

---

# 财富证券财富 606 号集合资产管理计划

## 合同变更征询及生效公告

财富证券财富 606 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）成立于 2019 年 12 月 25 日，投资者、管理人、托管人均于《财富证券财富 606 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》）的合同当事人。经管理人与托管人协商一致，现拟对《资产管理合同》的相关条款进行变更，相关条款的具体修改详见附件 1，本次合同变更未改变本集合计划的风险等级。

### 一、合同变更的程序

根据《资产管理合同》第二十五章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”的有关约定，我司已就本次合同变更事宜与托管人中国建设银行股份有限公司湖南省分行达成一致。同时，管理人按照《资产管理合同》约定，对不同意变更的投资者，管理人保障其退出集合计划的权利。投资者可于征询意见期，即 2023 年 12 月 21 日至 2023 年 12 月 25 日的交易时间内对本次合同变更做出如下选择：

①投资者不同意变更的，应在开放日（即 2023 年 12 月 25 日）的交易时间内退出本集合计划。

②投资者未在征询意见期内回复意见也未在开放日内退出集合计划的，则投资者已以行为表明其同意公告中载明的全部变更事项。

③对于明确答复不同意合同变更但在开放日内仍未退出本集合计划的投资者，管理人将有权在征询意见期届满后将相关份额做强制退出处理（以实际退出日前一工作日集合计划单位净值计算退出金额），由此产生的相关费用及或有损失由投资者自行承担。

投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致后根据合同规定变更合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

### 二、合同变更的生效

---

本次合同变更的内容将于征询意见期限届满的次一工作日(即 2023 年 12 月 26 日)生效，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

### 三、特别提示

《资产管理合同》第二十五章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”第（三）节“集合计划/合同的终止”拟进行变更，变更后：本集合计划总份额低于 1000 万时，管理人有权（但并非必须）终止本集合计划；特别的，如某开放日确认投资者参与、退出申请后将导致集合计划总份额低于 1000 万或仅剩余管理人自有资金（含子公司、孙公司）的，管理人有权拒绝当日全部参与、退出申请并终止资管计划、进入清算程序；若某开放日确认投资者参与、退出申请后将导致剩余投资者少于二人的，管理人有权拒绝当日全部参与、退出申请并终止资管计划、进入清算程序。

如有疑问，请您致电咨询本公司资产管理业务客户服务电话 0731-84403481。

附件 1：《资产管理合同》变更条款对照表

附件 2：《征询意见函》样本

财信证券股份有限公司

2023 年 12 月 20 日

附件 1：《资产管理合同》变更条款对照表

<b>《财富证券财富 606 号集合资产管理计划资产管理合同》</b>	
变更前	变更后
<p><b>三、承诺与声明</b></p> <p><b>(一) 管理人承诺</b></p> <p>3、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。</p>	<p><b>三、承诺与声明</b></p> <p><b>(一) 管理人承诺</b></p> <p>3、管理人切实履行主动管理职责，按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用受托财产，不保证受托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。</p> <p>4、管理人是依法设立的证券经营机构，并经中国证监会批准，具有从事客户资产管理业务的资格。</p> <p>5、管理人尊重并保护投资者隐私，在投资者购买本资管计划时，管理人将按照《财信证券股份有限公司个人信息处理规则》（以下简称“《个人信息处理规则》”，详见 <a href="https://stock.hnchasing.com">https://stock.hnchasing.com</a>）收集、使用、共享、转让、公开披露、存储、保护客户信息。请投资者在使用管理人的服务前仔细阅读相关条款，并确认已经充分理解条款全部内容。管理人承诺对投资者的信息进行严格保密，如确需公开披露时，除法律、法律程序、诉讼或政府主管部门强制性要求的情况下，管理人会征得投资者同意。</p>
<p><b>三、承诺与声明</b></p> <p><b>(三) 投资者声明</b></p> <p>1、符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。</p> <p>2、财产的来源及用途符合国家有关规定，不属于违法犯罪所得及其收益，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资</p>	<p><b>三、承诺与声明</b></p> <p><b>(三) 投资者声明</b></p> <p>1、符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况、金融资产状况、投资知识和经验、专业能力以及风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。管理人已告知未提供或者未按照要求提供信息的后果，本人自愿承担因未提供或者未按照要求提供前述</p>

