。</p> <p>通过实地调研等方式进行广泛和深入的研究,结合自上而下的判断,确定具有长期投资价值的公司股票申请股票库入库。价值判断的主要方面包括:公司所属行业的长期发展前景、公司的核心竞争力、公司的管理能力和治理结构、公司的历史表现、估值合理性、业务模式简单清晰、突出优势地位和竞争力、公司历史表现等方面。挑选合适股票标的进行长期投资,耐心持有等待其价值的持续稳定增加。</p> <p>保持逆向思维,战略关注并投资周期性行业的拐点机会,捕捉业绩反转、超预期、估值修复、事件驱动等投资机会,熊市末牛市初的系统性机会等。</p> <p>跟踪因并购重组、整体上市、增发等各类特殊原因而产生的具有较高确定性收益的股票投资机会,或获取该事件产生的低风险稳定收益,如具有现金选择权的并购套利等。</p> <p>管理人将密切关注当前已经实施定向增发及询价转让,且还处于锁定期的上市公司,当二级市场股价跌破定向增发价及询价转让价格时,综合考察定向增发及询价转让数量、定向增发发行对象及询价转让受让方、剩余锁定期限、定向增发及询价转让目的等因素,深入了解发行人的行业背景、市场地位、盈利能力等,并结合当前市场环境,择机买入并在解禁日临近或解禁后再择机卖出,以获取破发回补的收益。</p> <p>(6) 股票型公募证券投资基金投资策略</p> <p>按照资产配置要求,将股票型公募证券投资基金进行合理分类,初步划分为宽基、行业板块、主题境外等,并根据需要进行细分和调整。对股票型公募证券投资基金以定量分析为主,主要考虑基金的可投资性、独特性、成本等方面,注重于基金规模,流动性、跟踪误差等因素。</p> <p>以上内容为管理人对于本计划全部或者部分投资品种相应投资策略的阐述,不构成对于本计划投资范围、投资比例及限制的补充,也不构成管理人的承诺。</p> |
|             | 风险收益特征 | R5(高风险)等级                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|             | 适合推广对象 | 适合且仅能向风险承受能力为C5(激进型)级或符合专业投资者标准的合格投资者销售。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 当<br>事<br>人 | 管理人    | 第一创业证券股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|             | 托管人    | 浙商证券股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|             | 投资顾问   | 本计划未聘请投资顾问                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|             | 销售机构   | 第一创业证券股份有限公司及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本计划的机构                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 初<br>始      | 募集期限   | 本计划的初始募集期为自本计划启动募集之日起不超过60个自然日的期间,具体募集期间以本计划推广公告为准;管理人有权根据本计划销售的实际情况延长(但最长不得超过60个自然日)或缩短募集期限,此变更更适用于所有销售机构。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|              |                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--------------|-------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 募集期间         | 认购费用及认购份额计算       | <p>(1) 认购费率</p> <p>本计划无认购费, 即认购费率为 0。</p> <p>(2) 认购份额的计算方法</p> <p>认购份额 = (认购金额 + 应计利息) ÷ 1</p> <p>注: 本计划份额计算时采用四舍五入, 保留至 0.01 份, 由此产生的误差计入本计划财产; 多笔参与时, 按上述公式进行逐笔计算。</p>                                                                                                                                         |
|              | 初始认购资金的管理及利息处理方式  | <p>销售机构应当将本计划初始募集期间投资者的资金存入募集账户, 在本计划募集期限结束前, 任何机构和个人不得动用。本计划成立前, 认购款在募集账户产生的利息将折算为本计划份额归投资者所有, 其中利息金额以注册登记机构的记录为准。</p>                                                                                                                                                                                          |
|              | 最低认购金额            | <p>投资者首次认购本计划的最低认购金额为人民币 1,000,000 元 (不含认购费), 超额部分不设金额级差, 管理人可以根据法律法规的规定及本计划运作的实际情况设置和调整最低认购金额 (但最低不得低于人民币 100 万元), 并提前披露。投资者可以多次参与本计划, 投资者多次参与本计划的每次最低参与金额为人民币 10,000 元, 超过部分不设金额级差。</p>                                                                                                                        |
| 集合计划成立的条件、时间 |                   | <p>初始募集期限届满时, 本计划的初始募集规模不低于人民币 1000 万元且其投资者的人数为 2 人至 200 人, 募集过程符合法律法规和中国证监会的规定, 管理人公告本计划成立。</p>                                                                                                                                                                                                                 |
| 集合计划募集失败     |                   | <p>初始募集期限届满, 在本计划初始募集规模低于人民币 1000 万元或投资者的人数少于 2 人条件下, 本计划募集失败。本计划募集失败的, 管理人应当以其固有财产承担本计划因募集行为而产生的债务和费用, 在募集期限届满后 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。</p>                                                                                                                                                            |
| 集合计划的参与和退出   | 办理场所              | <p>本计划的参与和退出场所为管理人及代理销售机构 (如有) 的营业场所或按照管理人及代理销售机构 (如有) 提供的其他方式办理参与和退出。</p>                                                                                                                                                                                                                                       |
|              | 办理时间              | <p>本计划成立后封闭运作, 存续期内不办理参与和退出, 本合同另有约定的除外。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|              | 临时开放期             | <p>因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订或因本计划运作的实际情况需要变更合同时, 管理人有权设定临时开放期, 为投资者办理退出业务, 临时开放期的具体安排以管理人公告为准。</p>                                                                                                                                                                                     |
|              | 参与和退出的方式、价格、程序及确认 | <p>(1) “未知价”原则, 即参与价格为注册登记机构受理参与申请当日本计划的单位净值, 退出价格为注册登记机构受理退出申请当日本计划单位净值。</p> <p>(2) 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。</p> <p>(3) 参与和退出申请的确认: 本计划存续期内封闭运作, 不办理参与业务。</p> <p>对于投资者的退出申请, 管理人按照先进先出的原则予以确认, 也即是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并适用相应的退出费率 (如有)。</p> <p>(4) 参与和退出申请的款项支付: 投资者退出申请确认成功后, 管理人应按照本</p> |

