

# 海通海蓝量化增强集合资产管理计划说明书

(第二次合同变更)

## 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》)、《海通海蓝量化增强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《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《资产管理合同》且合同生效后,投资者即为《资产管理合同》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《资产管理合同》及本说明书的承认和接受。委托人将按照《管理办法》、《资产管理合同》、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   | 海通海蓝量化增强集合资产管理计划   |
|          | 类型   | 集合资产管理计划   |
|          | 目标规模 | 推广期,本集合计划最低发行规模为1亿份,最高不超过50亿份(包含管理人自有资金参与形成的份额);存续期,本集合计划不约定规模上限。  |
|          | 管理期限 | 本集合计划不约定固定存续期限,未设计展期安排。  |
|          | 推广期  | 指自本集合计划启动推广之日起不超过60个工作日的期间,具体推广时间以本集合计划推广公告为准。   |
|          | 封闭期  | 指集合计划成立后除开放期以外的每个工作日,封闭期内不办理参与、退出业务。   |
|          | 开放期  | 各类集合计划份额运作周期结束后进入开放期。各类集合计划份额的开放期为该类集合计划份额运作周期结束的当日(如当日为节假日,则顺延至首个工作日)。开放日办理该类集合计划份额的参与、退出和同时进入开放期的各类集合计划份额之间的转换。如果集合计划份额持有人在当期运 |

|       |   |
|-------|---|
|       | <p>作期到期日未退出，则自该运作期到期日下一工作日起该类集合计划份额的本金和收益自动参与下一个运作周期且同一产品代码的集合计划份额。自动参与的产品份额按新一个运作周期的业绩基准确定计算收益。</p> <p>若管理人不再继续运作该期产品某类产品份额，则该类产品份额运作周期结束后自动退出。若管理人继续运作该期产品，则该类产品份额持有人可以在运作周期结束时选择退出或转换为当日发行的其他类份额。若该类份额持有人未在运作周期结束时退出或转换，则视为自动参与到该类下一个运作周期且同一产品代码的集合计划份额，按新一个运作周期的业绩基准确定计算收益。</p> <p>管理人有权设置临时开放期。</p>  |
| 流动性安排 | 开放日，现金类资产不低于集合计划资产净值的 10%。  |
| 份额面值  | 1.00 元。   |
| 最低金额  | 委托人首次参与金额不得低于人民币 10 万元，超过最低参与金额的部分不设金额级差。   |
| 相关费率  | <p>1、参与费：无；</p> <p>2、退出费：无；</p> <p>3、管理费：0.4%/年；</p> <p>4、托管费：具体见本合同“十三、集合计划的费用、业绩报酬和税收”中的相关约定；</p> <p>5、业绩报酬：本集合计划在扣除达到业绩基准的预期收益、各项费用及分红等后的剩余收益计入集合计划的风险准备金，每年各自然季度末若风险准备金有余额，则管理人有权提取不超过此余额的 50%作为管理人的业绩报酬。具体提取时间及提取比例由管理人公告为准。自集合计划成立后每满一年若风险准备金仍有余额且超过本集合计划存续规模 1%时，管理人有权提取不低于余额的 50%作为管理人业绩报酬。</p> <p>6、其他费用：除交易手续费、印花税、管理费、业绩报酬、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当期费用，从集合计划资产中支付。</p> |
| 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，包括国内依法公   |

