

东方红添利 5 号集合资产管理计划说明书

2015 年 6 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》)、《东方红添利 5 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	东方红添利 5 号集合资产管理计划
	目标规模	本集合计划在推广期的募集规模不超过 50 亿份, 存续期规模上限 50 亿份。本集合计划委托人数量为 2 人以上(含) 200 人以下(含)。
	管理期限	本集合计划存续期限为 10 年, 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。
	封闭期	本集合计划成立之后无封闭期。
	开放期	本集合计划成立之后的每个工作日都可以办理参与、退出本集合计划的业务。具体业务办理时间以推广机构公布时间为准(管理人通告暂停参与、退出时除外)。
	份额面值	人民币 1.00 元。
	最低金额	初次参与的最低金额为人民币 100 万元。对于本集合计划份额的持有人, 其新增参与资金的最低金额为 10 万元人民币。委托人将红利再投资不受上述限制。
	相关费率	1、认购/申购费(参与费): 免收 2、退出费/赎回费: 免收 3、管理费: 0.3%/年 4、托管费: 0.13%/年
	投资范围	本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具, 包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、中期票据、企业债、短期融资券、公司债、可转换债券(含分离型可转换债券)、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、债券型基金、货币基金、国债期货等固定收益类品种、股票(包含中小板、创业板、港股通标的股票及其他经中国证监会核准上市的股票)、股票型基金、混合型基金、股指期货等权益类品种以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 但须符合中国证监会相关规定。 经资产委托人同意, 资产管理人可投资于其他固定收益类金融产品。
	风险收益特征	本集合计划是一款以控制风险、获取稳健收益为目标, 投资于现金类和固定收益类资产为主的理财产品。本集合计划属于债券型投资产品中预期收益和风险较低的理财品种, 适合低风险、稳健收益的投资者。
	适合推广对象	经管理人认可的、中华人民共和国境内的机构投资者(法律法规禁止的除外), 以及经管理人认可的、法律法规或中国证监会允许参与本集合计划的其他投资者。投资者在参与本集合计划之前, 已经

		是推广机构的客户。 委托人应确保自身具备合格投资者条件。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： （一） 个人或者家庭金融资产合计不低于 100 万元人民币； （二） 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。 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：王国斌 通信地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层 邮政编码：200010 联系电话：021-63325888
	托 管 人	名称： 中国工商银行股份有限公司广东省分行营业部 办公地址： 广州市越秀区大沙头路 29 号工银大厦 21 楼 负责人： 沈晓东 电话： 020-83786666-2100 联系人： 蔡欢
	推广机构	1、上海东方证券资产管理有限公司 住所：上海市中山南路 318 号 法定代表人：王国斌 2、东方证券股份有限公司 住所：上海市中山南路 318 号 法定代表人：潘鑫军
集 合 计 划 的 参 与	办理时间	1、推广期参与（认购参与） 在推广期内投资者在各推广机构的工作日内可以参与本集合计划。在推广期结束到本集合计划成立之日期间不接受投资者的参与申请。 2、存续期参与 本集合计划成立之后的每个工作日都可以办理参与本集合计划的业务（管理人通告暂停参与时除外）。具体业务办理时间以推广机构公布时间为准。
	办理方式、程序	1、办理方式： 委托人同意以下列方式参与本集合计划（两种方式可选择其一或两种并行选择）： （1）委托人以推广期参与的方式购买集合计划份额，同意在提出推广期参与申请的同时支付参与金额； （2）委托人以存续期参与的方式购买集合计划份额，同意在提出存续期参与申请的同时支付参与金额。 2、办理程序：委托人必须到推广机构营业网点或通过推广机构指定网络平台签署纸质合同或签署《电子签名约定书》，之后既可以到集合计划推广机构指定营业网点的柜台申请参与集合计划，参与申请经管理人确认后有效，构成《集合资产管理合同》的有效组成部分。
	参 与 费	本集合计划参与费用免收。
	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，参与资金的利息以注册登记机构的记录结果为准。

