

东方红-量化 3 号集合资产管理计划说明书

2013 年 2 月 日

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-量化 3 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内容、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。

集合计划基金	名称	东方红-量化 3 号集合资产管理计划
	类型	限额特定资产管理计划
	目标规模	本集合计划推广期规模上限为 10 亿份，存续期上限为 50 亿份。
	管理期限	不设固定管理期限。
	推广期	详见管理人推广公告
	封闭期	封闭期为成立之日起一个月，封闭期内不办理参与、退出业务。
	开放期	开放期为封闭期结束后的每个开放日,开放期内可以办理参与、退出业务。
	份额面值	人民币 1.00 元。

本 信 息	最低金额	首次参与的最低金额为人民币壹佰万元，追加参与的最低金额为人民币壹万元。
	相关费率	1、认购费：0 %；2、托管费：0.2 %；3、管理费：1.0 %；4、其他：业绩报酬
	投资范围	本集合计划的投资范围包括国内依法发行的股票、债券、证券投资基金、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、股指期货等金融衍生品、商品期货等证券期货交易所交易的投资品种，证券公司专项资产管理计划、商业银行理财计划、集合资金信托计划等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可以参与融资融券交易，也可以将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司。
	风险收益特征	低风险稳定收益产品
	适合推广对象	风险承受能力较低的投资者
当 事 人	管 理 人	上海东方证券资产管理有限公司
	托 管 人	中国工商银行股份有限公司上海市分行
	代理推广机构	东方证券股份有限公司
集 合 计 划 的 参 与	办理时间	在推广期内，投资者在工作日内可以参与本集合计划。投资者在集合计划的开放期可以办理参与本集合计划的业务。
	办理场所	代理推广机构制定营业网点
	办理方式、程序	1、以金额申请，推广期参与价格为份额面值，存续期参与价格为开放期内参与当日的集合计划单位净值； 2、投资者需要事先开设推广机构认可的交易账户，并在账户内备足参与的货币资金；若账户内参与资金不足的，推广机构不受理该笔参与申请。投资者参与申请经确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销； 3、投资者于 T 日提交参与申请后，可于 T+2 日后在办理参与的营业网点查询参与确认情况。
	参 与 费	参与费率：0

	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。
集合计划的退出	办理时间	退出在开放期内办理。
	办理场所	代理推广机构制定营业网点
	办理方式、程序	(1) 委托人按推广机构指定营业网点的安排，在开放期的交易时间段内办理。 (2) 委托人应填写交易申请表，同时其在推广机构指定营业网点必须有足够的集合计划份额。 (3) 推广机构指定营业网点受理申请表后，检查委托人持有的集合计划份额，符合退出约定的，向委托人出具回单，经委托人确认无误后，委托人退出申请成功。 (4) 委托人于 T 日提交退出申请后，一般可于 T+2 日到网点查询退出情况。 (5) 退出款项将在 T+7 日内转入委托人的交易账户。
	退出费	退出费率：0
	单个委托人 大额退出及预约申请	无
	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 指每一开放日本集合计划净退出申请份额超过上一工作日集合计划总份额的 10%，即认为是发生了巨额退出。 (2) 巨额退出的处理方式 当出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出或部分顺延退出。 1) 全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序执行。 2) 部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请有困难或认为兑付委托人的退出申请可能对计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于上一日计划总份额的 10%的前提下，对其余退出申请延期办理，但最长不得超过 20 个工作日。对于当日的退出申请，应当按单个账

		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；未能退出部分，除投资者在提交退出申请时明确选择不参加顺延退出外，选择参加顺延退出的投资者的未退出份额将自动转为下一个开放日退出处理，如在开放日内未能办理完毕，将顺延到下一个工作日。转入下一个开放日（或工作日）的退出不享有退出优先权并将以下一个开放日（或工作日）的单位净值为准进行计算，并以此类推，直到全部退出为止。委托人在提出退出申请时可选择将当日未获受理部分予以撤销。 3）当发生巨额退出并顺延退出时，管理人应立即通过在管理人的公司网站刊登公告等途径向委托人公布信息，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 本集合计划连续两个开放日（含两日）以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。 （2）连续巨额退出的处理方式 出现连续巨额退出时，管理人可采用全额退出或部分顺延退出(具体含义见前款巨额退出的处理方式)方式处理，当管理人认为有必要时，也可拒绝或暂停接受退出申请，并对已经接受的退出申请，采用全额退出或部分顺延退出方式处理。
管理人自有资金参与情况		管理人不得以自有资金参与本集合计划。
集合计划成立的条件、时间		集合计划的参与资金总额（含参与费）不低于 3 千万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 3 千万元或委托人的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部推广费用，并将已认购资金及同期利息在推广期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人。