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|              | <p>合同约定向投资者支付退出款项,退出款项于确认之日起7个工作日内从托管账户中划出。在发生巨额退出的情形时,款项的支付办法参照本合同的有关条款处理。如本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。投资者申请退出份额数量超过投资者持有份额数量时,申请无效。</p> <p>(5) 管理人可根据本计划运作的实际情况并在不影响投资者实质利益的前提下调整上述原则。管理人必须在新规则开始实施前在管理人指定网站公告告知投资者。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 参与和退出的金额限制   | <p>本计划封闭运作,存续期内不办理参与业务。</p> <p>因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订或因本计划运作的实际情况需要变更合同时,管理人有权设定临时开放期,因不同意合同变更需要退出本计划的,投资者应当选择一次性全部退出本计划,否则管理人有权发起强制退出投资者持有的本计划全部份额。</p> <p>如相关法律法规变更导致前述约定不再符合法律法规规定的,管理人有权根据变更后的法律法规要求,合理调整对参与金额和退出份额的数量限制,管理人必须在新规则开始实施前在管理人网站指定公告告知投资者。</p>                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 参与和退出的费用     | <p>(1) 参与费用</p> <p>本计划封闭运作,存续期内不办理参与业务。</p> <p>(2) 退出费用</p> <p>本计划无退出费,即退出费率为0。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 参与份额和退出金额的计算 | <p>(1) 参与份额的计算</p> <p>本计划封闭运作,存续期内不办理参与业务。</p> <p>(2) 退出金额的计算</p> <p>退出总额=退出份额×注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值</p> <p>退出金额=退出总额-管理人业绩报酬(如有)</p> <p>注:退出金额结果按照四舍五入方法,保留小数点后两位,多笔退出时,按上述公式进行逐笔计算。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 管理人自有资金参与情况  | <p>1、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与的条件</p> <p>在初始募集期间或存续期内,证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与本计划。证券期货经营机构包括证券公司、基金管理公司、期货公司及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司,具体范围以中国证监会、基金业协会等监管机构的要求为准。如参与,则证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的50%。法律法规或者中国证监会对证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例另有规定的,从其规定。</p> <p>证券期货经营机构及其子公司持有计划份额与其他投资者持有的本计划份额享有同等参与收益分配的权利,也承担与所持本计划份额相对应损失的责任。证券期货经营机构及其子公司投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。</p> <p>2、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的条件</p> <p>(1) 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。</p> <p>(2) 证券期货经营机构及其子公司自有资金在存续期内参与、退出本计划时应当提前5个工作日以公告或其他方式通知全体投资者,并书面征求托管人意见。投资者不同意</p> |