集合计划的退出	办理时间	本集合计划成立之后的每个工作日都可以办理退出本集合计划的业务（管理人通告暂停退出时除外）。具体业务办理时间以推广机构公布时间为准。
	办理方式、程序	委托人可以在原参与集合计划的推广机构营业网点或登录原参与推广机构指定网络系统以自主下单的方式办理集合计划的退出。退出申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分。 委托人退出申请成功后，管理人应指示托管人于 T+2 日内将退出款项从集合计划托管专户划出至以集合计划名义开立的中登备付金账户，再由登记结算机构将退出款项分别划至各推广机构指定账户。推广机构收到退出款后于 2 个工作日内划往退出委托人指定的账户。 由于交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则退出款顺延至管理人及托管人无法控制的因素消除后划往委托人账户。
	退出费	本集合计划的退出费为零。
	单个委托人 大额退出及预约申请	委托人净退出申请份额(退出申请总数扣除参与申请总数后的余额)超过其上一日持有的集合计划总份额的 30% 时，需在退出日前至少 1 个工作日通知管理人，否则管理人有权拒绝其退出申请。如委托人连续提出大额退出要求，导致本集合计划面临流动性困难，管理人可视情况暂停退出，并将具体情况向委托人通告。
	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）	本集合计划不设巨额退出限制，但委托人净退出申请份额(退出申请总数扣除参与申请总数后的余额)超过其上一日持有的集合计划总份额的 30% 时，需在退出日前至少 1 个工作日通知管理人，否则管理人有权拒绝其退出申请。
	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）	本集合计划不设连续巨额退出限制，但委托人净退出申请份额(退出申请总数扣除参与申请总数后的余额)超过其上一日持有的集合计划总份额的 30% 时，需在退出日前至少 1 个工作日通知管理人，否则管理人有权拒绝其退出申请。
管理人自有资金参与情况		管理人可以自有资金参与本集合计划，且自有资金参与部分不得超过本集合计划总份额数的 20%。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，自有资金应当在符合法律法规及本合同约定的前提下进行调整。 管理人自有资金参与的份额与本集合计划其他份额承担同等风险、享有同等收益。 集合计划存续期间，公司自有资金参与计划的持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知委托人和托管人。 为应对集合计划巨额赎回，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，管理人以自有资金参与或退出集合计划可不受前款规定限制，但需事后及时告知客户和托管人，并向住所地中国证监会派出机构及监管机构指定的协会报告。
集合计划成立的条件、时间		各方一致同意，在本集合计划的推广期内，如果集合计划的参与资金总额（含参与费）不低于 3000 万元人民币且其委托人数量为 2 人（含）以上，经具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本集合计划成立，并开始运作。如果本集合计划成立，则投资者认购参与款项（不含参与费用）折算成集合计划份额，推广期内的银行存款利息在实际支付时归入集合计划资产。

集合计划设立失败（本金及利息返还方式）		各方一致同意，推广期满，集合计划参与资金总额（含参与费）未达到 3000 万元人民币，或其委托人少于 2 人，或推广期内发生使本集合计划无法设立的不可抗力事件，则本集合计划设立失败。管理人将参与本集合计划委托人的委托本金加算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。利息具体金额以管理人确认结果为准。
集合计划份额转让		集合计划份额的转让指集合计划存续期间，集合计划具备可转让条件后客户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。 管理人可以视情况开放集合计划的份额转让。管理人应在本集合计划开放份额转让前 5 个工作日通过网站公告。
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 0.13% 年费率计提。 (2) 按前一日计划资产净值计算，按日计提，按季支付。其中集合资产管理计划成立首日不计提。由托管人根据管理人的指令于次季度首日起第三个工作日从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。 (3) 托管费计算方法如下： $C = i \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ 注：C 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 0.3% 年费率计提。 (2) 按前一日计划资产净值计算，按日计提，按季支付。其中集合资产管理计划成立首日不计提。由托管人根据管理人的指令于次季度首日起第三个工作日从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。 (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、与集合计划相关的会计师费。集合计划在存续期间发生的审计费用，由集合计划承担。 4、其他事项。银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费等集合计划运营过程中发生的相关费用。 5、银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费，在发生时一次计入集合计划费用； 6、与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，不影响集合计划份额净值的，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，影响集合计划份额净值的，并且可以对应到相应会计期间，应该在该会计期间内按直线法摊销。 7、集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。
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，以及处理与本集合计划运作无关的事项发生的费用等不列入本集合计划费用。
业绩报酬		在本集合计划收益分配基准日、委托人退出日或计划终止日，将根据委托人的期间年化收益率(R)，对期间年化收益率超过预先设定的计提基准以上部分按照一定的比例提取业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）。如本集合计划展期，委托人、管理人与托管人协商一致，可对业绩报酬的提取方式、基准、比例等进行调整，并在展期公告中披露。 (1) 业绩报酬计提原则 ①按委托人每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。 ②在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划收益分配基准日、委托人退出日或计划终止日计提业绩报酬。 ③集合计划收益分配基准日提取业绩报酬的，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计划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。 ④在委托人退出或计划终止时，业绩报酬按委托人退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余部分不受影响。