金投资本集合计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。

3、已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本集合计划将自行承担投资风险。

4、出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。参加本资管计划不损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

资料可能导致的无法认购或参与本集合计划的后果。

2、财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。

3、已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本集合计划将自行承担投资风险。

4、投资者同意管理人根据《中华人民共和国个人信息保护法》的要求提供和处理个人信息，并同意管理人基于为投资者提供产品或服务、本产品成立、备案、投资运作需要以及有权机构要求，包括但不限于向投资者提供各类产品和服务及提高产品和服务质量，与投资者进行联络、沟通，了解投资者的需求，建立、复查、维护、发展与投资者的关系，根据法律法规规定的、管理人应履行的反洗钱、投资者适当性管理、合格投资者管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、持续信息服务等法定职责或者法定义务、为订立、履行投资者作为一方当事人的产品合同所必需，以及在合法合规的前提下，为提升投资者对管理人服务的使用体验、增强管理人的安全机制等目的，使用并处理投资者提供的个人信息，并向司法机关、监管机构、行业自律组织、中介机构、投资相关对手方、托管机构及其他在合法合规前提下需取得个人信息的机构或组织提供管理人处理的个人信息。

如管理人处理的个人信息不限于投资者自身且投资者同意提供超出投资者自身的个人信息，投资者保证其向管理人提供该等超过投资者自身的个人信息前，已经合法取得该等个人信息且已经告知该等个人信息的信息主体并已经取得了

	信息主体的授权与同意。
<p>四、当事人及权利义务</p> <p>(二) 当事人权利义务</p> <p>1、投资者的权利义务</p> <p>(1) 投资者的权利</p> <p>6) 法律法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。</p>	<p>四、当事人及权利义务</p> <p>(二) 当事人权利义务</p> <p>1、投资者的权利义务</p> <p>(1) 投资者的权利</p> <p>6) 《个人信息保护法》规定的个人信息处理活动中的权利，包括但不限于知情权、决定权、查阅、复制、请求转移、更正、补充、删除、撤回同意等，权利行使方式以管理人《个人信息处理规则》为准；</p> <p>7) 法律法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。</p>
<p>四、当事人及权利义务</p> <p>(二) 当事人权利义务</p> <p>1、投资者的权利义务</p> <p>(2) 投资者的义务</p> <p>12) 法律法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。</p>	<p>四、当事人及权利义务</p> <p>(二) 当事人权利义务</p> <p>1、投资者的权利义务</p> <p>(2) 投资者的义务</p> <p>12) 出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。参加本资管计划不损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益；</p> <p>13) 法律法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。</p>
<p>四、当事人及权利义务</p> <p>(二) 当事人权利义务</p> <p>2、管理人的权利义务</p> <p>(2) 管理人的义务</p> <p>18) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；</p> <p>.....</p> <p>26) 法律法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。</p>	<p>四、当事人及权利义务</p> <p>(二) 当事人权利义务</p> <p>2、管理人的权利义务</p> <p>(2) 管理人的义务</p> <p>18) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；</p> <p>.....</p> <p>26) 保证向投资者支付的受托资金及收益(如有)返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户；</p> <p>27) 法律法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。</p>
<p>四、当事人及权利义务</p> <p>(二) 当事人权利义务</p> <p>3、托管人的权利义务</p> <p>(2) 托管人的义务</p> <p>15) 国家有关法律法规、监管机构及资</p>	<p>四、当事人及权利义务</p> <p>(二) 当事人权利义务</p> <p>3、托管人的权利义务</p> <p>(2) 托管人的义务</p> <p>15) 应当向管理人提供其控股股东、实际</p>