|                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|----------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                      | <p>证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的，应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请。未提出退出申请的，视同投资者已经同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出。</p> <p>(3) 投资者和托管人签署本合同即视为同意证券期货经营机构及其子公司可以自行决定在初始募集期间以自有资金参与本计划。</p> <p>但在发生以下特殊情形时，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出可以不受上述条件限制，但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知投资者和托管人，并向住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准：</p> <p>(1) 因规模变动等客观因素导致证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额比例被动超限或可能被动超限（即证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例被动超过或可能被动超过《证券公司风险控制指标计算标准规定》等中国证监会对证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例的规定，或证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计超过或可能超过本计划总份额的 50%），证券期货经营机构及其子公司在发生上述超限情形或可能超限情形之日起 5 个工作日内退出超限部分的参与份额，5 个工作日后仍超限的，证券期货经营机构及其子公司将在其后 5 个工作日处理。</p> <p>(2) 为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与及其后续退出本计划。</p> <p>3、风险揭示和信息披露</p> <p>(1) 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额，享有与其他投资者份额相同的收益分配权，且不对本计划其他投资者承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。</p> <p>(2) 证券期货经营机构及其子公司自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本计划规模变动情况，控制流动性风险。</p> <p>(3) 管理人将按照法律法规及基金业协会的要求披露自有资金的参与、退出情况及持有期限等信息。</p> <p>(六) 管理人将按照法律法规及基金业协会的要求，定期将本计划投资者变更情况报送基金业协会，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>(七) 管理人可根据资产管理计划运作的实际情况并不影响投资者实质利益的前提下调整上述原则。管理人必须在新规则实施五个工作日内在管理人指定网站公告。</p> |
| <p>集合计划份额转<br/>让</p> | <p>本计划存续期间，在各项条件均满足的情况下，投资者可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让本计划份额，受让方必须是符合《运作管理规定》规定和本合同约定的合格投资者，份额转让应遵守相应的交易场所的相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。</p> <p>管理人和托管人无需就本计划份额转让事宜与投资者另行签订协议。但投资者与受让人应签署转让协议，并将该转让协议发送给管理人、托管人书面确认，托管人在管理人已书面同意的情况下予以确认。受让方首次参与本计划，应先与管理人、托管人签订资产管理合同。</p> <p>管理人可以视情况开放本计划的份额转让，管理人应在本计划开放份额转让前 5 个工作日通过网站公告，份额转让事宜以管理人公告为准。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

|       |                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|-------|------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 费用、报酬 | 费用种类<br>(计提标准、方法、支付方式) | <p>1、管理费</p> <p>(1) 固定管理费</p> <p>本计划管理人固定管理费按本计划前一日净值的 1% 年费率计提, 计算方法如下:</p> $H = E \times 1\% \div 365$ <p>H 为每日应计提的固定管理费;</p> <p>E 为本计划前一日净值。</p> <p>本计划固定管理费每日计提, 按季支付。管理人于每季度首月前 5 个工作日内向托管人出具固定管理费投资指令, 经托管人核对无误后从本计划财产中一次性支付给管理人。</p> <p>管理人费用收入账户 (含管理费、第一创业证券交易佣金)</p> <p>户名: 第一创业证券股份有限公司</p> <p>账号: 4000023319200099986</p> <p>开户银行: 工行深圳分行福田支行</p> <p>(2) 业绩报酬 (浮动管理费)</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本计划的, 对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬;</p> <p>② 在投资者退出、本计划分红及计划清算时, 对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬;</p> <p>③ 在本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 在投资者退出及本计划清算时提取业绩报酬的, 业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除;</p> <p>⑤ 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>2) 业绩报酬的计提方法</p> <p>每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日 (如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日, 则初始募集期参与的为注册登记机构份额注册登记日, 存续期参与的为份额参与日, 红利再投资的为分红除权日, 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。</p> <p>本计划提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次, 因投资者退出本计划, 管理人按照本合同约定提取业绩报酬的, 不受前述提取频率的限制。</p> <p>年化收益率的计算公式如下:</p> $R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \div D \times 100\%$ <p><math>P_1</math> 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值;</p> <p><math>P_0</math> 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值;</p> <p><math>P_0^*</math> 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值;</p> |
|-------|------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

