

东方红泰盈 1 号集合资产管理计划说明书

2017 年 7 月

特别提示：

本说明书依据《证券公司客户资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（以下简称《实施细则》）、《东方红泰盈 1 号集合资产管理合同》（以下简称《管理合同》）及其他有关规定制作，管理人保证本说明书的内容真实、准确、完整，不存在任何虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

委托人承诺以真实身份参与集合计划，保证委托资产的来源及用途合法，并已阅知本说明书和《管理合同》全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。本说明书对集合计划未来的收益预测仅供委托人参考，不构成管理人、托管人和推广机构保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

投资者签订《管理合同》且合同生效后，投资者即为《管理合同》的委托人，其认购或申购集合计划份额的行为本身即表明其对《管理合同》及本说明书的承认和接受。委托人将按照《管理办法》、《管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

集合计划基本信息	名称	东方红泰盈 1 号集合资产管理计划
	目标规模	本集合计划在推广期的规模上限为 50 亿份，存续期规模上限为 50 亿份。本集合计划的参与人数上限为 200 人。
	管理期限	本集合计划存续期为 5 年，符合法律法规规定及《管理合同》约定条件后可展期。
	推广期	本集合计划的具体推广期以管理人的推广公告为准。
	开放期	本集合计划成立后每个工作日开放。 业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。 若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，管理人将视情况对办理参与及/或退出的日期及时间进行相应的调整并公告。 本集合计划开放期内，管理人可视本集合计划运营情况在开放期保持适当比例的现金，以保持本集合计划整体流动性充足。
	份额面值	人民币 1.0000 元。
	最低金额	初次参与的最低金额为人民币 100 万元（含参与费，下同），追加参与不设最低参与金额要求。
	相关费率	1、参与费： （1）认购费：免收； （2）申购费：免收； 2、退出费：免收； 3、管理费：0.3%/年 4、托管费：0.03%/年 5、业绩报酬：免收； 6、其他费用：除交易手续费、印花税、管理费、托管费之外的集合计划费用，由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入费用，从集合计划资产中支付。 7、上述费用、业绩报酬及其他费用的详细情况详见《管理合同》第十三部分“集合计划的费用、业绩报酬”的相关约定。
	投资范围	1、投资范围 固定收益类证券：银行间市场或交易所市场交易的国债、央行票据、地方政府债（含地方政府一般债、地方政府专项债）、各类金融债（含政策性金融债、商业银行二级资本债、次级债、混合资本债、保险公司债、证券公司债等）、企业债、公司债、资产支持证券、资产支持票据、短期融资券、超短期融资券、中期

		票据。 本集合计划不投资非公开发行证券。 货币市场工具：包括现金、协议存款、同业存单、银行间及交易所债券逆回购、货币市场基金等。 本集合计划可以参与银行间及交易所债券正回购，但融入资金余额不得超过资产净值的 40%。 委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券或与管理人有关关联方关系的公司承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。委托人已明确知悉因上述关联交易可能导致的管理人/管理人关联方双重管理及收费等事项及风险。管理人应当遵循客户利益优先原则，交易完成 5 个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所报告。 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。 2、资产配置比例 固定收益类证券占资产净值的 0-140%； 如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起十个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的十个交易日内将投资比例降至许可范围内。法律法规另有规定的从其规定。
	风险收益特征	本集合计划为债券型产品，属于中低风险（R2）和期望收益的产品，面向合格投资者推广，合格投资者累计不得超过 200 人。
	适合推广对象	适合追求资产稳健增值、同时具有相应风险承受能力且法律法规允许的个人投资者和机构投资者。 合格投资者是指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力且符合下列条件之一的单位和个人： 1、个人或者家庭金融资产合计不低于 100 万元人民币； 2、公司、企业等机构净资产不低于 1000 万元人民币。 依法设立并受监管的各类集合投资产品视为单一合格投资者。 委托人在此申明签署《管理合同》即表明委托人为已具备《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《私募投资基金监督管理暂行办法》规定要求的合格投资者。 如未来法律法规或监管机构对合格投资者有新规定的，本集合计划将按新规定执行。 委托人经过管理人和推广机构认可后方可参与本集合计划。管理人和推广机构有权拒绝未经认可的委托人参与本集合计划。
当事人	管理人	机构名称：上海东方证券资产管理有限公司 法定代表人：陈光明 通信地址：上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层 邮政编码：200010 联系电话：021-63325888
	托管人	机构名称：平安银行股份有限公司上海分行 负责人或授权代表：冷培栋 通信地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 邮政编码：200120 联系电话：021-50153647
	推广机构	上海东方证券资产管理有限公司（直销中心，不含网上交易系统） 住所：上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层 法定代表人：陈光明 管理人新增或变更本集合计划的推广机构时，将提前在管理人网站上公告。

