

中欧盛世国金多策略 FOF 稳健精选集合专项
资产管理计划（1 期）
投资说明书

资产管理人：中欧盛世资产管理（上海）有限公司

资产托管人：中国银行股份有限公司广东省分行

二零一六年三月

重要提示

本投资说明书依据《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》（证监会令第74号，以下简称“《试点办法》”）及其他有关规定制作，管理人保证本投资说明书的内容真实、准确、完整，不存在任何虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

资产委托人承诺以真实身份参与资产管理计划，保证委托资产的来源及用途合法，并已阅知本投资说明书和资产管理合同全文，了解相关权利、义务和风险，愿意自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实信用、审慎尽责的原则管理和运用资产管理计划资产，但不保证资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。本投资说明书对资产管理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。

中国基金业协会对本资产管理计划已完成备案登记，但中国基金业协会对本资产管理计划做出的任何决定，均不表明中国基金业协会对本资产管理计划的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明参与本资产管理计划没有风险。

目录

一、资产管理计划概况.....	4
二、资产管理合同的主要内容.....	5
（一）资产管理计划的备案.....	5
（二）资产管理计划的参与、退出.....	6
（三）资产管理计划的投资.....	11
（四）投资经理的指定与变更.....	13
（五）投资指令的发送、确认和执行.....	14
（六）当事人权利与义务.....	15
三、资产管理人与资产托管人概况.....	20
（一）资产管理人概况.....	20
（二）资产托管人概况.....	20
四、投资风险揭示.....	20
五、初始销售期间.....	26

一、 资产管理计划概况

1、 资产管理计划的名称

中欧盛世国金多策略 FOF 稳健精选集合专项资产管理计划（1 期）

2、 资产管理计划的类别

非保本浮动收益型专项资产管理计划。

3、 资产管理计划的运作方式

定期开放。

4、 资产管理计划的投资目标

在追求本金长期安全的基础上，力争为资产委托人创造具备较高收益风险比的投资收益。

5、 资产管理计划的存续期限

本资管计划存续期限为 5 年，自计划成立之日起计算，可在特定条件下终止。本资管计划到期日的前 30 个工作日内，管理人可按照本合同约定决定是否继续延长本资产管理计划的期限。

6、 资产管理计划的最低资产要求

初始销售期间内，本计划发行总规模最低为人民币 3000 万元，但不得超过 10 亿元人民币，中国证监会另有规定的除外。

7、 资产管理计划份额的初始销售面值

人民币 1.00 元。

8、 投资顾问的聘任

资产管理人接受资产委托人委托为本计划聘请投资顾问。本资产管理计划的投资顾问为国金创新投资有限公司。资产委托人同意投资顾问按约定的方式为资产管理人管理运用计划财产提供投资顾问服务。资产委托人承诺接受资产管理人根据该投资建议进行投资决策所带来的任何收益或损失。

无论本合同其它条款如何约定，为履行投资顾问业务之目的，资产管理人可以向投资顾问披露本合同及/或其它相关文件，但投资顾问应对所获信息保密。

经本计划委托人一致同意，资产管理人有权更换、解聘投资顾问。投资顾问更换或解聘的，资产管理人将通过其网站进行公告。

若投资顾问违反法律法规规定及本计划相关文件的约定，资产管理人有权直

接解聘投资顾问，并追究投资顾问由此给管理人及资产管理计划造成直接损失的赔偿责任。资产管理人解聘投资顾问时，有权决定是否终止本资产管理计划。

国金创新投资有限公司（以下简称“国金创新”），是国金证券股份有限公司的全资子公司，也是第一家在自贸区成立的券商全资子公司，注册资本 3 亿元，企业类型为法人独资。

公司作为国金证券的综合投资平台，拥有卓越的创新和资源整合能力、严谨的内控体系、灵活的激励政策以及完善的人才孵化机制。现有业务和产品两大模块，多个部门。公司凭借专业的金融团队，能够迅速应对资本市场的变化，进行最新的金融市场研究，设计创新的金融产品投资方案和策略并为客户提供最专业、便捷的金融、财务、管理咨询等一揽子解决方案。

9 预警线

为保护全体委托人的利益，本计划每周计算计划份额净值，预警线设置为 0.850 元。

若管理人估值日完成的估值结果显示 T 日（估值基准日）计划份额净值不高于预警线的，管理人应及时以电话或传真的方式向本计划投资顾问提示风险，同时管理人应对本产品可在可执行范围内进行减仓处理，使本计划持有的现金类资产、债券型证券投资公募基金占计划资产净值的比例不低于 60%。

现金类资产指现金、银行存款、货币基金。

待后续估值结果显示计划份额净值高于预警线后，本计划所持有的资产不再受上述限制，管理人恢复接受投资顾问其他资产的买入建议。

10 其他

资产管理计划应当设定为均等份额。除资产管理合同另有约定外，每份计划份额具有同等的合法权益。

二、资产管理合同的主要内容

（一）资产管理计划的备案

1、资产管理计划备案的条件

初始销售期限届满，委托人不少于 2 人，不多于 200 人，且初始委托资产

合计不低于 3000 万元人民币，未超过 10 亿元人民币的，资产管理人应当自初始销售期限届满之日起 4 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 5 日内，向中国基金业协会提交验资报告及客户资料表，办理相关备案手续。客户资料表应包括委托人名称、委托人身份证明文件号码、通讯地址、联系电话、参与资产管理计划的金额和其他信息。

