

东方红-新睿 2 号二期集合资产管理计划说明书

2015 年 1 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-新睿 2 号二期集合资产管理合同》（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-新睿 2 号二期集合资产管理计划																						
	类型	非限定性集合资产管理计划																						
	目标规模	本集合计划推广期规模上限为 40 亿份，存续期不设规模上限																						
	管理期限	不设固定管理期限																						
	推广期	具体以管理人推广公告为准																						
	封闭期	封闭期为本集合计划成立之日起的三个月，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工作日，开放期内可以办理参与、退出业务。																						
	份额面值	人民币 1.00 元。																						
	最低金额	首次参与的最低金额为人民币 100,000 元，追加参与的最低金额为人民币 100 元。																						
	相关费率	1、 认购费： 认购费： <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>认购金额 (M)</td> <td>适用认购费率</td> </tr> <tr> <td>M < 100 万</td> <td>1.2%</td> </tr> <tr> <td>100 万 ≤ M < 500 万</td> <td>0.8%</td> </tr> <tr> <td>M ≥ 500 万</td> <td>1000 元/笔</td> </tr> </table> 申购费： <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>申购金额 (M)</td> <td>适用申购费率</td> </tr> <tr> <td>M < 100 万</td> <td>1.5%</td> </tr> <tr> <td>100 万 ≤ M < 500 万</td> <td>1.0%</td> </tr> <tr> <td>M ≥ 500 万</td> <td>1000 元/笔</td> </tr> </table> 2、 托管费：0.25%/年； 3、 管理费： 根据集合计划前一日的累计单位净值 (X) 分档收取： <table border="1" style="margin-left: 20px;"> <tr> <td>集合计划前一日的累计单位净值 (X)</td> <td>适用管理费率 (年)</td> </tr> <tr> <td>X < 1.00</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td>X ≥ 1.00</td> <td>1.2%</td> </tr> </table>		认购金额 (M)	适用认购费率	M < 100 万	1.2%	100 万 ≤ M < 500 万	0.8%	M ≥ 500 万	1000 元/笔	申购金额 (M)	适用申购费率	M < 100 万	1.5%	100 万 ≤ M < 500 万	1.0%	M ≥ 500 万	1000 元/笔	集合计划前一日的累计单位净值 (X)	适用管理费率 (年)	X < 1.00	0	X ≥ 1.00
认购金额 (M)	适用认购费率																							
M < 100 万	1.2%																							
100 万 ≤ M < 500 万	0.8%																							
M ≥ 500 万	1000 元/笔																							
申购金额 (M)	适用申购费率																							
M < 100 万	1.5%																							
100 万 ≤ M < 500 万	1.0%																							
M ≥ 500 万	1000 元/笔																							
集合计划前一日的累计单位净值 (X)	适用管理费率 (年)																							
X < 1.00	0																							
X ≥ 1.00	1.2%																							
投资范围	国内依法发行的权益类资产、固定收益类资产、现金类资产及法律法规允许集合计划投资的其他																							

		金融工具。															
	风险收益特征	本集合计划属风险和期望收益中等的产品。															
	适合推广对象	本集合计划适合那些希望获得一定投资收益且具有一定风险承受能力的投资者。															
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															
	代理推广机构	东方证券股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、上海东方证券资产管理有限公司															
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	推广机构指定的推广营业网点															
	办理方式、程序	<p>1、投资者按推广机构指定营业网点的具体安排，在推广期/开放期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、投资者书面形式同意以电子签名方式签署本合同后，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，也可以登录推广机构指定网络系统以自主下单的方式申请参与集合计划。参与申请经管理人确认后有效，构成本合同的有效组成部分；</p> <p>4、投资者参与申请成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；</p> <p>5、投资者于T日提交参与申请后，一般可于T+2日后在办理参与的网点查询参与确认情况。</p>															
	参与费	<p>1、参与费率</p> <p>按参与金额采用比例费率，投资者在一天之内如果有多笔参与，适用费率按单笔分别计算。认购/申购费直接从认购/申购金额中扣除，不计入委托人认购/申购份额，不列入集合计划资产。参与费率具体见下表：</p> <p>认购费：</p> <table border="1" data-bbox="453 1122 1398 1294"> <thead> <tr> <th>认购金额 (M)</th> <th>适用认购费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>M<100 万</td> <td>1.2%</td> </tr> <tr> <td>100 万≤M<500 万</td> <td>0.8%</td> </tr> <tr> <td>M≥500 万</td> <td>1000 元/笔</td> </tr> </tbody> </table> <p>申购费：</p> <table border="1" data-bbox="453 1339 1398 1512"> <thead> <tr> <th>申购金额 (M)</th> <th>适用申购费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>M<100 万</td> <td>1.5%</td> </tr> <tr> <td>100 万≤M<500 万</td> <td>1.0%</td> </tr> <tr> <td>M≥500 万</td> <td>1000 元/笔</td> </tr> </tbody> </table> <p>2、金额限制：投资者首次参与集合计划的最低认购/申购金额（含认购/申购费）为100,000元，多次参与集合计划的金额（含认购/申购费）为100元的整数倍。</p>	认购金额 (M)	适用认购费率	M<100 万	1.2%	100 万≤M<500 万	0.8%	M≥500 万	1000 元/笔	申购金额 (M)	适用申购费率	M<100 万	1.5%	100 万≤M<500 万	1.0%	M≥500 万
认购金额 (M)	适用认购费率																
M<100 万	1.2%																
100 万≤M<500 万	0.8%																
M≥500 万	1000 元/笔																
申购金额 (M)	适用申购费率																
M<100 万	1.5%																
100 万≤M<500 万	1.0%																
M≥500 万	1000 元/笔																
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	推广机构指定的推广营业网点															
	办理方式、程序	<p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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，委托人退出申请成功；</p> <p>(4) 委托人于T日提交退出申请后，一般可于T+2日在网点查询退出确认情况；</p> <p>(5) 退出款项将在T+7日内转入委托人的交易账户。</p>															