<p>产管理合同规定的其他义务。</p>	<p>控制人及其他关联方的名单，托管人应当保证该名单的真实性、准确性和完整性，若该名单发生变更时，托管人应及时书面通知管理人；</p> <p>16) 国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。</p>
<p><b>五、资产管理计划的基本情况</b></p> <p><b>(四) 集合计划的投资</b></p> <p><b>1、投资目标</b></p> <p>在控制风险的前提下，追求投资者收益最大化，争取实现集合计划资产在管理期限内的稳健增值。</p> <p><b>3、投资比例</b></p> <p>(1) 债权类资产和资产管理产品：占本集合计划资产总值的 80-100%；</p> <p>(2) 金融衍生品类资产账户权益：占本集合计划资产总值的 0-20%；</p> <p>(3) 本集合计划参与债券回购融入资金余额不超过集合计划资产净值的 100%。如投资于资产管理产品的，应穿透核查，确保最终投资标的均为标准化资产，穿透后的最终投资比例符合本集合计划要求。本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本集合计划所投资资产的金额或比例。</p>	<p><b>五、资产管理计划的基本情况</b></p> <p><b>(四) 集合计划的投资</b></p> <p><b>1、投资目标</b></p> <p>在控制和分散投资组合风险的前提下，争取实现集合计划资产在管理期限内的稳健增值。</p> <p><b>3、投资比例</b></p> <p>(1) 现金及债权类资产：占本集合计划资产总值的 80-100%；</p> <p>(2) 期货和衍生品类资产：投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例低于资产管理计划总资产的 80%或期货和衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产 20%；</p> <p>(3) 本集合计划参与债券回购融入资金余额不超过集合计划资产净值的 100%。</p> <p>(4) 如投资于资产管理产品的，应穿透核查，确保最终投资标的均为标准化资产，本集合计划穿透后的最终投资比例符合固定收益类产品的要求。本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本集合计划所投资资产的金额或比例。</p>
<p><b>八、资产管理计划的参与、退出与转让</b></p> <p><b>(一) 参与和退出的场所</b></p> <p>本集合计划的销售机构包括财富证券有限责任公司及其他经管理人委托具有基金销售资格的机构。投资者应当在销售机构办理资产管理计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划的参与和退出。</p> <p><b>(二) 参与和退出的时间</b></p> <p>2、开放频率及时限：本集合计划定期开放。自集合计划成立之日起每满 12 个月之对应日（非交易日顺延至下一个交易日）为本集合计划固定开放期，每个开放期开放 1 个工作日。例如，本集合计划于 2019 年 09 月 16 日成立，则首个</p>	<p><b>八、资产管理计划的参与、退出与转让</b></p> <p><b>(一) 参与和退出的场所</b></p> <p>本集合计划的销售机构包括财信证券股份有限公司及其他经管理人委托具有公开募集证券投资基金销售资格的机构。投资者应当在销售机构办理资产管理计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划的参与和退出。管理人可根据情况变更或增减销售机构，具体的销售机构将由管理人在相关公告中列明。</p> <p><b>(二) 参与和退出的时间</b></p> <p>2、开放频率及时限：本集合计划定期开放。自集合计划成立之日起每满 12 个月之对应日（非交易日顺延至下一个交易</p>

固定开放期为 2020 年 09 月 16 日，其后固定开放期依次为 2021 年 09 月 16 日、2022 年 09 月 16 日…，以此类推。在开放期，投资者可以申请退出，也可以依法参与本集合计划，具体以管理人公告为准。管理人有权根据实际情况调整具体开放期日期及天数并公告。

### （三）临时开放期

由于合同变更、法律法规及相关监管要求变动的情形下，管理人可设置临时开放期，临时开放期原则上只能办理退出、不能参与，具体安排以管理人公告为准。

### （四）参与和退出的方式、价格、程序及确认

#### 1、参与和退出的方式、价格

##### （1）参与的方式、价格

① 本集合计划采用金额参与的方式，即以参与金额申请。

② “未知价”原则，即集合计划的参与价格为参与申请日集合计划的单位净值，管理人根据参与申请日计划单位净值计算其参与份额。

##### （2）退出的方式、价格

① 本集合计划采用份额退出的方式，即退出以份额申请，申请退出份额精确到小数点后两位。

② “未知价”原则，即集合计划的退出价格为退出申请日集合计划的单位净值，管理人以退出申请日集合计划单位净值为计价基准进行退出金额计算。

③ “先进先出”原则，即对同一投资者在该销售机构参与的集合计划份额进行退出处理时，参与确认日在前的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出。

