方正富邦价值精选2号集合资产管理计划

计划说明书

资产管理人：方正富邦基金管理有限公司

资产托管人：华夏银行股份有限公司

目　录

一、释义 2
二、当事人及权利义务 4
三、资产管理计划的基本情况 11
四、资产管理计划的募集 15
五、资产管理计划的参与、退出与转让 17
六、资产管理计划的投资 25
七、分级安排 30
八、利益冲突及关联交易 30
九、资产管理计划的费用与税收 32
十、资产管理计划的收益分配 37
十一、信息披露与报告 38
十二、风险揭示 41

一、释义

在本合同中，除上下文另有规定外，下列用语应当具有如下含义：

1. 本合同/资产管理合同/本资产管理合同：指资产委托人、资产管理人和资产托管人签署的《方正富邦价值精选 2 号集合资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件做出的任何有效变更和补充。

2. 资产委托人：指签订本合同，委托投资单个资产管理计划初始金额不低于【40 万元】人民币（不含认购费），且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他合格投资者（在本合同中根据适用情况也称为投资者、客户或委托人）。

3. 资产管理人/管理人：指方正富邦基金管理有限公司。

4. 资产托管人/托管人：指华夏银行股份有限公司。

5. 注册登记机构：指资产管理人或其委托的经中国证监会认定的可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构。

6. 计划/本计划/本资产管理计划：指方正富邦价值精选 2 号集合资产管理计划。

7. 计划说明书：指《方正富邦价值精选 2 号集合资产管理计划计划说明书》。

8. 工作日：上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

9. 交易日：即工作日。

10. 证券账户：根据中国证券监督管理委员会有关规定和中国证券登记结算有限责任公司有关业务规则，由资产托管人为委托财产在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开设的专用证券账户。

11. 银行托管账户（资金账户）：指资产托管人根据有关规定为资产管理计划财产开立的专

门用于清算交收的银行账户。

12. 委托财产：指资产委托人合法所有并委托资产管理人管理并由资产托管人托管的作为本合同标的的财产以及对上述财产投资运作产生的损益。

13. 初始销售期间：指资产管理合同及计划说明书中载明的计划初始销售期限，自计划份额发售之日起最长不超过 60 天。

14. 本计划存续期：指本计划的成立之日起至终止日止之间的期限。

15. 本资产管理计划/计划成立日：指资产管理人取得资产管理计划验资报告后，在官网公告本资产管理计划成立之日；自成立日起，本资产管理计划正式成立。

16. 认购：指在资产管理计划初始销售期间，资产委托人按照本合同的规定购买本计划份额的行为。

17. 参与：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定参与本计划份额的行为。

18. 退出：指在资产管理计划开放日，资产委托人按照本合同的规定退出本计划份额的行为。

19. 违约退出：指资产委托人在非合同约定的退出开放日主动退出资产管理计划的行为。

20. 开放期：指资产管理计划开放参与、退出等业务的期间。

21. 销售机构（直销）：指方正富邦基金管理有限公司。

22. 不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服的客观情况。

23. 流动性受限资产：指由于法律法规、监管、本合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停

牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。

24. 7 个工作日可变现资产：包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。

二、当事人及权利义务

(一) 资产委托人

1. 资产委托人概况

全额支付参与款项、签署本合同且合同正式生效的投资者即为本合同的资产委托人。资产委托人的详细情况在合同签署页列示。

2. 资产委托人的权利

（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（如有），行使相关职权。

（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）监督资产管理人及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况。

（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。

3. 资产委托人的义务

（1）认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法。

（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担能力问卷，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。资产委托人承诺投资本计划不存在违反监管要求的产品嵌套、以投资本计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违法违规行为。

（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、税费以及因资产管理计划财产运作产生的其他费用。

（6）在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任。

（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）不得违反本合同的约定干涉资产管理人的投资行为。

（9）不得从事任何有损资产管理计划及其投资人、资产管理人管理的其他资产及资产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）及时、全面、准确地向资产管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承

受能力等基本情况。

（12）及时、全面、准确地向资产管理人提供增值税相关信息，包括委托人名称、委托人税务主体资质（一般纳税人、小规模纳税人）、银行开户信息、联系地址及电话、税务登记证（副本）复印件等信息或材料。

（13）保证不存在利用内幕信息、利益输送、非公平交易、规避信息披露义务以及通过资产管理计划实施违法违规行为或可能被认定为违法违规或违反监管机构、自律机构、交易监督机构出具的监管政策的情况。

（14）保证已按照反洗钱法律法规和监管部门的要求履行其反洗钱义务，配合资产管理人在反洗钱方面对投资者的尽职调查、资金来源和用途合法性审查、可疑交易调查和报告；

（15）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。

(二) 资产管理人

1. 资产管理人概况

名称：方正富邦基金管理有限公司

住所：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼11层（11）1101内02-11单元

统一社会信用代码：91110000717884915E

法定代表人或授权代表：何亚刚

联系人：赵静

通讯地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼11层02-11单元

邮政编码：100101

联系电话：010-57303700

2. 资产管理人的权利

（1）按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产。

（2）按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理人管理费及业绩报酬（如有）。

（3）按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利。

（4）根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人；资产管理人发现托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定，对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会。

（5）自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查。

（6）以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利。

（7）法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及资产管理合同约定的其他权利。

3. 资产管理人的义务

（1）具备开展资产管理业务所需的相关主体资格与内部授权，依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜。

（2）按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息。

（3）按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产。

（4）对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金。

（5）制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险。

（6）配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和

运作资产管理计划财产。

（7）建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，分别投资；聘请投资顾问的（如有），应制定相应利益冲突防范机制。