自中国证券投资基金业协会书面确认之日起，资产管理计划备案手续办理完毕，资产管理合同生效。资产委托人的认购参与款项（不含认购费用）加计其认购金额在初始销售期形成的利息在资产管理合同生效后折算成相应的资产管理计划份额归资产委托人所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

2、资产管理计划初始销售失败的处理

(1)、初始销售期限届满，不符合本合同生效条件的，则本计划初始销售失败。

(2)、计划初始销售失败的，资产管理人应当承担下列责任：

1) 以其固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用；

2) 在初始销售期届满后 30 日内返还委托人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

(二) 资产管理计划的参与、退出

1、参与和退出场所

委托人可至本资产管理计划销售机构的营业场所办理本资产管理计划份额的参与和退出。

本计划的销售机构包括资产管理人及资产管理人委托的销售机构。

在具备现实可行条件且经资产管理人公告或通知后，资产委托人可以通过交易所交易平台或中国证监会允许的其他机构向符合条件的特定客户转让其持有的资产管理计划份额。

2、参与和退出的开放日和时间

本计划每三个月开放一次，首个开放日为计划成立日季度对月的第一个工作日，首个开放日之后每三个月的第一个工作日开放一次。举例说明：如果计划

成立日为 2016 年 3 月某日，则首个开放日为 2016 年 6 月的第一个工作日、之后的开放日依次为 2016 年 9 月的第一个工作日、2016 年 12 月的第一个工作日、2017 年 3 月的第一个工作日，以此类推。（开放日为 T 日。）

参与预约日为开放日前第 10 个工作日（T-10）至开放日当日（T）；**退出预约日为开放日前第 32 个工作日（T-32）至第 22 个工作日（T-22）**。资产委托人可以在参与预约日预约办理参与业务，在退出预约日预约办理退出业务。开放日不接受未预约的投资者提出的退出申请。资产管理人有权根据需要设立临时开放日，资产管理人应在设立前 3 个工作日告知资产委托人。资产管理人和代理销售机构在网站公告前述事项即视为履行了告知义务。若中国证监会有新的规定，或本计划所投资的产品交易时间、开放期、参与或退出规则变更或其他特殊情况，资产管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知资产委托人。资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

若资产管理计划委托人已达到 200 人，则不再接受其他投资人的首次参与。资产委托人参与业务的办理时间在遵守本合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

3、参与和退出价格

资产管理计划的参与和退出价格以开放日的资产管理计划份额净值为基准进行计算。

4、参与的程序

（1）、参与的申请方式

委托人持有效证件，在指定参与时间内到本计划的销售机构提出参与申请，签订资产管理合同。

委托人在提交参与申请前，应当全额缴纳参与资金至销售机构的指定账户。

（2）、参与申请的确认和查询

本计划存续期开放日参与的，正常情况下，资产管理人在 T+5 日内为资产委托人对该交易的有效性进行确认，在 T+6 日后（包括该日）资产委托人可向销售机构或以销售机构规定的其他方式查询。

委托人应当及时查询和确认参与申请的相关信息。确认无效的申请，销售机构将退还委托人已交付的参与款项本金。

销售机构参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确

实接收到参与申请。参与的确认为以资产管理人的确认结果为准。

5、参与的金額限制

委托人在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，购买金额应不低于 100 万元人民币，已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的，追加参与的最低金额为人民币 10 万元，追加参与金额需为 10 万元的整数倍。

6、参与费用

本资产管理计划收取参与费用，参与本资产管理计划时，需另外交纳参与费用，由销售机构收取，参与费用为参与金额的 0.6%。

资产管理人、资产托管人协商一致，可以在法律法规和本合同规定范围内调低参与费率、退出费率或调整收费方式。如降低费率或调整收费方式，资产管理人应在调整实施前 3 个工作日告知资产委托人。资产管理人和代理销售机构在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

7、参与份额的计算

委托人在开放日参与本计划的，管理人根据当日（T 日）计划份额净值计算其参与计划份额。

参与份额 = (参与金额 - 参与费用) / T 日计划份额净值

参与份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此误差产生的损失由委托财产承担，产生的收益归委托财产所有。

8、拒绝参与

出现以下情形之一，管理人可以拒绝委托人的参与：

- (1)、本计划参与人数达到上限；
- (2)、不可抗力的原因导致本计划无法正常运转；
- (3)、证券交易所在交易时间非正常停市；
- (4)、发生本合同约定的暂停计划资产估值情况；
- (5)、法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果委托人的参与被拒绝，被拒绝的参与款项将无息退还给委托人。

9、退出的程序

(1)、申请方式：资产委托人办理退出业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。资产委托人不得撤销已提出的退出申请。