#### 2、集合计划参与和退出的程序及确认

##### （1）参与的程序与确认

④ 投资者参与申请确认成功后，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。

### （十二）拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式

1、如出现如下情形，集合计划管理人可

日)为本集合计划固定开放期，每个开放期开放 1 个工作日。在开放期，投资者可以申请参与或退出本集合计划，具体以管理人公告为准。管理人有权根据实际情况调整开放期的日期、天数及参与、退出安排并公告。

### 3、违约退出

出于人道及社会关怀考虑，当投资者于封闭期内出现身患重疾、突发意外等急需使用资金的情形时，在提供情形说明及相关佐证材料后，可以向管理人书面申请违约退出。收到投资者的申请违约退出的书面文件后，管理人有权为投资者办理份额强制退出，也有权拒绝办理投资者的违约退出申请。违约退出费率参考本合同的退出费率。

### （三）临时开放期

由于合同变更、法律法规及相关监管要求变动的情形下，管理人可设置临时开放期，临时开放期只能办理退出、不能参与，具体安排以管理人公告为准。

### （四）参与和退出的方式、价格、程序及确认

#### 1、参与和退出的方式、价格

##### （1）参与的方式、价格

① “金额参与”原则，即参与以金额申请。

② “未知价”原则，即参与价格为申请日（T 日）当日的份额净值。

##### （2）退出的方式、价格

① 本集合计划采用份额退出的方式，即退出以份额申请，申请退出份额精确到小数点后两位。

② “未知价”原则，即退出价格为退出申请日（T 日）当日的单位净值；巨额退出的情形另行约定。

③ “先进先出”原则，即对同一投资者在该销售机构参与的集合计划份额进行退出处理时，参与确认日期在前的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出。

#### 2、集合计划参与和退出的程序及确认

##### （1）参与的程序与确认

④ 销售机构在 T 日的规定时间内受理投

以拒绝或暂停集合计划投资者的参与申请：

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

(2) 本集合计划出现或可能出现超额或超人数募集情况；

(3) 集合计划管理人、集合计划托管人或份额登记机构的技术保障或人员支持等不充分；

(4) 管理人和销售机构知道投资者身份不真实、委托资金来源不合法或者对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；

(5) 发生集合资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况；

(6) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有投资者利益时；

(7) 集合计划资产规模过大，使管理人无法找到合适的投资品种，或可能对业绩产生负面影响，或其他损害现有投资者的利益；

(8) 其他可能对本集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有投资者利益的情形；

(9) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。

投资者的参与申请被拒绝时，被拒绝的参与款项将无息退还给投资者，各方互不承担其他责任。

2、发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的退出申请：

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市、登记结算机构或银行结算系统无法正常运行等导致当日集合计划资产净值无法计算；

(3) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有投资者利益时；

(4) 因市场剧烈波动等原因而出现巨额退出或连续巨额退出时，或者其他原因，导致本集合计划的现金支付出现困难

投资者申请，管理人在收到投资者参与申请的 T+1 日内对该交易的有效性进行确认，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，具体以管理人和销售机构业务办理规则为准。

## (十二) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式

1、发生下列情形时，集合计划管理人可以拒绝或暂停受理集合计划投资者的参与申请：

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

(2) 集合计划管理人、集合计划托管人或份额登记机构的技术保障或人员支持等不充分；

(3) 发生集合资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况；

(4) 其他可能对本集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有投资者利益的情形；

(5) 证券交易场所交易时间非正常停市、登记结算机构或银行结算系统无法正常运行等导致当日集合计划资产净值无法计算；

(6) 若集合计划开放日确认投资者参与、退出申请后将导致集合计划总份额低于 3000 万或仅剩余管理人自有资金（含子公司、孙公司）的；

(7) 若集合计划开放日确认投资者参与、退出申请后将导致剩余投资者少于二人的；

(8) 存续期内，本集合计划投资者人数或规模接近或达到合同约定的最高规模上限（如有）；

(9) 管理人和销售机构知道投资者身份不真实、参与资金来源不合法或者对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；