（8）除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产。

（9）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，依法依规提供信息的除外。

（10）公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

（11）除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资。

（12）按照本合同的约定接受资产委托人和资产托管人的监督。

（13）以资产管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

（14）召集资产管理计划份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外。

（15）按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；

（16）确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定。

（17）按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告。

（18）聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计。

（19）按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益。

（20）根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年

度等定期报告，向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

（21）办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项。

（22）建立并保存投资者名单。

（23）组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配。

（24）按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于20年。

（25）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者。

（26）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义务。

(三) 资产托管人

1. 资产托管人概况

名称：华夏银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：李民吉

授权代表：陈秀良

联系人：倪伯勤

联系电话：010-85238460

通讯地址：北京市东城区建国门内大街22号华夏银行大厦

2. 资产托管人的权利

（1）按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产。

（2）按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用。

（3）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。

3. 资产托管人的义务

（1）具备开展资产托管业务所需的相关主体资格和内部授权，安全保管资产管理计划财产。

（2）除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产。

（3）对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立。

（4）公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

（5）按规定开设和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户。

（6）复核资产管理计划资产净值和份额净值。

（7）办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项。

（8）根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见。

（9）编制托管年度报告，并向中国证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。

（10）按照法律法规要求和资产管理合同的约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理

清算、交割事宜。

（11）管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会(如有)的，由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外。

(12) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露。

（13）根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年。

（14）监督管理人的投资运作，发现资产管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会。

（15）设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员，负责财产托管事宜。

（16）国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。

三、资产管理计划的基本情况

(一) 资产管理计划的名称

方正富邦价值精选 2 号集合资产管理计划。

(二) 资产管理计划的类别

本计划为【混合类】集合资产管理计划。

(三) 是否属于基金中基金资产管理计划（FOF）或管理人中管理人资产管理计划（MOM）

本计划不属于基金中基金资产管理计划（FOF）及管理人中管理人资产管理计划（MOM）。

(四) 资产管理计划的运作方式

[定期开放式]，本资产管理计划自成立之日起，每个月开放一次，每次开放两个工作日。每个月的第一、第二个工作日为开放日

当本资产管理合同发生变更或法律法规、监管规定及自律规制发生修订，或者存在其他监管或自律机构允许情形时，资产管理人为保障投资者选择退出本资产管理计划的权利，资产管理人有权视本计划实际运作情况设定临时开放期。此等情形下，该等临时开放期安排不受前述参与和退出安排的限制。

(五) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

1.投资目标

在严格控制风险的前提下，力争实现委托资产的保值增值。

2. 主要投资方向及投资比例

本计划主要投资于以下金融工具:

1）权益类资产：股票（包括主板、创业板、科创板、港股通标的股票及其他经中国证监会核准上市的股票），公募证券投资基金（债券型和货币市场证券投资基金除外）；

2）固定收益类资产：同业存款、协议存款、同业存单、短期融资券、国债、政策性金融债券、地方政府债和央票；可转债及可交换债（仅限于公开发行）；公募债券型基金；

3）金融衍生品类资产：交易所上市交易的股指期货；

4）融资融券：股票融券及卖出、基金份额融入及卖出；

5）现金类资产：现金、国债逆回购、公募货币市场型基金。

资产委托人同意委托财产可以投资于管理人管理的符合投资范围的证券投资基金。

本计划为混合类资产管理产品，最终投资于债权类、股权类、商品及金融衍生品类资产的比例按市值计算均低于资产管理计划总资产的80%。

投资于证券投资基金的，应根据证券投资基金投资范围及比例和最新一期季报穿透计算对应类型资产的持有金额。穿透计算后，各类资产持有比例应符合混合类资产管理计划的比例要求。

3. 投资限制

（1）投资限制

除投资范围部分规定的投资比例限制外，本计划还需遵循以下限制：

1）参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，本计划所申报的金额不得超过本计划的总资产；

2）本计划总资产不得超过净资产的150%；

3）本计划不得投资除公募基金以外的其它资产管理产品；

4）本计划投资单只股票的市值不得超过计划资产净值的15%；

5）投资于一家上市公司所发行的股票占该公司总股本的比例不得超过5%；投资于一家上市公司流通股，原则上不超过该上市公司流通股本的10%（含）且该上市公司流通股本不低于5000万股；

6）资产管理人管理的全部资产管理计划及公募基金合计持有一家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%；

7）不得投资于未上市或新三板挂牌的股票；

8）本计划投资于股指期货仅以套期保值为主要目的，不进行单边投机交易；

9）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

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资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例

的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

按照《管理办法》、自律规则及其他有关规定和合同约定禁止或限制的投资事项。

（2）投资禁止行为

为维护资产委托人的合法权益，本计划不得用于下列投资或者活动：

1）承销证券；

2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

3）从事承担无限责任的投资；

4）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

5）不得直接投资于商业银行信贷资产；

6）不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；

7）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；

8）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）；

9）法律法规、监管机构、自律组织禁止的其他活动。

4. 产品风险等级

本计划为混合类资管产品，风险等级为【R4】，属于【中高】风险（最低为 R1,最高为 R5）。资产委托人应确认具备与本计划相匹配的风险识别能力和风险承担能力，愿意承担相应的投资风险。

(六) 资产管理计划的存续期限

本计划的存续期限为自本计划成立日起满【60】个月止（如到期日为非工作日，则顺延至最近一个工作日）。经资产委托人、管理人、托管人书面协商一致后，本计划可提前终止或展期。

(七) 资产管理计划份额的初始销售面值

人民币 1.00 元。

(八) 资产管理计划的最低初始募集规模

本资产管理计划成立时委托财产的初始资产净值不得低于 1000 万元人民币。

(九) 资产管理计划的分级安排

本资产管理计划不分级，设定为均等份额。每份计划份额具有同等的合法权益。

(十) 本计划份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构

本计划的估值与核算、信息技术服务由资产管理人办理，无第三方服务机构。

四、资产管理计划的募集

(一) 资产管理计划份额的募集期限、募集方式、募集对象

1. 募集期限

本计划募集期限（即初始销售期间）自计划份额发售之日起不超过 60 天，初始销售的具体时间由资产管理人根据相关法律法规规定以及本合同的约定确定，并在本计划计划说明书中披露。资产管理人可根据销售情况提前终止或延长初始销售，并在资产管理人网站及时公告，视为履行完毕提前终止或延长初始销售的程序。

资产管理人发布公告提前结束募集的，本资产管理计划自公告之时起不再接受认购申请。

2. 募集方式

本资产管理计划通过资产管理人的直销机构及其他代理销售机构进行募集。具体销售机构名单、联系方式以本资产管理计划的计划说明书为准。

3. 募集对象

委托投资本计划初始净认购金额不低于【40万元】人民币（不含认购费用），且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他合格投资者。