|               |  |  |
|---------------|--|--|
|               |  | <p>开发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、证券回购、资产支持证券、货币市场型基金、分级基金的优先级份额、银行存款、大额存单、现金、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划等各金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及法律法规或中国证监会认可的其他固定收益类投资品种。其中，企业债、公司债、中期票据等信用债的债项评级不低于 AA，短期融资券债项评级不低于 A-1。</p> <p>本计划可参与股票质押式回购业务及其受益权。管理人有权代表本计划向第三方转让及回购股票质押式回购业务所形成的收益权，所得计入本计划财产。</p>   |
| <p>资产配置比例</p> |  | <p>(1) 固定收益类资产：占计划资产总值的 0—100%；固定收益类资产包括国债、地方政府债、中期票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持证券、债券型基金、分级基金的优先级份额、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、超过 7 日的债券逆回购及其它具有明显固定收益特征的证券等；</p> <p>(2) 现金类资产：占计划资产总值的 0—100%；开放日，不低于计划资产净值的 10%；现金类资产包括现金、银行存款、货币市场基金、大额存单、期限在 1 年内（含 1 年）的国债、期限在 1 年内（含 1 年）的政府债券、期限在 7 日以内的逆回购等；</p> <p>(3) 证券正回购：融入资金余额不超过计划资产净值的 40%，若未来监管部门相关法规对该比例限制予以修改或取消，管理人经与托管人协商一致并公告后将按照新的监管标准予以调整，无需再征得委托人同意；</p> <p>(4) 股票质押式回购：以前一工作日计划资产总值计不超过 100%。参与标的须符合以下条件：</p> <p>① 质押股票不得为 ST 和 *ST 股票（已完成实质性资产重组的 ST 类公司除外）、B 股股票、暂停上市的 A 股股票、进入退市整理期的 A 股股票。</p> <p>② 属于主板股票且为沪深 300 指数成分股的流通股票的质押率不超过 60%，其余流通股票的质押率不超过 50%，中小板流通股票的质押率不超过 45%，限售股票（解除限售时间应早于购回交易日至少一个月）及创业板流</p> |

|                      |                                     |  |
|----------------------|-------------------------------------|--|
|                      |                                     | <p>通股票的质押率不超过 40%，限售创业板股票（解除限售时间应早于购回交易日至少一个月）质押率不高于 35%。</p> <p>③单一股票质押融资金额不超过该股票近期平均流通市值的 10%，也不得超过该只股票近期日均交易金额的 10 倍。</p> <p>④质押流通股的预警线不低于 150%，平仓线不低于 130%；质押中小板股票、创业板股票以及限售股票的预警线均不得低于 160%，平仓线不得低于 140%。</p> <p>⑤组合投资多个股票质押回购标的的，投资标准可适当放宽。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以参与沪深交易所股票质押回购交易，同意并授权管理人参与沪深交易所股票质押回购交易时，由管理人代表集合计划与融入方签署《股票质押回购交易业务协议》等相关法律文件，质权人登记为管理人，由海通证券负责交易申报、盯市管理、违约处置等事宜。委托人知悉并确认管理人为海通证券 100%控股子公司。</p> <p>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联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券。交易完成起 5 个工作日内，管理人应及时书面通知托管人，通过管理人网站告知委托人，并向证券交易所报告。</p> <p>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证券公司之外的因素，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 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。</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。在投资运作前，管理人应与托管人就新增投资品的清算交收、估值核算等达成书面一致同意。</p> |
|                      | <p>风险收益特征及<br/>适合推广对象</p>           | <p>本集合计划属混合型集合资产管理计划，计划整体为中低风险产品，主要面对风险承受能力较低且对收益率有一定要求的个人投资者和机构投资者。</p>   |
| <p>当<br/>事<br/>人</p> | <p>管理人</p> <p>托管人</p> <p>代理推广机构</p> | <p>上海海通证券资产管理有限公司</p> <p>交通银行股份有限公司</p> <p>指海通证券股份有限公司（简称“海通证券”）、海通资产管理（直销）、</p>   |