(2)、退出的确认：

资产委托人退出资产管理计划时，资产管理人按先进先出的原则，份额确认日期在前的计划份额先退出，确认日期在后的计划份额后退出，以确定所适用的退出费率。

退出申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在 T+5 日对资产委托人参与、退出申请的有效性进行确认。在 T+6 日后（包括该日）资产委托人可至各销售网点或以各销售网点规定的其他方式查询退出的成交情况。

(3)、款项支付：资产委托人 T+5 日退出申请被确认成功后，资产管理人将在 T+15 日（包括当日）内将退出款项划出至代理销售机构，代理销售机构收到退出款项后于 2 个工作日内划往资产委托人银行账户。T 日至委托人退出资金划到委托人指定账户之间为清算期，清算期不计息。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定办理。

(4)、若本计划所投资的子产品交易时间、开放期或申赎规则变更或发生巨额赎回等其他特殊情况，资产管理人将视情况对本计划的参与和退出的确认、清算期、划款等进行相应的调整。

10、退出的金额限制

当委托人持有的计划资产净值高于 100 万元人民币时，委托人可以选择全部或部分退出资产管理计划；选择部分退出资产管理计划的，委托人在退出后持有的计划资产净值不得低于 100 万元人民币。当资产管理人发现委托人申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于 100 万元人民币的，资产管理人有权适当减少该委托人的退出金额，以保证部分退出申请确认后委托人持有的计划资产净值不低于 100 万元人民币。

当委托人持有的计划资产净值低于 100 万元人民币（含 100 万元人民币）时，需要退出计划的，委托人必须选择一次性全部退出资产管理计划。

11、退出的费用

(1)、委托人在资产管理计划存续期开放日申请退出本资产管理计划的，资产管理人有权按如下费率收取退出费用：

本资产管理计划退出费用由资产委托人承担，在资产委托人全部或部分退出资产管理计划份额时收取。自委托人认购/申购后前三个开放日退出的，视为违约退出，需要按照本合同约定交纳违约退出费，第四个以及之后的开放日方可退出，退出费率为 0。

委托人自认购/申购后，在前三个开放日退出的，视为违约退出。在持有计划份额之后的第一个开放日违约退出的，违约退出费率为 4%；在持有计划份额之后的第二和第三个开放日违约退出的，违约退出费率为 1%；持有份额之后的第四个以及之后的开放日退出的，为正常退出，退出费率为 0。违约退出费归本计划资产所有。

违约退出费=违约退出金额*违约退出费率

(2)、本计划提前终止时，不收取任何退出费用。

资产管理人、资产托管人协商一致，可以在法律法规和本合同规定范围内调低参与费率、退出费率或调整收费方式。如降低费率或调整收费方式，资产管理人应在调整实施前 3 个工作日告知资产委托人。资产管理人和代理销售机构在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

12、退出金额的计算

采用“份额退出”方式，退出价格以开放日（T 日）的计划份额净值为基准进行计算，计算公式：

退出总金额=退出份额×开放日（T 日）计划份额净值

退出费用=退出总金额×退出费率

净退出金额=退出总金额-退出费用

13、巨额退出的认定及处理方式

(1)、巨额退出的确认

单个开放日内，本计划需处理的净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之余额）超过上一开放日计划份额总份数的 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委托人的全部退出申请时，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支付委托人的退出申请可能会对计划的资产净值造成较大波动时，管理人在该开放日接受退出比例不低于上一开放日计划总份额的 10%。对于单个委托人的退出申请，应当按照其申请退出份额占该开放日申请退出总份额的比例，确定该委托人在该开放日办理的退出份额；委托人未能退出部分，除委托人在提交退出申请时选择将该开放日未获办理部分予以撤销外，延迟至下一个开放日办理，退出价格为下一个开放日的资产管理计划份额净值。依照上述规定转入下一个开放日的退出不享有退出优先权，并以此类推，直到全部退出为止。部分顺延退出不受单笔退出最低份额的限制。部分退出导致资产委托人持有的计划份额资产净值低于 100 万元人民币的，资产管理人可按全额退出处理。

14、违约退出

本计划存续期内，单个委托人自认购/申购后，在之后前三个开放日退出的，视为违约退出，违约退出将收取违约退出费。在持有计划份额之后的第一个开放日违约退出的，违约退出费率为 4%；在持有计划份额之后的第二和第三个开放日违约退出的，违约退出费率为 1%。违约退出费归本计划资产所有。

本计划存续期内其他日期，均不接受违约退出。

（三）资产管理计划的投资

1、投资目标

在追求本金长期安全的基础上，力争为资产委托人创造具备较高收益风险比的投资收益。

2、投资范围

本计划主要投资于证券投资集合资金信托计划、金融机构发行的资产管理计划(如基金公司资产管理计划、基金子公司资产管理计划(含专项资产管理计划)、

券商资产管理计划、保险资产管理计划、期货公司资产管理计划)、证券投资私募基金、证券投资公募基金, 投资比例为 0-100%。本计划可根据资金管理的需求, 投资于现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金等。