集合计划的参与	办理时间	1、推广期参与 在推广期内，投资者在工作日内可以参与本集合计划。本集合计划的具体推广期以管理人的推广公告为准。管理人可根据集合计划销售情况在募集期限内适当延长或缩短集合计划的发售时间，并及时公告。 2、存续期参与 参与在开放期办理。本集合计划成立后每个工作日开放。业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。 若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，管理人将视情况对前述参与办理的日期及时间进行相应的调整并公告。
	办理方式、程序	(1) 投资者按推广机构的具体安排，在规定的交易时间段内办理； (2) 投资者应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔参与申请； 委托人承诺在本集合资产管理合同有效期内，不得撤销指定账户，并妥善保管账户资料，由于委托人原因造成退出款项和收益不能及时划入指定账户及由此造成的损失，由委托人承担，管理人和托管人不承担责任。委托人办理参与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《集合资产管理合同》规定的前提下，以推广机构的具体规定为准； (3) 投资者签署《管理合同》后，方可申请参与集合计划。参与申请采取“参与时间优先”原则进行。申请是否有效以登记结算机构的确认为准。参与申请经确认后，构成《管理合同》的有效组成部分； (4) 投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销； (5) 投资者于T日提交参与申请后，可于T+2日后在办理参与的推广机构查询参与确认情况。确认无效的参与申请，推广机构将退还委托人已交付的参与款项。
	参与费	(1) 认购费：免收 (2) 申购费：免收
	认购资金利息	委托人的参与资金在推广期产生的利息将折算为计划份额归委托人所有，参与资金的利息以登记结算机构的记录结果为准。
集合计划的退出	办理时间	退出在开放期办理。本集合计划成立后每个工作日开放。 业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。 若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，管理人将视情况对前述退出办理的日期及时间进行相应的调整并公告。
	办理方式、程序	(1) 退出申请的提出：委托人必须根据本集合计划推广机构网点规定的手续，在开放日的业务办理时间内向推广机构网点提出退出申请。申请退出份额数量超过委托人持有份额数量时，申请无效。 (2) 退出申请的确认：T日交易时间内提交的退出申请，委托人可在T+2日（包括该日）之后到推广机构查询退出申请的确认情况。巨额退出、连续巨额退出的情形另行约定。 (3) 退出款项的支付：委托人退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往登记结算机构，再由登记结算机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出委托人的指定账户，退出款项将在T+2日内从托管账户划出。如集合计划出现暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划款日期相应顺延。
	退出费及退出份额的计算	(1) 退出费用：免收。 (2) 退出金额的计算方法 本集合计划退出时以申请日计划单位净值作为计价基准。退出金额的计算公式如下： $\text{退出金额} = \text{T日计划单位净值} \times \text{退出份额}$ 上述计算结果均以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。
	单个委托人大额退出及预约	本集合计划不设单个委托人大额退出限制条款。