(10) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有投资者利益时；

(11) 法律法规、中国证监会规定或本合



时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；

(5) 法律、法规和中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，管理人应立即公告。已接受的退出申请，若管理人有足额支付能力，则管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续工作日予以兑付。发生拒绝或暂停受理退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露，在暂停退出的情况消除后 20 个工作日内及时恢复退出业务的办理。

#### (十四) 管理人自有资金参与集合计划

1、自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《暂行规定》和中国证监会及中国证券业协会、中国证券投资基金业协会的相关规定。

#### 2、自有资金的参与方式：

管理人可在集合计划募集期和存续期内，选择以自有资金参与本集合计划份额。管理人也可选择不以自有资金参与集合计划份额。

#### 3、自有资金参与的金额和比例

管理人以自有资金参与本集合计划的，参与金额不得低于本资产管理计划最低参与金额，参与份额应小于本集合计划份额总数的 16%，且管理人及其附属机构以自有资金参与本集合资产管理计划的份额合计不得超过该计划总份额的 50%，具体参与金额以管理人公告为准。上述自有资金的参与份额占比如果出现除不尽的情况，可由管理人按照实际计算情况进行调整，最终误差不得超过 0.1%。

#### 4、自有资金的收益分配

管理人自有资金参与份额与其他投资者持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，本合同另有约定的除外。

同认定的其它可拒绝或暂停参与的情形。

发生上述(1)-(7)、(11)项暂停或拒绝参与的情形时，管理人应通过管理人网站及时公告。投资者的参与申请被拒绝时，被拒绝的参与款项将无息退还给投资者，各方互不承担其他责任。

2、发生下列情形时，与托管人协商后，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的退出申请：

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市、登记结算机构或银行结算系统无法正常运行等导致当日集合计划资产净值无法计算；

(3) 因市场剧烈波动等原因而出现巨额退出或连续巨额退出时，或者其他原因，导致本集合计划的现金支付出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；

(4) 发生集合资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况；

(5) 若集合计划开放日确认投资者参与、退出申请后将导致集合计划总份额低于 3000 万或仅剩余管理人自有资金（含子公司、孙公司）的；

(6) 若集合计划开放日确认投资者参与、退出申请后将导致剩余投资者少于二人的；

(7) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有投资者利益时；

(8) 法律法规、中国证监会规定或本合同认定的其他可拒绝或暂停退出的情形。

发生上述(1)-(6)、(8)项暂停或拒绝退出的情形时，管理人通过管理人网站及时公告。已接受的退出申请，若管理人有足额支付能力，则管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将按投资者单个账户已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，

5、自有资金责任承担方式和金额  
管理人参与的自有资金所持的集合计划份额与投资者所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。管理人自有资金不承担对其他投资者参与份额的补偿责任。

#### 6、自有资金的退出

(1)管理人自有资金的退出,符合以下任一条件即可:

①管理人自有资金参与本集合计划持有的份额在符合法律、行政法规等关于自有资金退出规定的情况下,可以与其他投资者同样办理退出业务;

②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过法律、法规规定比例。

(2)管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于6个月,参与、退出时应当提前5个工作日通过管理人指定网站告知投资者和托管人;但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过法律、法规及本合同规定比例,而导致管理人自有资金退出的可以不受本条前述约定限制。管理人应在被动超过比例之日起15个工作日内调整达标。

7、为应对巨额赎回以解决流动性风险,或者中国证监会认可的其他情形,在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下,管理人及其附属机构自有资金参与、退出可不受前述条款限制,但应当及时告知投资者和托管人(告知方式为在管理人网站进行公告),并向管理人所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