3、投资策略

募集资金主要用于投资国内优秀的私募基金产品, 并通过不同私募策略间的低相关性, 降低组合净值的波动, 为组合提供分享中国证券市场发展的增值收益

4、投资限制

本合同委托财产的投资组合将遵循以下限制:

- (1)、本资产管理计划不直接投资于证券二级市场, 不投资于融资类项目。
- (2)、不得投资于最近一个赎回日在本计划终止之后的投资品种。
- (3)、资产管理计划运作期间有新的政策法律对上述限制做出不同规定的, 上述限制根据规定做相应调整。
- (4)、如本资产管理计划调整投资范围、投资限制, 须经资产托管人、资产管理人协商一致, 并就调整内容签订补充协议。

(5)、投资单一私募证券投资基金管理的基金总额不得超过投资时点本资产管理计划资产净值的 20%, 后续由于所投资基金净值波动引起的上述比例变动不受此限制约束。

5、风险收益特征

本计划不承诺保本和最低收益, 具有一定的投资风险, 属于中高风险等级的投资品种, 适合风险识别、评估、承受能力较强的合格投资者。本计划的风险已在资产管理合同中作出了详尽的披露, 请仔细阅读。

6、预警线

为保护全体委托人的利益, 本计划每周计算计划份额净值, 预警线设置为 0.850 元。

若管理人估值日完成的估值结果显示 T 日(估值基准日)计划份额净值不高于预警线的, 管理人应及时以电话或传真的方式向本计划投资顾问提示风险, 同时管理人应对本产品可在执行范围内进行减仓处理, 使本计划持有的现金类资产及债券类证券投资公募基金占计划资产净值的比例不低于 60%, 且管理人不再接受投资顾问除现金类资产及债券类证券投资公募基金以外的其他资产的买入建

议。

现金类资产指现金、银行存款、货币基金

待后续估值结果显示计划份额净值高于预警线后，本计划所持有的资产不再受上述限制，管理人恢复接受投资顾问的其他资产的买入建议。

7、投资政策的变更

经委托人、管理人和托管人之间协商一致可对投资政策进行变更，变更投资政策应以书面形式作出。投资政策变更应为调整投资组合留出必要的时间。

（四）投资经理的指定与变更

1、投资经理的指定

（1）投资经理的指定

资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定，且本投资经理与资产管理人所管理的证券投资基金的基金经理不得相互兼任。

（2）本计划投资经理

本资产管理计划投资经理为杨炎冰。

投资经理简历如下：

杨炎冰先生，南开大学金融学专业硕士，3年以上证券从业经验。历任中欧基金管理有限公司专户理财部高级经理。2013年10月加入中欧盛世资产管理(上海)有限公司，现任资产管理一部总经理、机构业务总监。

2、投资经理变更的条件和程序

（1）投资经理变更的条件

如本资产管理计划的投资经理因故无法履行其职能的，资产管理人可以变更投资经理。

（2）投资经理变更的程序

资产管理人有权决定变更投资经理并提名新的投资经理人选，提交资产管理人执行委员会审议决定。投资经理变更后，资产管理人应在3个工作日内将新投资经理的姓名和简历通知资产委托人。

资产管理人在网站公告前述事项即视为履行了告知义务。

（五）投资指令的发送、确认和执行

1、交易清算授权

资产管理人应事先书面通知（以下称“授权通知”）资产托管人有权发送指令的人员名单（以下称“指令发送人员”、“被授权人”），授权通知应注明相应的交易权限、授权生效时间、预留印鉴和被授权人签字样本。授权通知书应由资产管理人法定代表人或授权签字人签字并加盖公章，若由授权签字人签署，还应附上法定代表人的授权书。资产托管人在收到授权通知当日向资产管理人电话确认。授权通知经电话确认后于授权通知载明的生效日期生效。资产管理人和资产托管人对授权通知负有保密义务，不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

2、投资指令的内容

投资指令是资产管理人在运用委托财产时，向资产托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。资产管理人发给资产托管人的指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、账户名称及账号等，加盖预留印鉴并由被授权人签字。

3、投资指令的发送、确认和执行程序

指令由授权通知确定的指令发送人员代表资产管理人用传真的方式或其他资产托管人和资产管理人书面确认的方式向资产托管人发送。资产管理人有义务在发送指令后及时与资产托管人进行确认，因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失不由资产托管人承担。资产托管人根据授权通知书，对指令的预留印鉴、签字样本等表面真实性审核无误后，应在规定期限内执行指令。对于指令发送人员发出的指令，资产管理人不得否认其效力。资产管理人应按照有关法律法规和本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，指令发送人员应按照其授权权限发送划款指令。资产管理人在发送指令时，应为资产托管人留出执行指令所必需的时间。场外及限时发送指令的截止时间为当天的 15:00，如投资管理人要求当天某一时点到账，则交易结算指令需提前 2 个工作小时发送。由资产管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由资产管理人承担。

资产管理人向资产托管人下达指令时，应确保托管账户有足够的资金余额，对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令，资产托管人可