	申请	
	巨额退出 (认定标准、退出顺序、退出价格确定、退出款项支付、告知委托人的方式)	(1) 巨额退出的认定 单个开放日, 委托人当日累计净退出申请份额(退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额)超过上一工作日计划总份额数的 10%时, 即为巨额退出。 (2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付 发生巨额退出时, 管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出: 全额退出: 当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时, 按正常退出程序办理。 部分顺延退出: 当管理人认为支付委托人的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时, 管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划上一日总份额 10%的前提下, 对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请, 将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例, 确定当日受理的退出份额; 未能受理的退出部分, 委托人可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请, 管理人将在下一个工作日内办理, 并以该工作日的计划单位净值为准计算退出金额, 依此类推, 直至全部办理完毕为止, 但不得超过正常支付时间 20 个工作日, 转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。 (3) 告知客户的方式 发生巨额退出并延期支付时, 管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告, 并说明有关处理方法。
	连续巨额退出(认定标准、退出顺序、退出价格确定、退出款项支付、告知委托人的方式)	(1) 连续巨额退出的认定 如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出, 即认为发生了连续巨额退出。 (2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付 本集合计划发生连续巨额退出, 管理人可按说明书及资产管理合同载明的规定, 暂停接受退出申请, 但暂停期限不得超过 20 个工作日; 已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项, 但不得超过正常支付时间 20 个工作日, 并在管理人指定网站上进行公告。
管理人自有资金参与情况		管理人以自有资金参与本集合计划的: (一) 自有资金参与的条件 在本集合计划推广期起始日至集合计划终止日内, 管理人可以以自有资金参与本集合计划。 在本集合计划存续期间, 为应对集合计划巨额退出, 解决流动性风险, 在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下, 管理人可以自有资金参与本集合计划, 但需事后及时告知委托人和托管人, 并向相关监管机构或自律组织等报告。 管理人以自有资金参与本集合计划, 应符合《管理办法》、《细则》、《规范》和监管机构的相关规定。 (二) 自有资金参与的金额和比例 管理人自有资金持有本集合计划份额及对应的资产净值, 均不得超过相关法律法规、监管机构规定的比例。 (三) 自有资金收益分配、责任承担方式和金额 管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利, 也有承担与计划份额相对应损失的责任。 (四) 自有资金退出的条件 管理人自有资金参与部分在出现以下情况之一时, 可以退出本集合计划: 1、管理人自有资金参与份额, 满足参与时间不少于 6 个月条件时, 可与其他委托人同样办理退出业务。 2、管理人自有资金参与本集合计划的份额及对应的资产净值, 均不得超过相关法律法规、监管机构规定的比例。因集合计划规模变动(含份额、净值变动)等客观因素导致自有资金参与集合计划的比例被动达到相关法律法规、监管机构规定的预警标准或者不符合规定标准的, 管理人应当将部分自有资金参与份额在本集合计划开放期办理退出业务或非开放期间办理份额强制退出, 以使自有资金比例在相关法律法规规定的

		时限内符合法规要求。法律法规另有规定时，从其规定。 3、法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。 （五）管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于6个月，参与、退出时应当提前5个工作日告知委托人和托管人，《管理合同》另有规定的除外。 （六）为应对巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出可不受上述第（五）条限制，但需事后及时告知委托人和托管人。 （七）风险揭示 管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注计划规模变动情况，控制风险。 （八）信息披露 管理人及时在管理人指定网站公告自有资金参与及退出的相关情况。
集合计划成立的条件、时间		集合计划的参与资金总额不低于3000万元人民币且其委托人的人数为2人（含）以上，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本集合计划成立。 集合计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入证券登记结算机构指定的专门账户，不得动用。
集合计划设立失败（本金及利息返还方式）		集合计划推广期结束，在集合计划规模低于人民币3000万元或委托人的人数少于2人条件下，或推广期内发生使本集合计划无法设立的不可抗力，集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部推广费用，并将已认购资金及利息（以登记结算机构的记录为准）在推广期结束后30个工作日内退还集合计划委托人，退还完毕各方互不承担其他责任。
集合计划份额转让		集合计划存续期间，在具备可交易条件时客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。
费用、报酬	费用种类 (计提标准、方法、支付方式)	（一）集合计划费用的种类 1、管理人的管理费； 2、托管人的托管费； 3、证券交易费用； 4、本集合计划成立后的信息披露费用、登记结算费用、TA服务费； 5、本集合计划成立后的会计师费和律师费； 6、证券账户开户费； 7、因集合计划资金划付支付的银行汇划费； 8、集合计划运营过程中发生的增值税，以及与集合计划缴纳税收有关的手续费、汇款费等。除法律法规另行规定外，管理人不对委托人承担的各类税负进行代扣代缴； 9、因交易需要而产生的能明确归属于产品的第三方服务费用； 10、按照国家有关规定可以列入的其他费用。 （二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间 1、托管费： 本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的0.03%年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.03\% \div \text{当年天数}$ H为每日应支付的托管费； E为前一日集合计划资产净值。 集合计划托管费每日计提，按自然季度支付。经管理人和托管人核对后，由托管人于次季度首日起五个工作日内从委托资产中一次性支付给托管人。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。产品终止后，依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。 托管人收取托管费账户如下： 户名：待处理托管手续费