|                                 |         |  |
|---------------------------------|---------|--|
|                                 |         | 交通银行股份有限公司以及与管理人签订《海通海蓝量化增强集合资产管理计划推广代理协议》的其他银行和证券公司。  |
| 集<br>合<br>计<br>划<br>的<br>参<br>与 | 办理时间    | <p>(1) 推广期参与</p> <p>推广期自本集合计划推广销售之日起至推广结束日止，最长不超过 60 个工作日，具体推广日期以本集合计划的推广公告为准。</p> <p>推广期内，当本集合计划接近或达到最高规模时，管理人有权停止接受委托人的参与申请；管理人就该等停止接受参与申请事宜及时在管理人指定网站进行披露。</p> <p>(2) 存续期参与</p> <p>本集合计划各类集合计划份额的运作周期内不开放参与和退出，各类集合计划份额各自对应的运作周期结束当日为该类集合计划份额开放日，遇节假日则顺延至下一个工作日。投资者在集合计划开放日可以办理参与业务。</p> <p>管理人有权设置临时开放期，为委托人办理参与业务，具体业务办理时间以管理人指定网站公告为准。</p>                           |
|                                 | 办理场所    | 委托人可以到推广机构的营业网点，或通过推广机构的指定系统提交参与申请。  |
|                                 | 办理方式、程序 | <p>1、参与原则</p> <p>(1) 在推广期和存续期内，各类集合计划份额在其发行日委托人以集合计划的面值（1.00 元/份额）参与；</p> <p>(2) 采用金额参与的方式，即参与以金额申请。本集合计划的单个委托人首次参与金额不得低于 10 万元人民币，超过最低参与金额的部分不设金额级差；</p> <p>(3) 委托人参与本集合计划前，应当首先是管理人或推广机构的客户；</p> <p>(4) 委托人在推广期和参与开放期内可以多次参与本集合计划，已经受理的参与申请只能在当日交易时间结束之前撤销；</p> <p>(5) 本集合计划当参与申请超过规模上限时，管理人应当暂停接受所有计划委托人的参与申请，并在清算环节以最高募集规模为上限，按“时间优先”的原则，来确定参与成功的份额，参与时间以注册登记系统的确认</p> |

|                    |   |
|--------------------|---|
|                    | <p>结果为准。</p> <p>2、参与的程序和确认</p> <p>(1) 投资者按推广机构指定的营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理；</p> <p>(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；</p> <p>(3) 本集合计划采用电子签名合同，委托人在签署电子签名合同后方可参与本集合计划。委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，管理人和代理推广机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录；特殊情况下，投资者也可以签署纸质合同；</p> <p>(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；当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销；</p> <p>(5) 投资者推广期参与的，可于计划成立后2个工作日查询参与确认情况；投资者开放期参与的，可于T+2日后查询参与确认情况。</p> |
| <p>参与费及参与金额的计算</p> | <p>1、参与费率</p> <p>本集合计划免收参与费，即参与费率为0%。</p> <p>2、参与份额的计算</p> <p>本集合计划推广期参与份额的计算方法如下：</p> <p>参与份额=参与金额÷推广期参与价格</p> <p>本集合计划开放期参与份额的计算方法如下：</p> <p>参与份额=参与金额÷开放期参与价格</p> <p>其中，本集合计划推广期参与价格与开放期参与价格均为人民币1.00元/份。</p> <p>集合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集合计划资产；多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。</p>   |
| <p>认购资金利息</p>      | <p>委托人的参与资金在推广期产生的利息在推广期结束后划入集合计划托管账户，利息金额以集合计划注册登记机构的记录为准。</p>   |
| <p>规模控制</p>        | <p>在存续期内，本计划管理人在开放日(含管理人延长参与的工作日)使用</p>   |

|                                 |         |   |
|---------------------------------|---------|---|
|                                 |         | <p>“时间优先”方法对各类集合计划份额的规模进行控制，上期集合计划份额到期日未退出的委托人在自动参与新一期集合计划份额时相对于其他委托人享有时间优先。</p> <p>当同一时间参与的委托金额导致计划规模超限，则该时间的参与及其以后的参与不能确认成功。</p>  |
| 集<br>合<br>计<br>划<br>的<br>退<br>出 | 办理时间    | <p>本集合计划各分类集合计划份额运作周期结束当日为该分类集合计划份额开放日，遇节假日则顺延至下一个工作日。退出在开放日办理。</p> <p>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。</p> <p>管理人有权设置临时开放期，为委托人办理退出业务，具体业务办理时间以管理人指定网站公告为准。</p>  |
|                                 | 办理场所    | <p>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。</p>   |
|                                 | 办理方式、程序 | <p>1、退出的原则</p> <p>(1) 存续期内，各分类集合计划份额的退出只能在该分类集合计划份额的开放日办理。若该日为非工作日，则顺延至下一个工作日。某分类集合计划份额运作周期结束后管理人有权选择是否续期；</p> <p>(2) 若持有某分类集合计划份额的委托人在该分类集合计划份额运作周期到期结束时未申请退出或转换为当日发行的其他类份额，则本金和收益自动转入为下一期运作的该分类集合计划份额；</p> <p>(3) 各分类集合计划份额到期结束时如果开放日相同的情况下，委托人也可以申请在不同分类集合计划份额之间转换；</p> <p>(4) 退出申请一经确认则不可更改或撤消。</p> <p>2、退出的程序和确认</p> <p>(1) 退出申请的提出</p> <p>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或通过推广机构的指定系统提出退出申请。委托人申请的各分类集合计划份额退出申请数量超过委托人持有的相应各分类集合计划份额数量时，申请无效。</p> |