集合计划份额转让		集合计划存续期间，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）	1、托管费: (1) 按资产净值的 0.2% 年费率计提。 (2) 按前一日计划资产净值计算，按日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日，则顺延至下一个工作日支付。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。 (3) 托管费计算方法如下： $T = i \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ 注：T 为每日应计提的托管费，i 为前一日的资产净值。 2、管理费: (1) 按资产净值的 1.0% 年费率计提。 (2) 按前一日计划资产净值计算，按日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日，则顺延至下一个工作日支付。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。 (3) 管理费计算方法如下： $G = i \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ 注：G 为每日应计提的管理费，i 为前一日的资产净值。

		3、证券交易费用：集合计划投资运作期间发生的交易佣金、印花税作为交易费用在收取时从集合计划中扣除。交易佣金的费率由管理人本着保护委托人利益的原则，按照法律法规的规定确定。 4、集合计划注册登记费用：根据中国证券登记结算有限责任公司规定的注册登记费用，按费用实际支出金额支付，列入当期计划费用。 5、集合计划成立后的信息披露费用、会计师费和律师费，以及按照国家有关规定可以列入的其他费用。 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。并由托管人根据法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期计划费用。
	不由集合计划承担的费用	集合计划推广期间的费用，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列入集合计划费用。
	业绩报酬	1、管理人收取业绩报酬的原则 (1) 按委托人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。 (2) 符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红日、委托人退出日和本集合计划终止日计提业绩报酬。 (3) 集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。在委托人退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。 2、业绩报酬的计提方法 业绩报酬计提日为本集合计划分红日、委托人退出日或本集合计划终止日。以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与当日）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准。 $R = \frac{A - B}{C} \times \frac{360}{D} \times 100\%$

		A 为业绩报酬计提日的累计单位净值； B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值； C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值； D 为上一业绩报酬计提日与本次业绩报酬计提日间隔天数； <table border="1"> <tr> <th>年化收益率 (R)</th><th>计 提 比例</th><th>业绩报酬 (H) 计算方法</th></tr> <tr> <td>R≤5%</td><td>0</td><td>$H = 0$</td></tr> <tr> <td>R>5%</td><td>20%</td><td>$H = (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360}$</td></tr> </table> 注：F 为提取业绩报酬的份额。 3、业绩报酬支付 由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于 5 个工作日内将业绩报酬划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。 管理人的业绩报酬由管理人计算和复核。	年化收益率 (R)	计 提 比例	业绩报酬 (H) 计算方法	R≤5%	0	$H = 0$	R>5%	20%	$H = (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360}$
年化收益率 (R)	计 提 比例	业绩报酬 (H) 计算方法									
R≤5%	0	$H = 0$									
R>5%	20%	$H = (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360}$									
收益分配	收益构成	收益包括：集合计划投资证券所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及已实现的其他合法收入。									
	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、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； 3、每一集合计划份额享有同等分配权； 4、在符合上述原则的前提下，本集合计划成立满六个月后，每年 12 月 31 日之前至少分配 1 次； 5、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注									

		册登记机构，注册登记机构将收益分配款划入相应推广机构结算备付金账户，由推广机构划入委托人的交易账户，现金红利在 T+7 日内划转到委托人的交易账户；选择采取红利再投资方式的，分红资金按 T 日的单位净值转成相应的集合计划单位； 6、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； 7、法律法规另有规定的从其规定。
	分配方式	现金或红利再投
	分配方案	收益分配方案中将载明收益的范围、期末可供分配利润、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。 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公告。收益分配方案确定后，按相关规定报监管机构备案。
终止和清算		(一) 有下列情形之一的，集合计划应当终止： 1、计划存续期间，客户少于 2 人； 2、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格； 3、托管人因解散、破产、撤销、丧失集合资产管理计划托管机构资格、停止营业等事由，不能继续担任托管人的职务，而无其它托管机构承受其原有权利及义务； 4、战争、自然灾害等不可抗力发生导致集合计划不能存续； 5、法律法规和中国证监会规定的其他情况。 (二) 集合计划的清算 1、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、清算结束后 7 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，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，并注销集合计划专用证券账户和资金账户； 4、清算结束后 15 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，并将清算结果报中国证券业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。 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份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给委托人。
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。