$D$  表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数/365(1 年按 365 天计算);

$R$  为年化收益率。

管理人业绩报酬计提如下:

| 年化收益率        | 计提比例 | 业绩报酬计算公式                       |
|--------------|------|--------------------------------|
| $R < 6\%$    | 0%   | 0                              |
| $6\% \leq R$ | 10%  | $Y = M * (R - 6\%) * 10\% * D$ |

其中:

$Y$  = 业绩报酬;

$M$  = 每笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。

初始募集期参与的份额首次计提业绩报酬的上一个业绩报酬计提日指注册登记机关确认初始募集期参与份额的注册登记日; 开放期参与的份额首次计提业绩报酬的上一个业绩报酬计提日指参与日。

3) 业绩报酬支付: 由于业绩报酬的计算涉及注册登记数据, 业绩报酬由管理人计算, 托管人不承担复核责任。托管人根据管理人的投资指令于计提日后七个工作日内从本计划财产中一次性支付给管理人。费用计提如有四舍五入的差异, 以注册登记机关确认的金额为准。

业绩报酬属于管理费, 法律法规或者监管机构对固定管理费和业绩报酬(浮动管理费)的收取比例上限有新的规定的, 按照新规定执行。

## 2、托管费:

本计划托管人托管费按本计划前一日净值的 0.01% 年费率计提, 计算方法如下:

$$H = E \times 0.01\% \div 365$$

$H$  为每日应计提的托管费;

$E$  为本计划前一日净值。

本计划托管费每日计提, 按季支付。管理人于每季度首月前 5 个工作日内向托管人出具托管费投资指令, 经托管人核对无误后从本计划资产中一次性支付给托管人。

托管人费用收入账户

户 名: 浙商证券股份有限公司

账 号: 3300 1617 8350 5966 6666

开户银行: 中国建设银行杭州市庆春支行营业部

若本计划现金资产不足以支付管理费和托管费的, 则相应顺延至本计划现金资产足以支付之日支付。

管理人和托管人协商一致可以调低管理费率或者托管费率, 并通过管理人网站公告告知投资者。

## 3、证券交易费用

证券交易费用指本计划进行各类投资品种的投资交易而形成的费用, 包括但不限于: 印花税、交易所经手费、证管费、银行间交易手续费、场外基金办理要求的申购赎

|      |                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|------|----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      |                | <p>回费等费用、结算费、过户费、佣金等各项费用，证券交易费用在交易发生时直接计入当期费用；以上各项费用的费率标准按照相关法规政策执行，其中交易佣金的费率由管理人本着保护本计划及投资者利益的原则，按照法律法规的规定确定。</p> <p>4、其他费用</p> <p>在存续期间发生的本计划审计费用，由本计划承担，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>银行间市场账户开户费及维护费、证券账户开户费、存续期间信息披露费、电子合同服务费、注册登记费、银行汇划手续费、账户管理费、会计师费及律师费等本计划运营过程中发生按照国家有关规定可以列入的其他相关费用，按费用实际支出金额支出，列入或摊入当期本计划费用。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|      | 不列入资产管理计划费用的项目 | <p>本计划成立前发生的费用（包括但不限于计划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募集有关的费用，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本计划资产的损失，以及处理与本计划运作无关的事项或者不合理事项所发生的费用等不得列入本计划费用。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 收益分配 |                | <p>本计划的收益分配方案依据法律法规的规定及本合同的约定执行：</p> <p>（一）收益的构成</p> <p>收益包括：本计划投资所得收益、利息、红利、银行存款利息及其他合法收入。</p> <p>本计划的净收益为本计划收益扣除按照国家有关规定及本合同约定的可以在本计划收益中扣除的费用后的余额。</p> <p>（二）可供分配利润：指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数，实际分配利润的比例由管理人根据本计划运作的实际情况确定。</p> <p>（三）收益分配原则</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、每一计划份额享有同等分配权；</li> <li>2、收益分配基准日的份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值；</li> <li>3、收益分配时发生的银行转账或者其他手续费用由投资者自行承担；</li> <li>4、本计划默认现金红利方式，可选择红利再投资方式；</li> <li>5、本计划成立不满6个月可不进行收益分配；</li> <li>6、法律法规或者监管机关另有规定的，从其规定。</li> </ol> <p>（四）收益分配对象</p> <p>分红权益登记日所有持有本计划的投资者。</p> <p>（五）收益分配时间</p> <p>本计划存续期间，管理人根据具体情况进行收益分配，具体分配时间以管理人公告为准，但收益分配的间隔期间不得短于6个月。</p> <p>（七）收益分配方案的确定与披露</p> <p>本计划收益分配方案由管理人拟定并向投资者公告。</p> <p>（八）收益分配中发生的费用收益分配时发生的银行转账等手续费用由本计划投资者自行承担，分红款项将于本次分红权益登记日起T+5个工作日内从托管户划出。</p> |