退出费	<p>退出费由委托人承担，用于推广机构指定营业网点退出业务办理等各项费用。</p> <p>(1) 退出费率：</p> <table border="1" data-bbox="456 275 1398 524"> <thead> <tr> <th>份额存续时间 (L)</th> <th>适用退出费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>L<365 个自然日</td> <td>0.5%</td> </tr> <tr> <td>365 个自然日≤L<730 个自然日</td> <td>0.3%</td> </tr> <tr> <td>L≥730 个自然日</td> <td>0</td> </tr> </tbody> </table> <p>(2) 退出金额的计算公式</p> <p>退出金额为退出总额扣减退出费后的余额，计算结果保留到小数点后两位，第三位四舍五入。</p> <p>退出总额=退出份额×单位净值-业绩报酬</p> <p>退出费=退出总额×退出费率</p> <p>退出金额=退出总额-退出费</p> <p>(3) 收取方式</p> <p>委托人退出申请被确认后，退出费按实际被确认的退出总额和退出费率为基准计算。退出费直接从退出总额中扣除。</p>	份额存续时间 (L)	适用退出费率	L<365 个自然日	0.5%	365 个自然日≤L<730 个自然日	0.3%	L≥730 个自然日	0
份额存续时间 (L)	适用退出费率								
L<365 个自然日	0.5%								
365 个自然日≤L<730 个自然日	0.3%								
L≥730 个自然日	0								
单个委托人 大额退出及预 约申请	本集合计划不设大额退出限制条款。								
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）	<p>1、巨额退出的认定</p> <p>当每一个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。</p> <p>2、巨额退出的处理方式</p> <p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>								
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）	<p>1、连续巨额退出的认定</p> <p>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。</p> <p>2、连续巨额退出的处理方式</p> <p>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。</p>								
管理人自有资金 参与情况	管理人不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1亿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1亿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	<p>费用种类（计提标准、方法、支付方式）</p> <p>1、托管费</p> <p>(1) 按资产净值的0.25%年费率计提。</p> <p>(2) 按前一日计划资产净值计算，按日计提，按月支付。在每个月最后一个工作日收市后，由管理人向托管人发送集合计划托管费划付指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划中支付给托管人。若遇法定节假日、休息日或战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。</p> <p>(3) 托管费计算方法如下：</p> $C=i \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ <p>注：C为每日应计提的托管费，i为前一日的资产净值。</p> <p>2、管理费</p> <p>(1) 根据集合计划前一日的累计单位净值（X）分档收取：</p> <table border="1" data-bbox="544 987 1310 1178"> <thead> <tr> <th>集合计划前一日的累计单位净值（X）</th> <th>适用管理费率（年）</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>X<1.00</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td>X≥1.00</td> <td>1.2%</td> </tr> </tbody> </table> <p>(2) 按前一日计划资产净值计算，按日计提，按月支付。在每个月最后一个工作日收市后，由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划中支付给管理人。若遇法定节假日、休息日或战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。</p> <p>(3) 管理费计算方法如下：</p> $G=i \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ <p>注：G为每日应计提的管理费，i为前一日的资产净值。</p> <p>3、证券交易费用</p> <p>集合计划投资运作期间发生的交易佣金、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关费用，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。</p> <p>4、集合计划注册登记费用</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	集合计划前一日的累计单位净值（X）	适用管理费率（年）	X<1.00	0	X≥1.00	1.2%
集合计划前一日的累计单位净值（X）	适用管理费率（年）						
X<1.00	0						
X≥1.00	1.2%						
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。