其余部分在后续工作日予以兑付。在暂停退出的情况消除时,管理人应及时恢复退出业务的办理。

#### (十四) 管理人自有资金参与集合计划

##### 1、自有资金参与的条件:

投资者、托管人签署本合同即视为已充分理解并同意管理人及其子公司(孙公司)在募集期可以自有资金参与本集合计划。管理人及其子公司(孙公司)在募集期和存续期以自有资金参与本集合计划,应符合法律法规、监管规定和本合同的相关规定。

##### 2、自有资金的参与方式:

管理人可在集合计划募集期和存续期内,选择以自有资金参与本集合计划份额。管理人也可选择不以自有资金参与集合计划份额。

##### 3、自有资金参与期限以及参与的金额和比例

管理人及其子公司(孙公司)自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于6个月。管理人以自有资金参与本集合计划的,参与份额应不超过本集合计划份额总数的15%,且管理人及其子公司(孙公司)以自有资金参与本集合资产管理计划的份额合计不得超过该计划总份额的50%,具体参与金额以管理人公告为准。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的,从其规定。上述自有资金的参与份额占比如果出现除不尽的情况,可由管理人按照实际计算情况进行调整,最终误差不得超过0.1%。

##### 4、自有资金的收益分配、责任承担方式和金额

管理人参与的自有资金所持的集合计划份额与投资者所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。管理人自有资金不承担对其他投资者参与份额的补偿责任。

##### 5、自有资金的退出

管理人及其子公司(孙公司)自有资金如需退出,需符合以下任一条件:

①管理人及其子公司(孙公司)自有资金参与本集合计划持有的份额在符合法

	<p>律、行政法规、本合同等关于自有资金退出规定的情况下，可以与其他投资者同样办理退出业务；</p> <p>②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过法律法规及本合同规定比例。</p> <p>③法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。</p> <p>6、管理人及其子公司（孙公司）自有资金存续期参与、退出时应当提前 5 个工作日通过管理人指定网站公告/函件/邮件等形式告知全体投资者和托管人，并征询投资者及托管人意见。投资者不同意管理人及其子公司（孙公司）自有资金参与、退出的，可在开放期内申请退出持有的集合计划份额，托管人不同意的，应在开放期前书面告知管理人。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过法律法规及本合同规定比例的，管理人及其子公司（孙公司）自有资金退出可不受本条款限制，管理人应当及时调整达标并通过管理人指定网站公告/函件/邮件等形式告知全体投资者和托管人。</p> <p>7、为应对巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其子公司（孙公司）自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受前述条款约定的比例、时间、提前告知全体投资者及托管人及取得其同意的限制，但应当及时通过管理人指定网站公告/函件/邮件等形式告知投资者和托管人，并向管理人所在地中国证监会相关派出机构报告。</p>
<p><b>十一、资产管理计划的投资</b></p> <p><b>（二）投资范围及比例</b></p> <p>1、投资范围</p> <p>（1）债权类资产：现金、银行存款（包括但不限于活期存款、协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单、大额存单、在银行间市场、证券交易所市场等经国务院同意设立的交易市场交易的国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债</p>	<p><b>十一、资产管理计划的投资</b></p> <p><b>（二）投资范围及比例</b></p> <p>1、投资范围</p> <p>（1）债权类资产：依法发行的债券、资产支持证券等固定收益证券，主要包括国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（包括政策性金融债、金融机构次级债、混合资本债）、公司债券、非金融企业债务融资工具（含</p>

券、金融债（包括政策性金融债、金融机构次级债、混合资本债）、企业债券、公司债券（含大公募、小公募和非公开发行人债券和中小企业私募债券）、债券逆回购、中期票据（含长期限含权中期票据）、短期融资券及超短期融资券、可转换债券、非公开定向债务融资工具、次级债、可交换债券（包括私募品种）、证券公司发行的短期公司债券、资产证券化产品（如资产支持证券、资产支持票据等。资产支持证券为在沪深交易所交易的优先级份额，且底层资产不得为资管产品）等标准化债权类资产；