(二) 资产管理计划份额的认购和持有限额

认购资金应以现金形式交付。投资者首次单笔认购金额不低于【40万元】人民币（不含认购费用）并可追加认购，追加参与的最低金额为人民币10000元。本计划无最高持有限额限制。

(三) 资产管理计划份额的认购费用

1. 认购费用

本计划不收取认购费，即认购费率为0。

2. 初始销售期间认购款项及利息的处理方式

投资者的认购参与款项（不含认购费用）加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有。其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

3. 认购份额的计算

本计划每份计划份额初始面值均为人民币1.00元。

本计划的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算方法如下：

（1）净认购金额= 认购金额/（1＋认购费率）；

（2）认购费用= 认购金额-净认购金额；

（3）认购份额=（净认购金额＋认购利息）/ 认购份额初始面值。

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计划资产；多笔认购时，按上述公式进行逐笔计算。

(四) 初始销售期间的认购程序

1. 资产管理人委托销售机构进行销售的，由销售机构代为完成对投资者的尽职调查工作，并将相关资料提供给资产管理人。

2. 认购程序。资产委托人办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

3. 认购申请的确认。认购申请受理完成后，投资者不得撤销。销售网点受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。认购申请采取时间优先、金额优先原则进行确认。申请是否有效应以注册登记机构的确认并且资产管理合同生效为准。投资者应在本合同生效后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额。认购申请一经受理，不得撤销。

(五) 初始认购资金的管理及利息处理方式

资产管理人应当将资产管理计划初始募集期间客户的认购资金存入资产管理计划募集结算专用账户，在资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用。投资者的认购参与资金（不含认购费用）在初始募集期间发生的利息收入按不低于银行活期存款利率（税后）计算。该利息收入在初始募集期结束后折合成计划份额，归资产委托人所有。利息转份额以注册登记机构的记录为准。

五、资产管理计划的参与、退出与转让

(一) 参与和退出场所

本资产管理计划参与和退出场所为资产管理人的直销网点的营业场所。

(二) 参与和退出的开放日和时间

本资产管理计划自成立之日起，每个月开放一次计划份额的参与和退出，每次开放两个工作日。每个月的第一、第二个工作日为开放日。本计划定期开放，就上述开放事宜不再另行公告。具体办理时间为9：00至15：00。

若中国证监会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，资产管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知资产委托人。资产管理人提前在其官方网站上发布公告即视为履行了告知义务。

(三) 临时开放期的触发条件、程序及披露事项

当本资产管理合同发生变更或法律法规、监管规定及自律规则发生修订，或者存在其他监管或自律机构允许情形时，资产管理人为保障投资者选择退出本资产管理计划的权利，资产管理人有权视本计划实际运作情况设定临时开放期。此等情形下，该等临时开放期安排不受前述参与和退出安排的限制。

临时开放期的具体安排以资产管理人公告为准，届时资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

本计划临时开放期只接受退出申请，不接受参与申请。

（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认等

1. “未知价”原则，即资产管理计划的参与和退出价格以受理申请当日收市后计算的资产管理计划份额净值为基准进行计算。

2. 资产管理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。

3. 资产委托人办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以各销售机构（如有）的具体规定为准。

4. 当日的参与和退出申请可以在当日开放时间结束且管理人受理前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

5. 参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在 T+1 日对资产委托人参与、退出申请的有效性进行确认。投资者可在一个开放周期结束后至各销售网点查询最终确认情况。

6. 违约退出的程序。

本计划不接受委托人的违约退出。

7. 参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，则为无效申请，已交付的委托款项将退回资产委托人。资产委托人退出申请成交后，资产管理人应按规定向资产委托人支付退出款项，退出款项自申请之日起 T+7 个工作日内支付退出款项，若有特殊情况可协商处理。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。

8. 资产管理人在不损害资产委托人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日以邮件或公告方式告知资产委托人。

(四) 参与和退出的金额限制

投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，应符合合格投资者标准。如投资者在提交参与申请时未持有资产管理计划份额，则首次单笔参与金额应不低于【40 万元】人民币（不含参与费用），追加参与的最低金额为人民币 10000 元。

当资产委托人持有的计划份额资产净值高于【40 万元】人民币时，委托人可以选择全部或

部分退出资产管理计划份额；选择部分退出资产管理计划份额的，资产委托人在退出后持有的计划份额资产净值不得低于【40 万元】。当资产管理人发现资产委托人申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划份额资产净值低于【40 万元】人民币的，资产管理人有权适当减少该委托人的退出金额，以保证部分退出申请确认后委托人持有的计划份额资产净值不低于【40 万元】。当资产委托人持有的计划份额资产净值低于【40 万元】人民币（含【40 万元】人民币）时，需要退出计划的，资产委托人必须选择一次性全部退出资产管理计划。

在符合上述规定的前提下，资产管理人可根据市场情况，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制，资产管理人进行前述调整必须提前 3 个工作日以邮件或公告方式告知资产委托人。

(五) 参与和退出的费用

1.参与费用

本计划不收取参与费，即参与费率为 0。

2.退出费用

委托人在开放日退出本资产管理计划，不收取退出费，即退出费率为 0。

(六) 参与份额的计算方式、退出金额的计算方式

1.参与份额的计算方式

本计划的参与金额包括参与费用和净参与金额。计算方法如下：

（1）净参与金额=参与金额/（1＋参与费率）；

（2）参与费用=参与金额-净参与金额；

（3）参与份额=净参与金额/参与申请日资产管理计划份额净值。

参与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计划资产；多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。

2.退出金额的计算方式

（1）退出总额＝退出份额×退出申请日资产管理计划份额净值

（2）退出费用=退出总额×退出费率

（3）退出金额=退出总额-退出费用-业绩报酬（如有）

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。

(七) 巨额退出、连续巨额退出及单个委托人大额退出的认定及处理方式

1.巨额退出的认定

单个开放日中，本资产管理计划需处理的净退出申请份额（退出总份额扣除参与总份额后的余额）超过计划上一工作日总份额的20%时，即认为本资产管理计划发生了巨额退出。

2.巨额退出的顺序、价格确定、款项支付及通知

出现巨额退出时，资产管理人可以根据本资产管理计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分延期退出。