|                |  |
|----------------|--|
|                | <p>(2) 退出申请的确认</p> <p>委托人可在 T+2 日（包括该日）之后到推广机构网点取得 T 日退出申请成交确认单，若交易未成功或数据不符，委托人可与为其办理手续的推广机构网点人员联系并进行核实。</p> <p>(3) 退出款项划付</p> <p>若注册登记机构确认委托人退出申请成功，退出款项于 T+2 日内从托管账户中划出。对于通过直销方式参与份额，退出款项可以在 T+1 日内从托管账户划出，但具体划款时间由管理人确定，最晚不超过 T+2 日。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，可以将划拨日期相应顺延。</p> |
| 退出费            | 本集合计划无退出费用，即退出费率为 0%。  |
| 退出的限制与次数       | <p>委托人单笔退出最低份额为 1000 份；若某笔退出导致该委托人在某推广机构持有的某一分类产品或份额少于 1000 份，则委托人需将余额部分一起退出，否则管理人可自动将该委托人在该推广机构的相应剩余份额退出给委托人。管理人有权对以上标准进行重新规定并及时在管理人指定网站公告。</p> <p>委托人在某一开放日内的退出次数不受限制。</p>   |
| 单个委托人大额退出及预约申请 | 本集合计划不设单个委托人大额退出限制条款，但因单个委托人大额退出导致出现巨额退出，则根据巨额退出的认定和处理方式办理。  |
| 巨额退出           | <p>1、巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(1) 巨额退出的认定</p> <p>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。</p> <p>(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>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、部分顺延退出或暂停退出：</p> <p>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。</p>                           |



|                    |  |   |
|--------------------|--|---|
|                    |  | <p>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，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。</p> <p>(3) 告知客户的方式</p> <p>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。</p> <p>2、连续巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(1) 连续巨额退出的认定</p> <p>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。</p> <p>(2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按本合同载明的规定，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。</p> |
| <p>管理人自有资金参与情况</p> |  | <p>1、参与金额（比例）</p> <p>管理人承诺在本集合计划推广期间以自有资金参与本集合计划。自有资金参与金额为本集合计划成立规模（含自有资金参与部分）的 4%，且最高不超过人民币 2 亿元。</p> <p>集合计划存续期间，管理人可以自有资金参与集合计划，参与金额不超过计划总份额的 20%，持有期限不少于 6 个月。在不影响流动性的前提下，管理人参与的集合计划份额可以退出。管理人自有资金参与、退出时，应当提前 5 日告知持有人和托管人。募集期投入且承担责任的自有资金在约定责任解除前不得退出。</p>   |