（2）资产管理产品：固定收益类公开募集证券投资基金、货币市场基金；

（3）金融衍生品类资产：国债期货；

（4）本集合计划可参与债券正回购业务。

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。

## 2、资产配置比例

（1）债权类资产和资产管理产品：占本集合计划资产总值的 80-100%；

（2）金融衍生品类资产账户权益：占本集合计划资产总值的 0-20%；

（3）本集合计划参与债券回购融入资金余额不超过集合计划资产净值的 100%。如投资于资产管理产品的，应穿透核查，确保最终投资标的均为标准化资产，穿透后的最终投资比例符合本集合计划要求。本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本集合计划所投资资产的金额或比例。

**（三）投资比例超限的处理方式及流程**  
如因管理人之外的因素造成本集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日将投资比例降至许可范围内。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整

中期票据、短期融资券及超短期融资券、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、次级债、资产支持票据（ABN）、资产支持证券（具体为信贷资产支持证券、证券交易所挂牌交易的资产支持证券）、同业存单、可转换债券、可交换债券（包括私募品种）、以及固定收益类公开募集证券投资基金、货币市场基金和经人民银行等金融监督管理部门认定的其他标准化债权类资产；存款（包括协议存款、通知存款、定期存款、大额存单）以及债券逆回购形成的资产；

（2）期货和衍生品类资产：国债期货；

（3）现金；

（4）本集合计划可参与债券正回购业务。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。

## 2、资产配置比例

（1）现金及债权类资产：占本集合计划资产总值的 80-100%；

（2）期货和衍生品类资产：投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例低于资产管理计划总资产的 80%或期货和衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产 20%；

（3）本集合计划参与债券回购融入资金余额不超过集合计划资产净值的 100%。

（4）如投资于资产管理产品的，应穿透核查，确保最终投资标的均为标准化资产，本集合计划穿透后的最终投资比例符合固定收益类产品的要求。本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本集合计划所投资资产的金额或比例。

**（三）投资比例超限的处理方式及流程**  
如因管理人之外的因素造成本集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日将投资比例降至许可范围内。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整

的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

### **(七) 投资限制及禁止行为**

#### **1、投资限制**

为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：

(1) 本集合计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

(2) 本集合计划总资产/净资产不得超过 200%，计算总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

(3) 本集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过本集合计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

(4) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过集合计划资产净值的 20%。

(5) 投资于信用类债券：短期融资券、超短期融资券，主体评级在 AA-（含）以上且债项评级为 A-1（含）以上（无债项评级则以主体评级为准）；除短期融资券、超短期融资券以外信用债券的主体或债项或担保人评级应为 AA 级（含）以上；

(6) 投资于资产证券化产品优先档的公开债项评级应为 AA 级（含）以上；投资于资产支持证券的，其底层资产不得为资管产品；

(7) 投资于主体评级为 AA-级别短期融资券、超短期融资券不超过资产总值的 50%；

(8) 投资于可转换债券、可交换债券的，不得进行转股；  
中国证监会另有规定的除外。

的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

### **(七) 投资限制及禁止行为**

#### **1、投资限制**

为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：

(1) 本集合计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过集合计划的总资产，所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。

(2) 本集合计划总资产/净资产不得超过 200%，计算总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

(3) 本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%时，本集合计划的总资产不得超过净资产的 120%，本集合计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；

(4) 本集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过本集合计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

(5) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过集合计划资产净值的 20%。

(6) 本集合资产管理计划投资于其他资产管理产品的，所投资的资产管理产品不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品；

(7) 投资于信用类债券：短期融资券、超短期融资券，主体评级在 AA-（含）以上且债项评级为 A-1（含）以上（无债项评级则以主体评级为准）；除短期融资券、超短期融资券以外信用债券的主体或债项或担保人评级应为 AA 级（含）以上；

如因管理人之外的因素造成集合计划投资不符合限制内容的，管理人应当在不符合事项发生之日起，在具备交易条件的15个交易日内调整至符合要求。

如因证券期货市场波动、资产管理计划规模变动等管理人之外的原因致使国债期货投资比例不符合规定的，管理人应当在10个交易日内调整完毕，同时在该情形发生之日起2个工作日内向管理人住所地证监局报告。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行合同变更程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