（1）接受全额退出：当资产管理人认为有能力兑付资产委托人的全部退出申请时，按正常退出程序执行，但退出款项支付时间可适当延长，最长不应超过15个工作日。

（2）部分延期退出：当全额兑付资产委托人的退出申请有困难，或兑付资产委托人的退出申请进行的资产变现可能使资产管理计划资产净值发生较大波动时，资产管理人可在该工作日接受部分退出申请，其余部分的退出申请在后续工作日予以受理。对于需要部分延期办理的退出申请，除资产委托人在提交退出申请时明确做出不参加顺延下一个工作日退出的表示外，

自动转为下一个工作日退出处理，转入下一个工作日的退出申请的退出价格为下一个工作日的资产管理计划份额净值，以此类推，直到全部退出为止，但是若下一个工作日为非退出开放日，则委托人的退出申请在开放期最后一个工作日全部处理，退出价格为该日的资产管理计划份额净值。部分退出导致资产委托人持有的计划资产净值低于【40万元】人民币的，资产管理人可按全额退出处理。发生部分延期退出时，资产管理人可以适当延长退出款项的支付时间，但最长不应超过15个工作日。

（3）巨额退出的通知：当发生巨额退出并部分延期退出时，资产管理人应当在3个交易日内邮件或公告通知资产委托人，并说明有关处理方法。

3.连续巨额退出的认定

如果本计划连续两个开放日以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

4.连续巨额退出的顺序、价格确定、款项支付及通知

（1）本计划发生连续巨额退出的，如本计划支付委托人的退出申请可能会对本计划的资产净值造成较大波动，管理人可以暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项。暂停和延缓期限不得超过20个工作日。

（2）连续巨额退出的通知：当发生连续巨额退出时，资产管理人应当以邮件或公告方式在3个交易日内通知资产委托人，并说明有关处理方法。

5.单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

本计划不设单个委托人大额退出限制。

(八) 拒绝或暂停参与、暂停或延期退出的情形及处理

1. 在如下情况下，资产管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：

（1）资产管理计划份额持有人达到200户。

（2）根据市场情况，资产管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对资产管理计划业绩产生负面影响，从而损害现有资产委托人的利益的情形。

（3）因资产管理计划收益分配、或资产管理计划内某个或某些证券进行权益分派等原因，使资产管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有资产委托人利益的。

（4）资产管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他资产委托人利益的。

（5）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定拒绝接受某些资产委托人的参与申请时，参与款项将退回资产委托人账户。

2. 在如下情况下，资产管理人可以暂停接受投资者的参与申请：

（1）因不可抗力导致无法受理资产委托人的参与申请。

（2）证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。

（3）发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值情况。

（4）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当以邮件或公告的方式告知资产委托人。在暂停参与的情形消除时，资产管理人应及时恢复参与业务的办理并以邮件或公告的方式告知资产委托人。

3. 在如下情况下，资产管理人可以暂停或延期接受资产委托人的退出申请：

（1）因不可抗力导致资产管理人无法支付退出款项。

（2）证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。

（3）发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情况。

（4）部分委托人退出导致全体委托人数量低于2人的。

（5）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，资产管理人应当及时以邮件或公告的方式告知资产委托人。在暂停退出的情况消除时，资产管理人应及时恢复退出业务的办理并及时以邮件或公告的方式告知资产委托人。

(九) 份额转让

资产委托人可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的资产管理计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。

转让后，持有本资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过200人。资产管理人应当在本资产管理计划份额转让前，对受让人的合格投资者身份和资产管理计划的投资者人数进行合规性审查。受让方首次参与本资产管理计划的，应当先与资产管理人、资产托管人签订资产管理合同。

(十) 非交易过户的认定及处理方式

1. 资产管理人及注册登记机构只受理继承、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”是指资产委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将资产委托人持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2. 办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

(十一) 如资产管理人以自有资金参与本计划，应当符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按照《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司股东会、董事会或者其他授权程序的批准。

资产管理人自有资金所持的本计划份额，与资产委托人所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。

资产管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。参与、退出时，应当提前5个工作日以公告或其他委托人和托管人认可的方式进行告知。

资产管理人以自有资金参与本计划的份额不得超过计划总份额的20%。资产管理人及其附属机构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%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，资产管理人应当及时调整达标。

为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，资产管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出本计划可不受前述规定的限制，但应当及时以公告或者其他委托人和托管人认可的方式进行告知，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。

(十二) 资产管理人应定期将本计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

六、资产管理计划的投资

投资目标

在严格控制风险的前提下，力争实现委托资产的保值增值。

投资范围及比例

本计划投资范围为符合国家有关管理部门规定的资产管理计划可实施投资的金融产品，且符合《运作规定》组合投资的要求。本计划投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配。

投资范围具体包括：

1）权益类资产：股票（包括主板、创业板、科创板、港股通标的股票及其他经中国证监会核准上市的股票），公募证券投资基金（债券型和货币市场证券投资基金除外）；

2）固定收益类资产：同业存款、协议存款、同业存单、短期融资券、国债、政策性金融债券、地方政府债和央票；可转债及可交换债（仅限于公开发行）；公募债券型基金；

3）金融衍生品类资产：交易所上市交易的股指期货；

4）融资融券：股票融券及卖出、基金份额融入及卖出；

5）现金类资产：现金、国债逆回购、公募货币市场型基金。

资产委托人同意委托财产可以投资于管理人管理的符合投资范围的证券投资基金。

本计划为混合类资产管理产品，最终投资于债权类、股权类、商品及金融衍生品类资产的比例按市值计算均低于资产管理计划总资产的80%。

本合同生效之日起6个月建仓期内及本合同终止前10个交易日内，本计划投资可以不受上述比例限制。

资产管理计划完成备案前不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

特别提示：本计划可按照法律法规、交易所等规定参与债券回购。

投资比例超限的处理方式及流程

对于超过本合同约定投资范围和比例的投资，管理人、委托人及托管人应事先签订补充协议。如法律法规或监管机构以后允许投资的其他品种，经资产委托人、资产管理人、资产托管人协商一致，并签订补充协议后，可以将其纳入本计划投资范围。

由于证券市场波动、上市公司合并、组合规模变动等资产管理人之外的原因导致的本委托财产投资不符合本合同投资范围、投资限制约定的投资比例的，资产管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的15个交易日内调整至符合相关要求。法律法规另有规定的从其规定。