|                |   |
|----------------|---|
|                | <p>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、退出可不受上述比例限制，但需事后及时告知委托人和托管人。本集合计划因规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划比例被动超过法律、法规规定的上限时，管理人在下一个开放日退出超限部分的该类集合计划份额，退出后仍超限的，管理人将在下一个开放日继续安排退出，以此类推。同时，管理人应及时在管理人指定网站公告自有资金参与集合计划被动超限情况，包括超限比例、超限原因、处理方案等。</p> <p>2、收益分配和责任分担方式</p> <p>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。</p> <p>管理人以自有资金参与份额及收益不对委托人在本集合计划中投资的本金或收益承担任何补偿责任。</p> <p>3、风险揭示</p> <p>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，控制流动性风险。</p> <p>4、信息披露</p> <p>管理人及时在管理人网站公告自有资金参与和退出情况。</p> |
| <p>集合计划的分类</p> | <p>本集合计划的运作周期为管理人事先确定的封闭运作期间。本集合计划根据运作周期的不同分类发行，包括但不限于1个月、3个月、6个月、9个月、12个月、24个月等多个分类，各分类集合计划份额的开放参与前由管理人在指定网站上公告确定。管理人可在运作周期每期开始前设定各类集合计划份额的业绩基准，并在管理人网站公告。运作周期内本集合计划各类集合计划份额不开放参与和退出。各类集合计划份额每期运作周期到期后进入新的一期运作周期。但管理人有权选择任一类集合计划份额运作周期到期后继续运作该期产品或自动终止，但须在该类集合计划份额运作周期到期前在管理人网站公告。</p> <p>若管理人不再继续运作该期产品某类集合计划份额，则该类集合计划份额运作周期结束后自动退出。若管理人继续运作该期产品，则该类份额持</p>  |

|                             |  |
|-----------------------------|--|
|                             | <p>有人可以在运作周期结束时选择退出或转换为当日发行的其他类份额。若该类集合计划份额持有人未在运作周期结束时退出或转换，则视为自动参与到该类集合计划份额下一个运作周期且同一产品代码的集合计划份额，按新一个运作周期的业绩基准确定计算收益。</p> <p>各类集合计划份额的业绩基准仅为管理人提取风险准备金的标准，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。</p> <p>管理人可提前在管理人网站公告可供客户参与的集合计划的类别、开放参与日、到期日、开放规模上限、业绩基准、参与安排及单个账户参与规模上限及下限等规则。</p> |
| <p>集合计划成立的条件、时间</p>         | <p>推广期结束，若募集规模累计不低于人民币 1 亿元（不含管理人自有资金）、集合计划参与人数不低于 2 人（不包括管理人），且管理人已履行相应的出资义务，管理人聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所验资并出具验资报告后，即公告本集合计划成立。</p> <p>本集合计划推广期间，管理人、推广机构将委托人参与资金存入注册登记机构指定的专门账户，集合计划设立完成、开始投资运营之前，不得动用委托人的参与资金。</p> <p>本集合计划成立后 5 个工作日内，管理人将本集合计划的推广、合同签订、验资和计划设立情况报注册地中国证监会派出机构备案。</p>  |
| <p>本集合计划不能成立及其有关事项的处理方式</p> | <p>1、若本集合计划未达到成立条件或发生战争、自然灾害等不可抗力使本集合计划无法设立的，则管理人公告本集合计划设立失败。</p> <p>2、本集合计划不能成立时，管理人承担全部推广费用，并将所有委托人投入的资金总额加计银行活期存款利息在推广期结束后 30 个工作日内退还委托人。</p>   |
| <p>集合计划份额转让、非交易过户和冻结</p>    | <p>1、集合计划份额的转让</p> <p>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。份额转让的处理方式以管理人公告为准。委托人在此同意并授权管理人，集合计划份额转让业务开通后，允许管理人批</p>  |

|              |  |
|--------------|--|
|              | <p>量处理转登记转托管等相关事宜，以实现份额转让。</p> <p>2、集合计划份额的非交易过户</p> <p>非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定办理。</p> <p>3、集合计划份额的冻结</p> <p>集合计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。</p>  |
| <p>费用、报酬</p> | <p>费用种类</p> <p>1、管理人的管理费</p> <p>管理费按前一日的计划资产净值的 0.4%年费率计算，具体计算方法如下：<br/> <math display="block">H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}</math> H 为当日应计提的管理费，E 为前一日的集合计划资产净值</p> <p>管理费每日计提，逐日累计按月支付，由管理人向托管人发送管理费划付指令，托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性扣除支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>2、托管人的托管费</p> <p>当前一日集合计划资产净值小于等于 50 亿元，托管费按前一日的计划资产净值的 0.1%年费率计算，当前一日集合计划资产净值大于 50 亿元，托管费按前一日的计划资产净值的 0.07%年费率计算，具体计算方法如下：<br/> <math display="block">H = E \times T \div \text{当年天数}</math> H 为当日应计提的托管费，E 为前一日的集合计划资产净值，T 为前一日集合计划资产净值适用的托管费率。</p> <p>托管费每日计提，逐日累计按月支付，由管理人向托管人发送托管费划付指令，托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性扣除支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>3、证券交易费用</p> <p>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</p> |