(4) 委托人在集合计划分红日退出的,退出份额按照退出时应计提的业绩报酬金额计提业绩报酬。

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。每份集合计划份额的业绩报酬以该笔份额参与日(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 为该笔份额参与日的累计单位净值;

C 为该笔份额参与日的单位净值;

D 为该笔份额参与日与本次业绩报酬计提日间隔天数;

(1) 分红日提取业绩报酬

分红日提取业绩报酬的,按该笔集合计划份额的年化收益率计算,可提取的业绩报酬如下:

年化收益率 (R)	计提比例	H1 计算方法
$R \leq 5\%$	0	$H1 = 0$
$5\% < R \leq 8\%$	20%	$H1 = \max(0, (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$
$R > 8\%$	25%	$H1 = \max(0, [E + (R - 8\%) \times 25\%] \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$

注: $E = (8\% - 5\%) \times 20\% = 0.6\%$

管理人在分红日提取的业绩报酬不应超过该笔份额本次分红金额的20%,故业绩报酬上限如下:

$$H2 = Div \times F \times 20\%$$

注: Div 为本次分红日每份分红金额

F 为该笔提取业绩报酬的份额。

因此,管理人提取业绩报酬的实际金额为:

$$\text{业绩报酬 } H = \min(H1, H2)$$

(2) 委托人退出日或集合计划终止日提取业绩报酬

退出日或集合计划终止日提取业绩报酬的,该笔集合计划份额提取的业绩报酬如下:

		<table border="1"> <tr> <td>年化收益率 (R)</td> <td>计提比例</td> <td>业绩报酬 (H) 计算方法</td> </tr> <tr> <td>$R \leq 5\%$</td> <td>0</td> <td>$H = 0$</td> </tr> <tr> <td>$5\% < R \leq 8\%$</td> <td>20%</td> <td>$H = \max(0, (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$</td> </tr> <tr> <td>$R > 8\%$</td> <td>25%</td> <td>$H = \max(0, [E + (R - 8\%) \times 25\%] \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$</td> </tr> </table>	年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法	$R \leq 5\%$	0	$H = 0$	$5\% < R \leq 8\%$	20%	$H = \max(0, (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$	$R > 8\%$	25%	$H = \max(0, [E + (R - 8\%) \times 25\%] \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$
年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法												
$R \leq 5\%$	0	$H = 0$												
$5\% < R \leq 8\%$	20%	$H = \max(0, (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$												
$R > 8\%$	25%	$H = \max(0, [E + (R - 8\%) \times 25\%] \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$												
		<p>注：$E = (8\% - 5\%) \times 20\% = 0.6\%$ 3、业绩报酬的支付：</p> <p>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。</p>												
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	<p>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；</p> <p>2、每一集合计划份额享有同等分配权；</p> <p>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；</p> <p>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，现金红利扣除管理人应提业绩报酬后在 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，分红资金扣除管理人应提业绩报酬后按 T 日的单位净值转成相应的集合计划单位；</p> <p>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；</p> <p>7、法律法规另有规定的从其规定。</p>												
	分配方式	现金分配或红利再投资方式												
	分配方案	<p>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。</p> <p>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。收益分配方案确定后，按相关规定报监管机构备案。</p>												
终止和清算		<p>(一) 有下列情形之一的，集合计划终止：</p> <p>1、本计划存续期间，计划的委托人少于2人；</p> <p>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；</p> <p>3、管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>4、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格不能履行职责，且无其他适当的托管机构承接托管人原有的权利和义务；</p> <p>5、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，且无其他适当的托管机构承接托管人原有的权利及义务；</p> <p>6、战争、自然灾害等不可抗力的发生导致集合计划不能存续；</p>												

	<p>7、法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p> <p>(二) 集合计划的清算</p> <p>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；</p> <p>2、集合计划终止后 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，并报监管机构备案；清算过程中的有关重大事项须及时公布；</p> <p>3、清算结果披露后 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、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。</p> <p>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，并将变现后的资产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。</p>
<p>特别说明</p>	<p>● 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。</p>