资产管理计划的类型及风险收益特征

本集合资产管理计划风险等级为【R4（中高风险）】。

投资策略

1.资产配置策略

根据宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境等数据信息，根据资产管理人战略资产配置框架和战术资产配置框架，在进行综合的对比分析和评估后确定资产配置方案，即确定计划分配在股票、债券、现金及衍生品的投资比例；

2．上而下的股票投资策略

以宏观经济趋势为起点，挑选优势行业、高景气度行业中具备代表性的企业。对个股的选择标准包括行业地位、财务健康状况、盈利能力和盈利趋势等能够反映企业盈利能力和持续性的指标，在此基础上根据资产配置策略形成的仓位决策，决定个股配置合计比例。

3．低波动、多策略固定收益品种投资策略

固定收益品种投资的策略应该是多元化的，其中心是在保持风险在相对低的情况下从全方位的债券投资策略中选取最优的投资想法，其中包括利率方向性判断、相对价值判断、信用利差分析以及对固定收益类衍生产品的合理运用。本计划所采用的固定收益投资策略主要包括：（1）买入持有策略；（2）债券类属配置策略；（3）期限配置策略；（4）久期偏离策略；（5）信用利差策略；（6）收益率曲线策略；（7）回购放大策略；（8）骑乘策略；（9）债券替换掉期策

略；（10）相对价值策略等；

4．股指期货投资策略

基于以套期保值为目的，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、合约选择，谨慎地进行投资，旨在通过股指期货实现组合风险敞口管理的目标；

5．证券投资基金投资策略

基于对宏观经济和金融市场的判断，选择拥有与市场走势匹配的投资策略的证券投资基金，在获取市场收益的同时，充分利用机构的投资与研究能力优势，获取超额收益。

6．融资融券投资策略

在充分考虑风险和收益特征的基础上，审慎参与融资、融券交易。基于对市场行情和组合风险收益的分析，确定投资时机、标的证券以及投资比例。

投资限制

1.投资限制

（1）参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，本计划所申报的金额不得超过本计划的总资产；

（2）本计划总资产不得超过净资产的150%；

（3）本计划不得投资除公募基金以外的其它资产管理产品；

（4）本计划投资单只股票的市值不得超过计划资产净值的15%；

（5）投资于一家上市公司所发行的股票占该公司总股本的比例不得超过5%；投资于一家上市公司流通股，原则上不超过该上市公司流通股本的10%（含）且该上市公司流通股本不低于5000万股；

（6）资产管理人管理的全部资产管理计划及公募基金合计持有一家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%；

（7）不得投资于未上市或新三板挂牌的股票；

（8）本计划投资于股指期货仅以套期保值为主要目的，不进行单边投机交易；

（9）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

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资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

按照《管理办法》、自律规则及其他有关规定和合同约定禁止或限制的投资事项。

2.投资禁止行为

为维护资产委托人的合法权益，本计划不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（5）不得直接投资于商业银行信贷资产；

（6）不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；

（7）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；

（8）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）；

（9）法律法规、监管机构、自律组织禁止的其他活动。

（七）建仓期

自本合同生效之日起【6】个月内为本计划的建仓期，建仓期内本计划不受上述投资组合比例中【最终投资于债权类、股权类、商品及金融衍生品类资产的比例按市值计算均低于资产管理计划总资产的80%】的限制。在上述期间内，本计划的投资范围、投资策略、风险收益特征应当符合本合同的约定。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。

建仓期结束后，本计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和本合同约定的投资范围和投资比例。

（八）投资政策的变更

经资产委托人、资产管理人与资产托管人书面协商一致，可就投资范围和投资限制等投资政策做出调整进行变更，变更投资政策应以本合同补充协议的形式作出。投资政策变更应为调整投资组合（即资产管理计划实际投资标的组合）留出必要的时间。

七、分级安排

本计划不设分级安排。

八、利益冲突及关联交易

（一）可能存在利益冲突情形及处理方式

资产委托人知悉，尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：资产管理人、资产

托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；资产管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。资产委托人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

此外，资产管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。资产委托人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

（二）可能存在关联交易情形及处理方式

资产委托人知悉并同意，资产管理人可以在本计划投资范围内运用委托财产从事关联交易，包括投资于资产管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，资产管理人及其下属机构管理的金融产品，租用资产管理人关联方提供的证券交易单元等关联交易情形，但资产管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行，公平对待委托财产。资产委托人认可此等关联交易情形的存在并自愿承担相关投资风险。

委托财产从事关联交易的，应事后及时、全面、客观的向资产委托人和托管人进行披露，资产管理人应至少通过季度报告向资产委托人和托管人披露上述关联交易情况。其中，资产管理人运用委托财产投资于资产管理人及其控股股东、实际控制人或下属公司发行的证券或者承销期内承销的证券等重大关联交易，应事先逐笔取得资产委托人同意，并有充分证据证明未损害投资者利益；其他关联交易无需逐笔申请授权。资产管理人应于上述重大关联交易发生之日

起5个工作日内告知投资者和托管人，并向证券投资基金业协会和中国证监会相关派出机构报告。

资产委托人应事前就其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知资产管理人。若资产委托人未能事前就其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知资产管理人致使资产管理计划财产发生违规投资行为的，由过错方承担相应责任。

九、资产管理计划的费用与税收

(一) 资产管理业务费用的种类

1. 资产管理人的管理费和业绩报酬；

2. 资产托管人的托管费；

3. 计划相关账户开立及维护费用；

4. 计划的证券交易费用（包括但不限于印花税、佣金、过户费以及其他证券交易费用）；

5. 相关税费；

6. 资产管理人参加或委托他人代为参加诉讼或仲裁而产生的本计划争议解决相关费用，包括但不限于诉讼（仲裁）费、律师费、差旅费、执行费、保险费、保全费及其他必要费用。

7. 资产管理合同生效后与之相关的会计师费、律师费和审计费用；

8. 资产管理计划财产的银行汇划费用；

9. 资产管理合同生效后与之相关的信息披露费用；

10. 按照国家有关规定和本合同约定，可以在计划资产中列支的其他费用。

(二) 上述费用根据有关法规及本合同的约定，按费用实际支出金额列入当期费用由资产托管人根据资产管理人指令从当期委托财产中支付。

(三) 不列入资产管理业务费用的项目

1.资产管理人和资产托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或委托财产的损失，处理与本委托财产运作无关的事项发生的费用以及其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入计划费用的项目不列入委托财产运作费用。