|                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|----------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                            | <p>(九) 收益分配方案的实施</p> <p>本计划默认现金红利方式, 可选择红利再投资方式。投资者可修改分红方式。选择现金分红方式的, 管理人将现金红利在扣除业绩报酬(如有)后款划往销售机构账户, 再由销售机构划入投资者账户; 选择红利再投资方式的, 分红资金在扣除业绩报酬(如有)后按分红除权日当日的单位净值自动转为本计划的份额。红利再投资形成的本计划份额计算保留到小数点后两位, 小数点后两位以后的部分四舍五入, 由此产生的差额计入本计划资产的损益。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| <p>信<br/>息<br/>披<br/>露</p> | <p>定期报告包括本计划单位净值报告、本计划的资产管理季度及年度报告、托管年度报告、年度审计报告和对账单。</p> <p>1、本计划单位净值报告</p> <p>披露时间: 本计划存续期内每个工作日(如遇节假日, 则以节假日前最近一个工作日为估值日)的计划单位净值及计划累计单位净值将于下一个工作日在管理人网站上公布。</p> <p>披露方式: 本计划的单位净值、累计单位净值等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, 管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>资产管理计划参与价格为注册登记机构受理参与申请当日本计划的单位净值, 退出价格为注册登记机构受理退出申请当日本计划单位净值。</p> <p>2、本计划的季度报告和年度报告</p> <p>(1) 本计划的资产管理季度报告</p> <p>管理人每季度结束之日起一个月内向投资者提供一次准确、完整的管理季度报告, 对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理季度报告由管理人编制, 经托管人复核财务数据后由管理人通过管理人网站公告, 具体以监管机构的要求为准。</p> <p>本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的, 可以不编制当期的季度报告。</p> <p>(2) 本计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人每年度结束之日起四个月内向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告, 对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理年度报告由管理人编制, 经托管人复核财务数据后由管理人通过管理人网站公告, 具体以监管机构的要求为准。托管人在每年度结束之日起四个月内向投资者提供一次年度托管报告, 年度托管报告由管理人通过管理人网站公告。</p> <p>本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的, 可以不编制当期的年度报告。</p> <p>(3) 资产管理年度报告包括但不限于下列信息:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1) 管理人履职报告;</li> <li>2) 托管人履职报告;</li> <li>3) 本计划投资表现;</li> <li>4) 本计划投资组合报告;</li> <li>5) 本计划运用杠杆情况(如有);</li> <li>6) 本计划财务会计报告;</li> <li>7) 本计划支付的管理费、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;</li> </ol> |