|  |                    |  |
|--|--------------------|--|
|  |                    | <p>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。</p> <p>4、补充</p> <p>上述（一）中第 4、5、6 项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、行政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，列入当期集合计划费用。</p>  |
|  | <p>不由集合计划承担的费用</p> | <p>集合计划推广期间发生的信息披露费、会计师费、律师费等相关费用，不得列入集合计划费用。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。</p> <p>其他具体不列入计划费用的项目依据中国证监会有关规定执行。</p>  |
|  | <p>业绩报酬</p>        | <p>管理人于每日计算集合计划总净收益与各类集合计划份额预期收益总和的差额，并计入风险准备金。</p> <p>各类集合计划份额预期收益=各类集合计划份额×1.00×各类集合计划份额业绩基准×各分类集合计划份额存续天数/365。</p> <p>各类集合计划份额预期收益总和=∑（各类集合计划份额×1.00×各类集合计划份额业绩基准×各分类集合计划份额存续天数/365）。</p> <p>（1）如果集合计划总净收益≥各类集合计划份额预期收益总和，则<br/>         风险准备金=集合计划总净收益-各类集合计划份额预期收益总和。</p> <p>（2）如果集合计划总净收益&lt;各类集合计划份额预期收益总和，则管理人将以风险准备金按各类集合计划份额预期收益占各类集合计划份额预期收益总和的权重进行补偿，直到该类集合计划份额实际收益率达到该类集合计划份额业绩基准或者风险准备金全部补偿完毕为止。如果风险准备金全部补偿后，各类集合计划份额的实际收益率仍达不到该类集合计划份额业绩基准，则管理人不再补偿。</p> <p>（3）若出现风险准备金全部补偿后，各类集合计划份额的实际收益率仍达不到该类集合计划份额业绩基准的情况，则集合计划总净收益加风险准备金按照各类集合计划份额预期收益占各类集合计划份额预期收益总和的权</p> |