2.资产管理计划成立前发生的费用不得在计划资产中列支。

(四) 资产管理人的管理费

本计划委托财产的年管理费率为[1.5%]。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷当年天数

H 为每日应计提的委托财产管理费

E 为前一日委托财产净值

委托财产管理费自计划成立日起（除成立日外），每日计提，按自然季度支付。资产管理人于每自然季度首日起第三个工作日向资产托管人发送管理费支付指令，托管人复核后于第三个工作日从委托资产中支付管理费。若因不可抗力或持有的委托财产无法及时变现致使无法按时支付的，则在不可抗力或无法变现的情形消除后的首个工作日支付。

收取管理费的银行账户为：

账户名称：方正富邦基金管理有限公司

账号：11001007200059507043

开户银行：中国建设银行北京西四支行

(五) 资产托管人的托管费

本计划的年托管费率为【0.05】%。托管费的计算方法如下：

H=E×【0.05】%÷365

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的计划财产净值

委托财产托管费自计划成立日起（除成立日外），每日计提，按自然季度支付。资产管理人于每自然季度首日起第三个工作日向资产托管人发送托管费支付指令，资产托管人复核后于第三个工作日从计划财产中一次性支付给资产托管人。若因不可抗力或持有的委托财产无法及时变现致使无法按时支付的，则在不可抗力或无法变现情形消除后的首个工作日支付。

资产托管人指定的接收托管费的银行账户信息：

账户名称:华夏银行托管手续费收入

账号:7995000129019950

开户银行:华夏银行股份有限公司总行

(六) 费用调整

资产管理人和资产托管人与资产委托人协商一致，可根据市场发展情况调整管理费率和托管费率。

(七) 资产管理人的业绩报酬

本集合计划提取业绩报酬。

1、管理人收取业绩报酬的原则：按委托人每笔认购或参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

集合计划分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金。在委托人退出或本集合终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。

如本集合计划开通份额转让，可在委托人转出其份额时收取业绩报酬，具体规定以管理人公告为准。

本集合计划业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，因委托人退出资产管理计划，管理

人按照合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

本集合计划的业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的标准，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。

2、业绩报酬的计提方法：

业绩报酬基准日为本集合计划分红除权日的前一个工作日、委托人退出申请日或计划终止日。

委托人退出时，按照“先进先出”法，分别计算退出份额中对应的每一笔参与份额应收的业绩报酬。

期间年化收益率计算：

期间年化收益率 R= [(P1- P0)/ P0X] ×(365÷T)

P1=委托人本次计提业绩报酬基准日的份额累计净值

P0=委托人认购日或参与申请日或上一次成功计提业绩报酬基准日的份额累计净值

P0X=委托人认购日或参与申请日或上一次成功计提业绩报酬基准日的份额净值

T=委托人上一个成功计提业绩报酬的分红除权日（若无，则认购份额为集合计划成立日，参与份额为参与确认日）至退出确认日或计划终止日或本次计划分红除权日之间的自然日天数（算头不算尾）

管理人以超额累进比例的方式提取业绩报酬

具体计算方式如下：

期间年化收益率（R） 收取比例 业绩报酬

R≤10% 0 E=0

10%<R 10% E=N×P0X×（R-10%）×10%×(T÷365)

E=每笔参与对应的业绩报酬

N 的定义如下：

① 在分红和集合计划终止时计提业绩报酬的：

N=每笔委托人分红除权日或计划终止日持有的份额数

② 在委托人份额退出时计提业绩报酬的：

N=每笔委托人退出申请时的份额数

将所有参与笔数的业绩报酬加总，得到总的业绩报酬（∑E)。

∑E=E1+E2+E3+……+En 其中的 n 为所对应的参与笔数。

如果法律法规后续对管理人收取的业绩报酬比例有最高上限要求时，管理人将按照合同变更约定程序进行向下调整，无须另行征求委托人的意见。

3、业绩报酬的支付：

由于涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人负责计算并复核，托管人于本集合计划业绩报酬计提日起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

资产管理人向资产托管人发送划款指令，资产托管人根据资产管理人指令从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人。

(八) 资产管理业务的税收

本计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家或所投资市场所在国家或地区税收法律、法规执行。

本资产管理计划在投资和运作过程中如发生增值税等应税行为，相应的增值税、附加税费以及可能涉及的税收滞纳金等由委托财产承担，届时资产管理人可通过本计划托管账户直接缴

付，或划付至资产管理人账户并由资产管理人按照相关规定申报缴纳。如果资产管理人先行垫付上述增值税等税费的，资产管理人有权从委托财产中划扣抵偿。

计划存续期间和清算期间，为支付计划财产承担的各项税费、备付金，资产管理人有权根据估算情况预留相应金额；若管理人预留金额不足以支付实际需缴存的备付金、保证金金额的，差额部分由管理人与委托人届时协商沟通相关缴纳事宜。

十、资产管理计划的收益分配

(一) 可供分配利润的构成

本资产管理计划可供分配利润为截至收益分配基准日计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

资产管理计划收益包括：计划投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入。因运用委托财产带来的成本或费用的节约计入收益。

(二) 收益分配原则

1、每一份额享有同等分配权。

2、在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，本集合计划可以进行收益分配，收益分配频率为满一年分配一次，分配比例不超过分配基准日全部可分配收益的 100%，具体安排以管理人通知为准。

3、本资产管理计划收益分配方式为现金分红。

4、分配的基准日为可供分配收益的计算截至日。

5、现金红利发放日在收益分配基准日（不含）后5个工作日内。

6、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

(三) 收益分配方式:

本计划以现金红利方式向资产委托人分配收益。

(四) 收益分配方案的确定、通知与执行方式

本计划的收益分配基准日由管理人确认。

计划收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、计划收益分配对象、分配时间、分配方式等内容。

计划收益分配方案由资产管理人拟定，并由资产托管人复核后确定。资产管理人通过网站公告、传真、电子邮件等方式之一将收益分配方案通知资产委托人。

在收益分配方案公布后，资产管理人依据具体方案的规定就支付的现金收益向资产托管人发送划款指令，资产托管人按照资产管理人的指令及时进行现金收益的划付。

十一、信息披露与报告

(一) 向资产委托人提供的报告

1. 年度报告

年度报告应当披露报告期内本资产管理计划运作情况，包括但不限于下列信息:

（一）资产管理人履职报告;

（二）资产托管人履职报告;

（三）资产管理计划投资表现;

（四）资产管理计划投资组合报告;

（五）资产管理计划运用杠杆情况（如有）;

（六）资产管理计划财务会计报告;

（七）资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式;

（八）资产管理计划投资收益分配情况;

（九）投资经理变更、重大关联交易等涉及资产委托人权益的重大事项；

（十）中国证监会规定的其他事项。

资产管理人应当在每年度结束后 4 个月内向资产托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供资产托管人复核，资产托管人复核资产管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于每年度结束之日起四个月内向资产管理人提供对当期财务会计报告、年度报告的复核意见等。资产管理人、托管人应当在每年结束之日起 4 个月内向资产委托人披露年度报告。资产管理计划成立未满 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，不编制当期的年度报告。

2. 季度报告

季度报告应当披露报告期内本资产管理计划运作情况，包括但不限于下列信息：

（一）资产管理人履职报告；

（二）资产托管人履职报告；

（三）资产管理计划投资表现；

（四）资产管理计划投资组合报告；

（五）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；

（六）资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式；

（七）资产管理计划投资收益分配情况；

（八）投资经理变更、重大关联交易等涉及资产委托人权益的重大事项；

（九）中国证监会规定的其他事项。

资产管理人应当在每季度结束后 1 个月内向资产托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供资产托管人复核，资产托管人复核资产管理人季度报告、当期财务会计报告（如有）中的财务数据后，于每季度结束之日起 1 个月内向资产管理人提供资产托管人履职报告，并出具季度报告的复核意见。资产管理人应当在每季度结束之日起 1 个月内向资产委托人披露季度报告。资产管理计划成立未满 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，不编制当期的季度报告。

3. 资产管理人每周披露一次经资产托管人复核的计划份额净值。资产管理人从每次开放

期前两个工作日开始，将经资产托管人复核的每个交易日的计划财产净值向资产委托人披露，直至该次开放期结束为止。资产管理人其官方网站上发布净值数据即视为履行了披露义务。

4. 发生资产管理合同约定或可能影响委托人利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内以网站公告或邮件等的形式向委托人披露。

5. 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资产管理计划，应向委托人充分披露，管理人以公告形式或其他管理人与委托人各方认可的方式进行披露即视为向委托人充分披露。

6. 资产管理人向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式

资产管理人向资产委托人提供的报告，将严格按照监管规定及其他有关规定通过以下至少一种方式进行。资产委托人信息查询将通过以下至少一种中国证监会允许的、本合同约定的方式进行。

（1）网站

资产管理合同、资产管理人向资产委托人提供的报告等有关本资产管理计划的信息将在资产管理人网站上披露，资产委托人可随时查阅。

（2）邮寄服务

资产管理人或代理销售机构（如有）向资产委托人邮寄资产管理人向资产委托人提供的报告等有关本计划的信息。资产委托人在合同签署页上填写的通信地址为送达地址，通信地址如有变更，资产委托人应当及时通知资产管理人。

（3）传真或电子邮件

如资产委托人留有传真号、电子邮箱等联系方式的，资产管理人也可通过传真、电子邮件等方式将报告信息通知资产委托人。

(二) 资产托管人向资产委托人提供计划财产托管情况查询的方式

资产托管报告置于托管人办公地点备查，委托人可在营业时间前来查询。

(三) 向中国证监会提供的报告

资产管理人、资产托管人应当根据法律法规和监管机构的要求履行报告义务。

十二、风险揭示

（一）特殊风险揭示

1、未在证券投资基金业协会完成备案的风险：

本计划成立后，管理人须向中国证券投资基金业协会办理基金备案手续。如因管理人未履行备案手续或者本计划不符合备案要求等原因致使本计划备案失败，则将导致本计划不能按照合同约定进行投资或提前终止，从而给本计划财产带来损失的风险。

2、本计划的特殊风险：

（1）特定的投资方法及资产管理计划财产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

本计划为混合类产品，风险等级为R4，其预期收益和预期风险水平高于固定收益类产品，低于权益类产品。

本计划为非保本产品，投资范围包含股票、股票型证券投资基金、港股、期货等投资品种，面临净值波动较大的风险。

本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过150%。

1）本计划投资范围包含股票，股票投资风险主要包括：

① 上市公司经营风险：上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如 产品所投资的上市公司经营不善，与其相关的证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使产品投资的收益下降。

② 流动性风险：证券市场受到市场行情、投资情绪等诸多因素的影响，某些实际成交活跃、流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本或出现变现困难，对产品投资造成不利影响。

2）本计划投资范围包含港股,港股投资风险主要包括：

① 海外市场风险

本计划在参与港股市场投资时将受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险。

② 股价波动较大的风险

港股市场实行 T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，本计划的波动风险可能相对较大。

③ 汇率风险

本计划在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率，港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率，本计划可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本计划在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本计划将因此而遭遇资金被额外占用进而降低投资效率的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

④ 港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有总额度以及每日额度上限的限制；本计划可能因为港股通市场总额度或每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。

⑤ 港股通可投资标的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围

限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入，本计划可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

⑥ 港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易），而导致计划所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应而造成其价格波动骤然增大，进而导致本计划所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

⑦ 交收制度带来的流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本计划在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本计划可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险。

⑧ 港股通标的权益分派、转换等的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本计划因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本计划存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

⑨ 香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时,上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地A股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与A股市场对存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记(例如，ST及*ST等标记)以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板,联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得联交所上市公司的退市情形较A股市场相对复杂。

因该等制度性差异,本计划可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给计划带来损失的风险。

⑩ 港股通规则变动带来的风险

本计划是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资,受港股通规则的限制和影响;本计划存在因港股通规则变动而带来投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