|      |         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|------|---------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      |         | <p>8) 本计划投资收益分配情况;</p> <p>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;</p> <p>10) 中国证监会规定的其他事项。</p> <p>资产管理季度报告应当披露前述除第 6) 项之外的其他信息。</p> <p>3、年度审计报告</p> <p>管理人应当进行年度审计,应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计,并要求符合《证券法》规定的会计师事务所就本计划出具单项审计意见。</p> <p>管理人应当将本计划的单项审计意见通过管理人网站公告,具体以监管机构的要求为准。本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月时,可以不编制当期的年度审计报告,产品终止当年,无需出具年度审计报告。</p> <p>4、对账单</p> <p>管理人至少每个季度以电子或者其他形式向投资者提供对账单,如有调整,管理人将以公告形式通知投资者。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>投资者应向管理人提供电子邮箱地址等资料,因投资者未正常提供以上信息、邮件运营商系统平台故障及内部操作等非管理人原因导致投资者未能获得电子对账单的,管理人不承担任何责任。</p>         |
|      | 临时报告    | <p>本计划存续期间,发生对本计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件,管理人应当在事项发生之日起 5 日内以管理人指定网站公告或其他途径和方式及时向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于:</p> <p>1、管理人或托管人变更;</p> <p>2、本计划运作过程中,负责本计划的投资经理发生变更,或出现其他可能对本计划的持续运作产生重大影响的事项;</p> <p>3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请;</p> <p>4、本计划终止和清算;</p> <p>5、本合同的补充、修改与变更;</p> <p>6、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项;</p> <p>7、负责本计划的代理销售机构发生变更;</p> <p>8、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>9、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>10、资产计价出现错误(当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时,视为本集合计划单位净值错误);</p> <p>11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更;</p> <p>12、其他发生对本计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件。</p> |
| 利益冲突 | 利益冲突的情形 | <p>本计划存在或可能存在如下利益冲突的情形:</p> <p>1、若发生管理人开展的不同业务之间的敏感信息不当流动和使用,导致管理人其他业务与管理人资产管理业务可能存在利益冲突;</p> <p>2、若发生不同投资经理管理的资产管理计划的持仓、交易等重大非公开信息的不当流动和使用,导致管理人管理的不同资产管理计划之间可能存在利益冲突;</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