		(2) 业绩报酬计提方法 业绩报酬计提日为本集合计划收益分配基准日、委托人退出日或计划终止日。业绩报酬的计提，以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（以下简称“上一个业绩报酬计提日”，如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提，推广期参与的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内参与的，以参与当日为上一个业绩报酬计提日，下同）至本次业绩报酬计提日的期间为基准。委托人退出时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔参与份额应收的管理人业绩报酬。 ①期间年化收益率计算 期间年化收益率 $R = [(P1 - P0) / P0x] \times (365 \div T)$ P1=委托人本次业绩报酬计提日的份额累计净值 P0 =委托人上一个业绩报酬计提日的份额累计净值 P0x =委托人上一个业绩报酬计提日的份额净值 T=委托人上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数 ②管理人以超额比例的方式提取业绩报酬 管理人根据期间年化收益率对收益超过预先设定的计提基准以上部分按照一定的比例分层提取管理人业绩报酬。具体计算方式如下： <table border="1"> <thead> <tr> <th>期间年化收益率</th><th>收取比例</th><th>管理人业绩报酬计算公式</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R \leq 8\%$</td><td>0</td><td>$E=0$</td></tr> <tr> <td>$8\% < R$</td><td>15%</td><td>$E = N \times P_0^* \times (R - 8\%) \times (T \div 365) \times 15\%$</td></tr> </tbody> </table> E=该笔参与对应的管理人业绩报酬 N=该笔提取业绩报酬的份额 ③将所有参与笔数的管理人业绩报酬加总，得到总的管理人业绩报酬（ΣE）。 $\Sigma E = E1 + E2 + E3 + \dots + En$ 其中的 n 为所对应的参与笔数。 业绩报酬的计算和复核由管理人完成，托管人不承担复核业绩报酬的责任。	期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式	$R \leq 8\%$	0	$E=0$	$8\% < R$	15%	$E = N \times P_0^* \times (R - 8\%) \times (T \div 365) \times 15\%$
期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式									
$R \leq 8\%$	0	$E=0$									
$8\% < R$	15%	$E = N \times P_0^* \times (R - 8\%) \times (T \div 365) \times 15\%$									
收益分配	收益构成	集合计划收益由债券利息、基金红利、股息、红利、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入构成									
	分配原则	1、同一种类集合计划份额的每一份额享有同等分配权； 2、集合计划收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值； 3、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配； 4、在符合上述分红条件的前提下，本集合计划可以进行收益分配。集合计划红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日； 5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在法律法规和监管机构允许的范围内，管理人、托管人协商一致，可以对上述收益分配条件和时间进行调整，并向委托人通告。									
	分配方式	1、集合计划默认分红方式为现金分红，投资者可以选择现金分红或红利再投资分红方式。委托人同意遵守登记结算机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制订的规则）。管理人分红时以登记结算机构登记的分红方式为准。 2、委托人可以选择将所获红利再投资于集合计划，选择采取红利再投资形式的，分红资金按分红除权日的集合计划每份额净值（免收参与费用）转成集合计划份额。集合计划份额计算要保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。									
	分配方案	集合计划收益分配方案包括集合计划收益的范围、集合计划可供分配利润、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，由管理人拟定，托管行复核收益分配金额后，由管理人通告委托人。									

终止和清算	1、各方一致同意，出现下列情形之一时，本集合计划应当终止： （1）管理人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格； （2）托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格，且在3个月内无其他适当的托管人承接托管人原有的权利和义务； （3）管理人因停业整顿、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责； （4）托管人因停业整顿、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责，且在3个月内无其他适当的托管人承接托管人原有的权利和义务； （5）存续期内，本集合计划的委托人少于2人； （6）战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续； （7）法律法规规定或本合同约定的其他情况。 委托人同意，如本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案，该方案应经委托人认可，并应予以披露。 2、管理人应当在本集合计划终止后5个工作日内成立清算组进行清算。 （1）本集合计划终止之日起20个工作日内，管理人和托管人应当在扣除集合计划管理费、托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有份额的比例或本集合资产管理合同的约定，以货币形式分配给委托人，并注销集合计划的证券账户和资金账户。 本集合计划终止后，由管理人负责集合计划的资产清算，托管人协同管理人进行必要的清算活动。 （2）管理人应按以下程序进行： ①当本集合计划终止后，对集合计划资产进行清理和确认； ②对集合计划资产进行评估和变现； ③聘请具有证券从业资格的会计师事务所进行审计； ④将清算结果报监管机构指定的协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构； ⑤将清算结果通告委托人； ⑥对集合计划资产进行分配。 （3）如本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人应根据本合同第七十条中所述的二次清算方案的规定，对该等未能流通变现的证券在可流通变现后进行变现和二次清算，并将变现后的资产按照委托人持有集合计划份额的比例，以货币形式全部分配给委托人。 （4）清算费用是指管理人在进行资产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由管理人优先从集合计划清算资产中支付。 （5）管理人应当在清算结束后15日内，将清算结果报监管机构指定的协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。 （6）集合计划清算账册及有关文件由托管人按相关法律法规规定年限妥善保存。
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。