3）本计划投资范围包含债券,债券投资风险主要包括：

① 利率风险：对于债券投资而言，利率风险是最重要的系统性风险。利率的变化将直接导致债券价格的变化并改变市场参与者对于后市利率变化方向及幅度的预期,影响本计划的收益水平，此外，利率的变化将带来票息的再投资风险，对计划的收益造成影响。

② 政策风险：因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、产业政策、区域发展政策，进出口贸易政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

③ 经济周期风险：宏观经济运行具有周期性的特点，宏观经济的运行状况将直接影响上市公司的经营、盈利情况，直接影响债券发行人的支付本息的能力。证券市场对宏观经济运行

状况的直接反映将影响本计划的收益水平。

④ 购买力风险：购买力风险又称通货膨胀风险，是由于通货膨胀、货币贬值造成投资者实际收益水平下降的风险。

⑤ 信用风险:指本计划在交易过程发生交收违约,或者计划所投资债券发行人出现违约、无法支付到期本息，或者由于债券发行人信用等级下降等原因造成的计划资产损失的风险。

⑥ 经营风险：上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致价格变动的风险。

4）本计划可投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。

投资科创板股票存在的风险包括:

① 市场风险

科创板个股集中来自新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保及生物医药等高新技术和战略新兴产业领域。大多数企业为初创型公司，企业未来盈利、现金流、估值均存在不确定性，与传统二级市场投资存在差异，整体投资难度加大，个股市场风险加大。

科创板个股上市前五日无涨跌停限制，第六日开始涨跌幅限制在正负20%以内，个股波动幅度较其他股票加大，市场风险随之上升。

② 流动性风险

科创板整体投资门槛较高，个人投资者必须满足交易满两年并且资金在50万以上才可参与，二级市场上个人投资者参与度相对较低，机构持有个股大量流通盘导致个股流动性较差，委托资产存在无法及时变现及其他相关流动性风险。

③ 信用风险

科创板试点注册制，对经营状况不佳或财务数据造假的企业实行严格的退市制度，科创板个股存在退市风险。

④ 集中度风险

科创板为新设板块，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。

⑤ 系统性风险

科创板企业均为市场认可度较高的科技创新企业，在企业经营及盈利模式上存在趋同，所以科创板个股相关性较高，市场表现不佳时，系统性风险将更为显著。

⑥ 政策风险

国家对高新技术产业扶持力度及重视程度的变化会对科创板企业带来较大影响，国际经济形势变化对战略新兴产业及科创板个股也会带来政策影响。

5）金融产品投资的风险

本计划可能投资于公开募集证券投资基金等金融产品，投资上述产品可能存在以下风险：

① 金融产品的管理人在进行投资时，如出现判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当，或未勤勉尽责进行投资管理等情形，将对本计划的收益甚至本金安全造成不利影响。

② 本计划投资于金融产品时，金融产品对应的投资范围可能与本计划的投资范围不完全一致，并可能影响到本计划的收益特征。投资者购买本计划产品即视为认可并接受该种投资方式，并自愿承担因此带来的全部风险。

③ 该等金融产品的管理人投资管理能力及其聘请的投资顾问（如有）的投资建议水平，均会对标的金融产品的收益水平产生重大影响，进而影响本计划的收益水平。

④ 该等金融产品可能并非随时开放申购、赎回，其申购、赎回的限制可能给本计划的流动性造成影响。同时，金融产品合同存续期限届满或延期期限届满，到期财产未能全部变现，存在发生延期清算、二次变现清算风险。

⑤ 金融产品估值价格无法及时获取或无法获取，将可能导致本计划无法按时估值的风险。

6）金融衍生品风险。金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

7）参与融资融券业务交易的风险

本计划可参与融资融券业务，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资融券业务特有风险。融资融券交易的风险主要包括流动性风险、信用风险等，这些风险可能会给资产净值带来一定的负面影响和损失。

2、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险：

本资产管理合同是基于基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称《合同指引》）而制定的，如本计划的投资范围、产品结构设计等存在特殊约定而无法完全适用基金业协会发布的合同指引，虽然管理人将在风险揭示书中进行特别揭示，并在合同报送基金业协会备案时出具书面说明，但仍可能因该等特殊约定与基金业协会合同指引不一致，对投资者权益造成影响。

3、计划展期或提前终止的风险

若发生本计划约定展期或提前终止情形时，将可能导致资产委托人无法按照预期安排委托财产投资或无法按时收回委托财产或委托财产收回金额不及预期等风险。

4、预警止损的风险

本计划未设置预警止损机制，由此当市场大幅下跌或遭遇其他特殊市场不利环境，本计划

可能出现本金大幅亏损的风险。

（二）一般风险揭示

1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本计划属于[R4（中高风险）]风险投资品种，仅适合能够承受中高及以上风险等级的合格投资者。

2、市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、衍生品风险等。

3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

4、流动性风险

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

5、信用风险

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

6、税收风险

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

本计划运作过程中，各类纳税主体依照国家法律法规的规定履行纳税义务。根据《营业税改征增值税试点实施办法》、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》等相关规定，自2018年1月1日起，资管产品在运营过程中发生的增值税应税行为将按相关要求进行申报纳税。届时，在本计划运作过程中所需缴纳的增值税费（如有）由本计划委托资产承担，本计划期间收益分配及计划终止清算分配时将扣除相关增值税费（如有），投资者实际收益可能会受到影响。

7、其他风险

包括但不限于关联交易风险、技术风险和操作风险、发生不可抗力事件的风险等。

（1）关联交易风险

关联交易的风险主要包括了关联交易经营风险以及关联交易的财务风险，关联交易的经营风险是指企业在关联交易的控制过程当中，由于关联双方鉴定不准确、关联交易定价不合理，以及关联交易活动中断等原因导致的各种风险，关联交易财务风险指因为关联交易会计核算不规范给企业造成的风险。

（2）技术风险

在集合资产管理业务的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等。

（3）操作风险

管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。

（4）不可抗力事件风险

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

（5）其他风险

因监管政策变化，存在监管机构书面或口头叫停本资产管理业务或禁止投资票据资产、信托产品、债权资产等相关产品的风险。

担任本集合资产管理业务管理人的基金公司或担任本集合资产管理业务托管人的资产托管机构，因停业、解散、撤销、破产，或者被有权机构撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能给投资者带来一定的风险。

资产管理人：方正富邦基金管理有限公司（公章）

2022 年 8 月