不予执行，并立即通知资产管理人，资产托管人不承担因为不执行该指令而造成损失的责任。

管理人发送指令时应同时向托管人发送必要的划款证明文件（如有）的复印件，如划款时该证明文件客观上尚不存在，管理人应在取得该证明文件后 3 日内将该证明文件的复印件发送托管人。

4、资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

资产管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。

资产托管人发现资产管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知资产管理人改正。

5、授权通知的变更

资产管理人若变更授权通知（包括但不限于变更指令发送人员、联系方式、预留印鉴、签字样本等），必须提前至少一个工作日，使用传真向资产托管人发出由法定代表人（或其授权签字人）签字并加盖公章的指令发送人员变更通知，同时电话通知资产托管人，资产托管人收到变更通知当日向资产管理人电话确认。指令发送人员变更通知，经托管人电话确认后于授权通知载明的生效日期生效。资产管理人在此后三个工作日内将指令发送人员变更通知的正本交送资产托管人。

如正本内容与传真不一致，以传真内容为准，资产管理人对该效力应予以认可。指令发送人员更换通知生效后，对于原指令发送人员无权发送的指令，或原指令发送人员超权限发送的指令，资产管理人不承担责任。

（六）当事人权利与义务

1、资产委托人

（1）资产委托人概况

资产委托人的详细情况在合同签署页前页列示。

（2）资产委托人的权利

- 1) 分享资产管理计划财产收益；
- 2) 参与分配清算后的剩余资产管理计划财产；

- 3) 按照本合同的约定参与和退出资产管理计划；
- 4) 监督资产管理人及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- 5) 按照本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的运作信息资料；
- 6) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

(3) 资产委托人的义务

- 1) 遵守本合同；
- 2) 交纳购买资产管理计划份额的款项及规定的费用；
- 3) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；
- 4) 及时、全面、准确地向资产管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况；
- 5) 向资产管理人或其代理销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合资产管理人履行反洗钱义务；
- 6) 不得违反本合同的规定干涉资产管理人的投资行为；
- 7) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资人、资产管理人管理的其他资产及资产托管人托管的其他资产合法权益的活动；
- 8) 按照本合同的规定缴纳资产管理费、托管费以及因资产管理计划财产运作产生的其他费用；
- 9) 保守商业秘密，不得泄露本资产管理计划的财产投资计划、投资意向等，监管机构另有规定的除外；
- 10) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

2、资产管理人

(1) 资产管理人概况

名称：中欧盛世资产管理（上海）有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 5 层 501 室

法定代表人：唐步

联系人：郑玉蛟

联系电话：021-68609600

传真：021-50190015

(2) 资产管理人的权利

- 1) 按照本合同的规定，独立管理和运用资产管理计划财产；
- 2) 依照本合同的规定，及时、足额获得资产管理人报酬；
- 3) 依照有关规定行使因资产管理计划财产投资于证券所产生的权利；
- 4) 根据本合同及其他有关规定，监督资产托管人，对于资产托管人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应及时采取措施制止，并报告中国证监会；
- 5) 自行销售或者委托有基金销售资格的机构代理销售资产管理计划，制定和调整有关资产管理计划销售的业务规则，并对代理销售机构的销售行为进行必要的监督；
- 6) 自行担任或者委托经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构担任资产管理计划份额的注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；
- 7) 以受托人的名义，代表专项资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；
- 8) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

(3) 资产管理人的义务

- 1) 办理资产管理计划的备案手续；
- 2) 自本合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划财产；
- 3) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；
- 4) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的资产管理计划财产与其管理其他委托财产和资产管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，进行投资；
- 5) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产；
- 6) 办理或者委托经中国证监会认定可办理开放式证券投资基金份额登

记业务的其他机构代为办理资产管理计划份额的登记事宜；

- 7) 依据本合同接受资产委托人和资产托管人的监督；
- 8) 以资产管理人的名义，代表资产委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 9) 按照《试点办法》和本合同的规定，编制并向资产委托人报送资产管理计划财产的投资报告，对报告期内资产管理计划财产的投资运作等情况做出说明；
- 10) 按照《试点办法》和本合同的规定，编制特定资产管理业务季度及年度报告，并向中国证监会备案；
- 11) 计算并根据本合同的规定向资产委托人报告资产管理计划份额净值；
- 12) 进行资产管理计划会计核算；
- 13) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，法律法规、本合同或监管机构另有规定的除外；
- 14) 保存资产管理计划资产管理业务活动的全部会计资料，并妥善保存有关的合同、协议、交易记录及其他相关资料；
- 15) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- 16) 对相关交易主体和资产进行全面的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；。
- 17) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

3、资产托管人

(1) 资产托管人概况

名称：中国银行股份有限公司广东省分行

住址：广州市东风西路 197 号

负责人：谭炯

联系人：段成戈

联系电话：020-83153946

传真：

(2) 资产托管人的权利

- 1) 依照本合同的规定，及时、足额获得资产托管费；
- 2) 根据本合同及其他有关规定，监督资产管理人对资产管理计划财产的投资运作，对于资产管理人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国证监会并采取必要措施；
- 3) 根据本合同的规定，依法保管资产管理计划财产；
- 4) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他权利。