|      |      |   |
|------|------|---|
|      |      | <p>重进行收益分配。</p> <p>若（集合计划总净收益+风险准备金）&lt;0 时，则各类集合计划份额也按各类集合计划份额预期收益占各类集合计划份额预期收益总和的权重承担亏损责任。</p> <p>（4）风险准备金计算如有计提或弥补，每年自然季度末若风险准备金有余额，则管理人有权提取不超过此余额的 50%作为管理人的业绩报酬。具体提取时间和提取比例以管理人公告为准。管理人未提取的风险准备金余额自动计入下一个自然季度（或下一年度）的风险准备金。自集合计划成立后每满一年若风险准备金仍有余额且超过本集合计划存续规模 1%时，管理人有权提取不低于余额的 50%作为管理人业绩报酬。</p> <p>管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于收到指令后 5 个工作日内从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。</p> <p>风险准备金、业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。托管人不承担复核责任。</p> |
| 收益分配 | 收益构成 | <p>本集合计划收益的构成包括：集合计划投资所得债券利息、基金红利、买卖证券价差、逆回购利息、银行存款利息以及其他合法收入。</p> <p>可供分配利润指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。</p>  |
|      | 分配原则 | <p>1、同一类集合计划份额享有同等分配权利；</p> <p>2、T 日日终参与成功的计划份额不享有 T 日分红权益，自 T+1 日起享有分红权益； T 日退出的计划份额享有 T 日分红权益，自 T+1 日起不享有分红权益；</p> <p>3、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由持有人自行承担，与收益分配、退出集合计划的相关税负由持有人自行承担；</p> <p>4、法律、行政法规或监管机构另有规定的从其规定。</p>   |
|      | 分配方式 | 本集合计划的收益分配方式为现金分红。  |
|      | 分配方案 | 集合计划收益分配方案载明计划收益范围、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、分配方式及有关手续费等内容。   |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>本集合计划收益的分配方案由管理人拟定，经托管人复核后确定，并在管理人指定网站上公告。</p>  |
| 集合计划展期 | <p>本集合计划不设固定存续期限，无展期条款。</p>  |
| 终止和清算  | <p>(一) 有下列情形之一的，本集合计划应当终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、集合计划存续期间，持有人少于 2 人，或者连续 20 个交易日计划资产净值低于 1 亿元人民币；</li> <li>2、战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；</li> <li>3、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消客户资产管理业务资格；</li> <li>4、管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续履行相应职责；</li> <li>5、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消客户资产管理业务资格且在合理时间内无法找到继任托管人；</li> <li>6、托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续履行相应职责且在合理时间内无法找到继任托管人；</li> <li>7、法律、行政法规、中国证监会或集合资产管理合同约定的其他事项。</li> </ol> <p>(二) 清算程序</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、集合计划的清算小组 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立清算小组；</li> <li>(2) 集合计划清算小组成员由管理人、托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师组成。清算小组可以聘请必要的工作人员；</li> <li>(3) 集合计划清算小组负责在计划终止之日起 20 个工作日内完成集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划清算小组可以依法以集合计划的名义进行必要的民事活动。</li> </ol> </li> <li>2、集合计划清算程序 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 集合计划终止日后 5 个工作日内启动清算程序，并由清算小组将终止事项向委托人披露；</li> <li>(2) 集合计划清算小组统一接管集合计划资产；</li> <li>(3) 集合计划清算小组对集合计划资产进行清理和确认；</li> <li>(4) 对集合计划资产进行估价；</li> </ol> </li> </ol> |

(5) 对集合计划资产进行变现；

(6) 将集合计划清算结果报告中国证监会及管理人注册地中国证监会派出机构；

(7) 在清算结果报备证监会及其管理人注册地中国证监会派出机构后 3 个工作日内披露集合计划清算报告；

(8) 清算报告披露后 7 个工作日内进行集合计划剩余资产的分配；

(9) 集合计划清算小组注销集合计划相关账户；

(10) 清算结束后 15 个工作日内，集合计划清算小组将清算结果报集合计划管理人注册地中国证监会派出机构备案。

### 3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组从集合计划资产中支付。

### 4、集合计划剩余资产的分配

清算报告披露后 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、托管费及业绩报酬等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有份额的比例或者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。

如本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人应制定针对该部分未能流通变现证券二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人指定网站进行披露。

若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，集合计划清算小组应根据二次清算方案的规定，对该部分未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，将变现后的资产扣除相关费用后按照委托人拥有份额的比例，以货币形式全部分配给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。在进行二次清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。未返还委托人的集合计划资产照常计提管理费及托管费。

对于由计划缴纳的注册登记机构收取的最低结算备付金和交易席位保证金的清算方式将在清算方案中披露。

### 5、集合计划清算的报告



|             |   |
|-------------|---|
|             | <p>管理人终止或者解散所管理的集合计划的，应当在集合计划终止日后 15 个工作日内将有关情况向中国证监会及管理人注册地中国证监会派出机构报告。</p> <p>集合计划清算程序终止后 5 个工作日内由集合计划清算小组在管理人指定网站披露，并在集合计划清算程序终止后的 15 个工作日内向中国证监会及管理人注册地中国证监会派出机构备案。</p> <p>清算过程中的有关重大事项将及时通过管理人指定网站进行披露。</p> <p>（三）文件的保存</p> <p>管理人应当建立健全档案管理制度，妥善保管本集合资产管理计划的合同、客户资料、交易记录等文件资料，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者销毁。</p> <p>上述资料及清算账册须保存不少于 20 年。</p> |
| <p>特别说明</p> | <p>本说明书作为《海通海蓝量化增强集合资产管理计划资产管理合同》的重要组成部分，与《海通海蓝量化增强集合资产管理计划资产管理合同》具有同等法律效力。</p>   |