|                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|----------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                            | <p>3、若发生管理人从业人员利用知悉的敏感信息参与资产管理计划且未按规定进行申报和披露的，导致管理人从业人员与资产管理计划及投资者之间可能存在利益冲突；</p> <p>4、其他可能存在的管理人、管理人从业人员与资产管理计划及管理人管理的不同资产管理计划之间可能存在的利益冲突情形。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| <p><b>利益冲突的处理方式及披露</b></p> | <p>1、利益冲突的处理方式</p> <p>管理人制定了信息隔离墙管理办法及利益冲突管理办法，并在业务开展过程中严格执行业务隔离和利益冲突防范的机制，对利益冲突进行识别和管理，若发现存在利益冲突情形的，管理人将遵循如下原则及时予以处理，维护本计划及投资者的合法权益：</p> <p>（1）在处理涉及到公司、从业人员与客户之间的利益冲突时，严格坚持客户利益至上的原则；</p> <p>（2）在处理涉及到客户与客户之间的利益冲突时，严格坚持公平对待客户的原则。</p> <p>2、利益冲突的披露</p> <p>对于实际发生的利益冲突情形，管理人将自发现之日起5个工作日内通过管理人网站公告将利益冲突的具体情形及管理人的处理安排等告知投资者。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|                            | <p><b>终止和清算</b></p> <p>有下列情形之一的，本计划应当终止：</p> <p>1、本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、本计划存续期间，持续5个工作日投资者少于2人；</p> <p>6、本计划成立后，未在基金业协会完成备案或未通过基金业协会的产品备案或未取得产品的备案确认函的，则管理人有权终止本计划，且不承担任何责任；</p> <p>7、不可抗力力的发生导致本计划不能存续；</p> <p>8、因监管政策或监管规则的变化导致本产品违反相关监管政策或监管规则要求的，或监管机构通知（无论是口头或书面形式的通知）管理人停止开展此类资产管理产品的，则管理人有权停止开放本计划份额的参与并终止本计划，且不承担任何责任；</p> <p>9、本计划若投资上市公司定增股票、询价转让股票及北交所战略配售股票等具有一定期限限售期的股票，在所持上市公司股票全部解禁并在资产全部变现后，管理人有权决定提前终止本计划；</p> <p>10、法律、行政法规、中国证监会规定以及本计划合同约定的其他终止情形。</p> <p>管理人应当自本计划终止之日起5个工作日内报基金业协会备案，前述第6项约定的情形除外，具体以监管机构的要求为准。</p> <p><b>资产管理计划的清算</b></p> <p>1、本计划财产清算小组</p> <p>本计划在发生终止情形起5个工作日内，由管理人和托管人组织成立本计划财产清算小组，在本计划财产清算小组接管本计划财产之前，管理人和托管人应按照本合同的约定继续履行保护本计划财产安全的职责。</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>本计划财产清算小组成员由管理人、托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员，本计划财产清算小组负责本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配，本计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>(1) 本计划终止情形发生后，由本计划财产清算小组负责统一接管本计划财产；</p> <p>(2) 本计划财产清算小组根据情况确定具体的清算期限；</p> <p>(3) 本计划财产清算小组对本计划财产进行清理和确认；</p> <p>(4) 对本计划财产进行评估和变现；</p> <p>(5) 制作清算报告；</p> <p>(6) 将清算报告报基金业协会并告知投资者，具体以监管机构的要求为准；</p> <p>(7) 对本计划财产进行分配。</p> <p>3、本计划清算费用</p> <p>清算费用是指本计划财产清算小组在进行本计划财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由本计划财产清算小组优先从本计划财产中支付。</p> <p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>依据本计划财产清算的分配方案，将本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进行分配，本合同另有约定的除外，本计划财产按照以下顺序进行分配：</p> <p>(1) 支付清算费用；</p> <p>(2) 缴纳所欠税款；</p> <p>(3) 清偿本计划债务：本计划债务主要包括应付管理费、托管费、银行间账户维护费、交易佣金、证券交易费用、银行汇划费用、销户费、管理人代表本计划及投资者处理本计划涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出等，除交易所、证券登记结算机构等自动扣缴的费用外，其他费用的清偿由管理人、托管人核对无误后，由管理人向托管人出具投资指令，由托管人复核后支付。</p> <p>(4) 按本计划投资者所持计划份额比例进行分配；</p> <p>(5) 清算后的剩余财产，原则上以货币资金形式进行分配；本合同另有约定的，从其约定；但不得违反中国证监会规定。</p> <p>本计划财产未按前述第（1）、（2）、（3）项约定进行清偿前，不得分配给本计划投资者。</p> <p>5、二次清算的处理方式</p> <p>若本计划在终止之日有未能流通变现的证券或金融产品，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或金融产品在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照投资者拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式分配给投资者，二次清算期间，管理人、托管人继续按照本合同约定计提管理费、托管费及其他费用。发生二次清算情形的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>6、延期清算的处理方式</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      | <p>本计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的,管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告,具体以监管机构的要求为准。</p> <p>7、本计划清算报告的告知安排</p> <p>清算结果由本计划财产清算小组结束后通过管理人网站向投资者进行披露,并报告基金业协会,具体以监管机构的要求为准。</p> <p>8、本计划相关账户销户</p> <p>(1) 证券类账户销户</p> <p>本计划证券类资产完成变现、结清相关权益、缴清相关费用后,管理人或托管人负责证券类账户的销户工作,销户过程中其他各方应给以必要的配合。</p> <p>(2) 银行托管账户销户</p> <p>本计划财产清算完毕后,管理人应向托管人申请注销本计划银行托管账户,托管人应予以配合。</p> <p>(3) 与本计划财产有关的其他账户的销户:由管理人与托管人协商一致后办理。</p> <p>9、本计划存续及清算期间,为支付本计划财产承担的各项税费,管理人有权预留相应金额,若预留金额不足以支付实际需缴存的税费的,差额部分由管理人通知投资者补足,管理人不负担垫付责任,投资者应当及时追加资金,不得以任何理由拒绝补足义务。</p> <p>本计划清算期间,为支付最低备付金、结算保证金,管理人应预留相应金额,若预留金额不足以支付实际需缴存的备付金、保证金金额的,差额部分由管理人通知投资者补足,管理人不负担垫付责任,投资者应当及时追加资金,不得以任何理由拒绝补足义务。</p> <p>10、本计划清算账册及文件应当由管理人自清算完毕之日起保存 20 年以上。</p> |
| 特别说明 | <p>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。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

2026 年 9 月 2 日