(3) 资产托管人的义务

- 1) 安全保管资产管理计划财产；
- 2) 设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员，负责财产托管事宜；
- 3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；
- 4) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为资产托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；
- 5) 按规定开设和注销资产管理计划的资金账户；
- 6) 复核资产管理计划份额净值；
- 7) 复核资产管理人编制的资产管理计划财产的投资报告，并出具书面意见；
- 8) 编制资产管理计划的年度托管报告，并向中国证监会备案；
- 9) 按照本合同的约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- 10) 按照法律法规及监管机构的有关规定，保存资产管理计划资产管理业务活动有关的合同、协议、凭证等文件资料；
- 11) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- 12) 保守商业秘密。除法律法规、本合同及其他有关规定另有规定外，不得向他人泄露；
- 13) 按照法律法规及本合同的规定监督资产管理人的投资运作，资产托

管人发现资产管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并及时报告中国证监会；资产托管人发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知资产管理人并及时报告中国证监会；

14) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

三、资产管理人与资产托管人概况

(一) 资产管理人概况

名称：中欧盛世资产管理（上海）有限公司
住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号 5 层 501 室法定代表人：唐步
联系人：郑玉蛟联系电话：021-68609600
传真：021-50190015

(二) 资产托管人概况

名称：中国银行股份有限公司广东省分行
住址：广州市东风西路 197 号
负责人：谭炯
联系人：段成戈
联系电话：020-83153946

四、投资风险揭示

(一) 市场风险

市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致委托财产收益水平变化，产生风险，主要包括：

(1) 政策风险。货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致市场价格波动，从而影响本计划收益，甚至造成损失。

(2) 经济周期风险。证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而宏观经济运行状况对证券市场的收益水平产生影响，从而对本计划收益产生影响。

(3) 利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。本资产管理计划收益水平可能会受到利率变化和货币市场供求状况的影响。

(4) 选择投资标的的风险。由于信息的不对称、统计数据、财务数据、信息披露的可信度等可能存在的问题，存在所选择的投资标的可能出现暂时偏离投资目标的情况。

(5) 购买力风险。本资产管理计划的目的是本计划的保值增值，如果发生通货膨胀，则投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响到本计划的保值增值。

(二) 投资顾问风险

在提供投资顾问服务过程中，投资顾问的研究水平、投资管理水平可能影响委托财产收益水平，如果投资顾问对经济形势和证券市场判断不准确、获取的信息不全，将可能影响委托财产的收益水平。

(三) 流动性风险

本计划投资组合中的子产品会因各种原因面临较高的流动性风险，使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。此外，本计划投资者的退出需求可能造成本计划仓位调整和资产变现困难，加剧流动性风险。为了克服流动性风险，本计划将在坚持分散化投资的原则的基础上，通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，但资产管理人并不保证完全避免此类风险。

(四) 信用风险

当资产管理计划间接持有的债券、票据的发行人违约，不按时偿付本金或利息时，将导致基金资产的损失，产生信用风险。另外，回购交易中由于融资方（正回购方）违约到期无法及时支付回购利息，也将对计划资产造成损失。

(五)特定的投资方法及资产管理计划所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

(1) 流动性风险

本计划的参与、退出条款及流动性安排包括但不限于：

本计划每三个月开放一次，首个开放日为计划成立日季度对月的第一个工作日，首个开放日之后每三个月的第一个工作日开放一次。参与预约日为开放日前第 10 个工作日（T-10）至开放日当日（T）；退出预约日为开放日前第 32 个工作日（T-32）至第 22 个工作日（T-22）。

自委托人认购/申购后前三个开放日封闭，第四个以及之后的开放日方可退出。委托人自认购/申购后，在前三个开放日退出的，视为违约退出。在持有计划份额之后的第一个开放日违约退出的，违约退出费率为 4%；在持有计划份额之后的第二和第三个开放日违约退出的，违约退出费率为 1%；持有份额之后的第四个以及之后的开放日退出的，为正常退出，退出费率为 0。注册登记机构应在 T+5 日内对资产委托人参与、退出申请的有效性进行确认。在 T+6 日后（包括该日）资产委托人可至各销售网点或以各销售网点规定的其他方式查询参与和退出的成交情况。资产委托人的退出申请被确认成功后，资产管理人将在 T+15 日（包括当日）内将退出款项划出至代理销售机构，代理销售机构收到退出款项后于 2 个工作日内划往资产委托人银行账户。

违约退出费归本计划资产所有。

违约退出费=违约退出金额*违约退出费率

鉴于本计划上述安排，本计划财产在流动性方面会受一定影响，委托人需合理规划自身资金安排：

<1>参与和退出申请日、退出款支付时间的设定是为了满足本计划的流动性安排，及时获得参与或退出数据，进行子产品申赎决策及操作的必要条款。所以参与和退出申请日、以及客户资金到账日均较长。