		账号：99262005300010 开户行：平安银行上海分行 大额支付号：307290002014 2、管理费： 本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为 0.3%。计算方法如下： $G=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$ G 为每日应计提的集合计划管理费 E 为前一日集合计划资产净值 集合计划管理费每日计提，按季支付。经管理人和托管人核对后，由托管人于次季度首日起五个工作日内从委托资产中一次性支付给管理人。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。产品终止后，依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。 管理人收取管理费的账户如下： 户名：上海东方证券资产管理有限公司 账号：1001244309006593163 开户行：工商银行上海市分行营业部 3、管理费和托管费的调整 管理人和托管人可协商调减管理费和托管费，并在新的费率开始实施前 3 个工作日在管理人指定网站公告。管理人公告管理费、托管费等费用的调整，应在公告前将相关公告传真至托管人，并与托管人电话确认。 4、证券交易费用：本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，作为交易成本直接扣除。 5、证券账户开户费用：证券账户开户费由托管人在开户时先行垫付，产品在证券账户开户后一个月内成立的，自证券账户开户后一个月内由托管人从集合计划中扣划；如证券账户开户后一个月内产品未能成立，由管理人在收到托管人缴费通知后的 5 个工作日内支付给托管人，托管人不承担垫付开户费用义务。 6、其他费用：其他费用由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。
	不由集合计划承担的费用	集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。
	业绩报酬	本集合计划不收取业绩报酬。
收益分配		（一）集合计划收益构成 收益包括：集合计划投资所得债券利息、基金红利、买卖证券差价、银行存款利息以及其他合法收入。计划净收益是计划收益扣除按国家有关规定可以在计划收益中提取的有关费用等项目后得出的余额。期末可供分配利润指截止收益分配基准日未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低者。 （二）收益分配的条件 集合计划单位净值不低于面值，且有可供分配利润时，管理人可以进行收益分配。 （三）收益分配原则 1、收益采用现金分配或红利再投资方式，每位委托人获得的分红收益金额或再投资份额保留小数点后两位，第三位四舍五入。 2、每一集合计划份额享有同等分配权。 3、计划收益分配基准日的单位净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于初始面值。 4、本集合计划的默认分红方式为现金分红，委托人可以选择现金分红或者红利再投资分红方式。选择采取现金分配的，管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令将收益分配款项划入登记结算机构，登记结

	算机构将收益分配款在除权除息日后3个工作日内划入相应推广机构结算账户，由推广机构划入委托人的交易账户；选择采取红利再投资方式的，分红资金按除权除息日的单位净值转成相应的集合计划份额。 5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担。 6、法律法规另有规定的从其规定。 在符合上述原则和具备收益分配条件的情况下，分红时间和分配比例由管理人根据实际情况决定。 （四）收益分配方案的确定与披露 集合计划收益分配方案中将载明集合计划收益的范围、可供分配利润、收益分配对象、分配原则、权益登记日和除权除息日、红利发放日、分配数额及比例、分配方式等内容。 集合计划收益分配方案由管理人拟定，经托管人复核后确定，并在确定之日起3个工作日内在管理人网站进行信息披露。
终止和清算	（一）有下列情形之一的，集合计划应当终止： 1、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格，而无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的； 2、托管人因重大违法、违规行为，被监管机关取消业务许可，不能继续担任集合计划托管人，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的； 3、管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，而无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的； 4、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的； 5、集合计划存续期间，本集合计划委托人少于2人； 6、经管理人、托管人及全体委托人协商一致，集合计划可以提前终止； 7、集合计划存续期满且未展期的； 8、不可抗力导致本集合计划不能存续； 9、法律、行政法规、《管理合同》及中国证监会规定的其他终止情形。 （二）集合计划的清算 1、集合计划达到终止条件管理人应通知托管人准备进入清算程序。自集合计划终止之日起5个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算； 2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布； 3、管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有集合计划相应份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给委托人，本集合计划未持有流通受限的证券，则本集合计划清算结束，注销集合计划专用证券账户和银行托管账户； 4、清算结束后5个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果； 5、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有相应份额的比例或《管理合同》的约定，以货币形式全部分配给委托人，并注销集合计划证券账户和托管账户。 6、管理费、托管费计提规则是以当日资产净值为基数在下一日计提，对于合同最后一日管理费、托管费则以当日资产净值为基数在当日计提； 7、管理人应匡算合同终止日下一个月的最低备付金及交易保证金，并保证有足够的资金进行场内清算。
特别说明	本说明书作为《管理合同》的重要组成部分，与《管理合同》具有同等法律效力。