<2>销售网点受理客户的认购、参与或退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购、参与或退出申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。资产委托人应在规定时间至销售网点查询成交情况。如客户的交易申请不符合本合同的有关规定，其申请有可能被部分或全部确认失

败。

〈3〉本计划存续期限为5年，且申请退出处于一定持有期限内的计划份额需要交纳一定的退出费用，计划存续期间仅在合同约定的开放日办理退出业务。**特别地：委托人自认购/申购期前三个开放日封闭，委托人自认购/申购后，在前三个开放日退出的，视为违约退出。在持有计划份额之后的第一个开放日违约退出的，违约退出费率为4%；在持有计划份额之后的第二和第三个开放日违约退出的，违约退出费率为1%。请委托人特别注意由此带来的流动性风险。**

〈4〉在暂停退出或巨额退出的情况下，委托人可能无法及时退出全部计划财产，委托人将因此面临退出款项延迟到账的风险。同时在巨额退出的过程中，计划单位净值的波动也可能对计划财产产生不利影响。

〈5〉如果本计划发生巨额退出，且管理人根据本计划当时的资产组合状况决定部分顺延退出的情况下，针对委托人未能在当日退出的部分，除委托人在提交退出申请时选择将该开放日未获办理部分予以撤销外，将延迟至下一个开放日办理，退出价格为下一个开放日的资产管理计划份额净值。也即按照本计划本季度开放一次的设置，将会延期一个季度，请投资者特别注意由此引起的流动性风险。

〈6〉本计划终止时，受市场环境或特殊原因影响，计划财产可能部分或者全部不能变现，因此委托人可能面临计划终止时无法及时收到变现后的计划利益的情况。

(2) 特定投资方法及资产管理计划所投资的特定投资对象可能引起的特定风险

〈1〉资产管理计划主要投资产品带来的冲击成本和投资机会分配的风险。本计划所投资的子产品规模不一，在本计划认购或赎回子产品时，如果资金量较大，有可能导致相应产品净值的波动，从而影响本计划的净值表现。此外，管理人根据投资顾问的建议在各类子产品中相机分配投资机会，投资机会的分配存在不确定性，可能影响计划的收益。

〈2〉若计划存续期间，资产管理计划主要投资产品的管理人发生信用风险如被依法撤销或被申请破产等，将可能导致资产委托人利益受损。

〈3〉本资产管理计划由资产管理人根据投资顾问的投资建议做出投资交易决策。投资顾问的投资研究能力、服务水平将可能影响本资产管理计划的收益水

平。在本资产管理计划投资运作过程中，投资顾问的知识、经验、技能以及信息获取等多方面因素都可能影响到其对经济形势和证券市场等的判断，进而影响本资产管理计划的收益水平。

〈4〉资产委托人退出资金是以本计划开放日的份额净值为计算基础，而本计划开放日的份额净值是以本计划所投资的子产品的最新净值为估值依据。但本计划所投资子产品的最新净值的估值基准日可能早于本计划开放日，与其在本计划开放日的实际价值可能存在误差，从而有可能对委托人退出资金造成一定的不利影响。

〈5〉投资于子产品对本计划流动性造成影响的风险

本计划可投资于多个子产品，在投资中会因各种原因面临较高的流动性风险，使交易的执行难度提高，买入成本或变现成本增加。

本计划投资的子产品多数设置有巨额赎回并延期赎回的条款，发生巨额赎回时，若该子产品管理人认为支付委托人的赎回申请有困难或认为支付委托人的赎回申请而进行的财产变现可能会对子产品的资产净值造成较大波动时，该子产品管理人可能根据产品合同对其余赎回申请延期办理。因而，本计划可能面临无法及时将委托财产变现的风险，从而对本计划的流动性造成负面影响，该影响的作用的严重程度由子产品的延期赎回情况所决定，此种情况下，本计划的资产管理人有权根据本合同的约定，视情况对本计划的参与和退出的确认、清算期、划款等进行相应的调整。

请委托人注意本计划此种特定风险，委托人签署本合同即视为同意承担本计划可能面临的上述流动性风险。

〈6〉计划估值不能及时反映子产品净值的风险

本计划的估值基准日为每周最后一个工作日及开放日、计划终止日。管理人在每个估值基准日后的 3 个工作日内计算出该估值基准日本计划的资产净值和份额净值，即 T+3 日内完成 T 日估值并与托管人核对。此外，本计划投资的子产品的份额价值，以子产品的最新披露或子产品管理人提供的净值估值，且因子产品的净值披露可能采用 T+N 日（N 可为 0、1、2…等）估值及披露（需根据各个子产品的合同约定而定），此种设置可能导致本计划在 T+3 日完成的估值可能与所投资的最底层投资标的的实际情况可能存在 3 日甚至多达一月的延迟，这也

将导致本计划的净值所反映的投资情况与市场实际情况存在一定延迟，请委托人需特别注意此类风险。

〈7〉本计划触发预警时可能需要较长的时间以调整仓位

在本计划触发预警时，管理人根据本合同需将本计划持有的现金类资产及债券类证券投资公募基金的比例调整至不低于计划资产净值的 60%，但因本计划投资的子产品各设置有一定的开放周期（例如每季度开放、每月开放），本计划赎回子产品份额受制于其开放周期的要求，可能需要较长的时间以将仓位调整至本合同约定的比例。

（3）计划终止的风险

如果发生本合同所规定的计划终止的情形，管理人将卖出或赎回计划财产所投资之全部品种（无法变现的除外），并终止本计划，由此可能导致计划财产遭受损失。

（4）资产管理计划不成立的风险

如自本资产管理计划开始认购至资产管理计划原定成立日之前，资产管理计划认购总额未达到规模下限，或国家宏观政策以及市场相关法规政策发生变化，或市场发生剧烈波动，经资产管理人合理判断难以按照资产管理合同的规定向投资者提供本计划，资产管理人有权宣布本计划不成立。

（5）本计划不设强制止损的风险

本计划虽有预警线的设置，但未设立专门止损条款。**在最不利的情况下，本计划收益率可能为零，同时投资者可能丧失全部本金，请投资者特别留意该风险。**

（6）本计划预警线不随净值调整的风险

本资产管理计划的预警线为 0.85 元；该预警线的设置不随着本计划净值波动而调整，也即无论委托人在开放期高于或者低于 1.00 元的价格参与本计划，该预警线均不做调整，请委托人留意此类风险。

（六）其他风险

1、火灾、地震等自然灾害、非因管理人、托管人自身原因导致的技术系统异常事故、政策法规的修改等等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托财产的损失；

2、金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出资产管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致资产委托人利益受损。

五、初始销售期间

（一）资产管理计划份额的初始销售期间

本计划初始销售期间自计划份额发售之日起不超过 1 个月，初始销售的具体时间由资产管理人根据相关法律法规以及本资产管理合同的规定确定，并在本计划投资说明书中披露。

资产管理人应当在开始销售某一资产管理计划后 5 个工作日内将资产管理合同、投资说明书、销售计划及中国证监会要求的其他材料报中国基金业协会备案。

（二）资产管理计划份额的销售方式

资产管理人自行销售，或者委托中国银行股份有限公司销售本资产管理计划份额。

（三）资产管理计划份额的销售对象

委托投资单个资产管理计划初始金额不低于 100 万元人民币（不含认购费用），且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人和依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定客户。

单个资产管理计划的委托人不得超过 200 人；中国证监会另有规定的除外。

（四）资产管理计划份额的认购费用

认购本计划份额的认购费用采用前端收费模式，即在认购本计划份额时缴纳认购费。本计划份额采用金额认购的方式。投资者的认购金额包括认购费用和净认购金额。有效认购款项在计划募集期间产生的利息将折算为计划份额，归计划份额持有人所有，其中利息转份额以资产管理计划注册登记机构的记录为准。

认购本资产管理计划时，资产委托人需另外交纳认购费用，由销售机构收取，认购费率为 0.6%。

资产管理人、资产托管人协商一致，可以在法律法规和本合同规定范围内调低认购费率或调整收费方式。如降低费率或调整收费方式，资产管理人应在调整实施前 3 个工作日告知资产委托人。资产管理人和代理销售机构在网站公告前述

调整事项即视为履行了告知义务。

（五）资产管理计划份额的认购价格和持有限额

初始销售期间，计划份额的参与价格为 1.00 元人民币。

认购资金应以现金形式交付。特定客户初始认购本资产管理计划份额资产净值不低于 100 万元人民币，并可多次认购，认购期间追加参与的最低金额为人民币 10 万元，追加参与金额需为 10 万元的整数倍。。资产管理人有权对每个账户的认购和持有计划份额进行限制，具体限制参见投资说明书或相关公告。

本计划的委托人不少于 2 名且不得超过 200 名。

若法律法规将来另有规定的，从其规定。

委托人的认购资金在初始销售期间发生的利息收入按银行活期存款利率（税后）计算。该利息收入在初始销售期结束后折合成计划份额，归资产委托人所有。利息转份额以注册登记机构的记录为准。

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购金额利息) / 计划份额初始面值

认购份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入资产管理计划财产。

（六）认购申请的确认和查询

认购总金额超过或临近超过 10 亿元规模上限时，资产管理人将根据“时间优先，金额优先”原则对认购申请予以确认。

认购申请受理完成后，投资人不得撤销。销售网点受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。认购申请采取时间优先、时间相同（指认购申请日期相同）的金额优先原则进行确认。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。投资人应了解认购申请被部分或全部确认失败的可能性，并应在本合同生效后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额，并同意以注册登记机构的确认结果作为净认购金额和份额的确认依据。

委托人应当及时查询和确认认购申请的相关信息。确认无效的申请，销售机构将退还委托人已交付的认购款项本金和银行同期存款利息。

（七）初始销售期间客户资金的管理

资产管理计划份额初始销售期间，资产管理人应当将初始销售期间客户的资金存入专门账户。在资产管理计划初始销售行为结束之前，任何机构和个人不得动用。