## 2、禁止行为

(1)不得违规将集合计划资产用于资金拆借、抵押融资、对外担保或者直接投资于商业银行信贷资产等用途；

(2)不得将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；

(3)不得为其他机构、个人或者资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道服务；不得为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利；

(4)不得由投资者或其指定第三方自行负责尽职调查或者投资运作或由投资者或其指定第三方下达投资指令或者提供投资建议；

(5)不得约定由管理人根据投资者或其指定第三方的意见行使资产管理计划所持证券的权利。

(6)不得向投资者做出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；

(7)不得侵占、挪用集合计划资产；

(8)不得利用集合计划进行商业贿赂；

(9)不得利用集合计划为投资者以外的第三方谋取不正当利益；

(10)不得为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利；

(11)不得使募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；

(12)不得使募集资金超过计划说明书约定的规模；

(8)本集合计划不得投资于资产支持证券和资产支持票据的劣后级，投资于资产支持证券和资产支持票据优先级的公开债项评级应为AA级(含)以上(如无债项评级，则以主体评级为准)。本集合计划如投资于资产支持证券或资产支持票据，其基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权。

(9)投资于主体评级为AA-级别短期融资券、超短期融资券不超过资产总值的50%；

(10)投资于可转换债券、可交换债券的，不得进行转股；

(11)在开放退出期内，本集合计划资产组合中7个工作日可变现资产的价值，不得低于集合计划资产净值的10%。

(12)上述债券评级不参考中债资信评估有限责任公司评级结果。

中国证监会另有规定的除外。

如因管理人之外的因素造成集合计划投资不符合限制内容的，管理人应当在不符合事项发生之日起，在具备交易条件的20个交易日内调整至符合要求。

如因证券期货市场波动、资产管理计划规模变动等管理人之外的原因致使国债期货投资比例不符合规定的，管理人应当在10个交易日内调整完毕，同时在该情形发生之日起2个工作日内向管理人住所地证监局报告。

管理人可根据新颁布或新修改的法律法规或监管机关要求，对上述投资限制及调整时间进行修改，并在管理人网站公告告知投资者。

## 2、禁止行为

(1)为资产管理产品投资的非标准化债权类资产或者股权类资产提供任何直接或间接、显性或隐性的担保、回购等代为承担风险的承诺；

(2)以资产管理产品的资金与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等；

(3)以资产管理产品份额进行质押融

(13) 不得接受单一投资者参与资金低于中国证监会规定的最低限额；

(14) 不得以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用集合计划资产进行不必要的交易；

(15) 不得利用本集合计划从事内幕交易、非公平交易、利益输送、操纵市场、不正当关联交易，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资及其他不当、违法的证券期货业务活动，违反公平交易规定、损害投资者合法权益的行为；

(16) 不得直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：

1) 投资项目被列入国家发展改革委最新发布的淘汰类产业目录；

2) 投资项目违反国家环境保护政策要求；

3) 通过穿透核查，投资标的最终投向上述投资项目；

(17) 不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；

(18) 不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止投资的行业和领域；

(19) 不得直接或者间接向投资者返还管理费；

(20) 不得通过办理集合资产管理计划的份额转让，公开或变相公开募集资产管理计划；

(21) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

资，放大杠杆；

(4) 向投资者做出保证其财产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；

(5) 利用资产管理计划从事内幕交易、操纵市场或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

(6) 为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利；

(7) 从事非公平交易、利益输送等损害投资者合法权益的行为；

(8) 利用资产管理计划进行商业贿赂；

(9) 侵占、挪用资产管理计划财产；

(10) 利用资产管理计划或者职务便利为投资者以外的第三方谋取不正当利益；

(11) 直接或者间接向投资者返还管理费；

(12) 以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用资产管理计划资产进行不必要的交易；

(13) 通过办理集合资产管理计划的份额转让，公开或变相公开募集资产管理计划；

(14) 直接投资于商业银行信贷资产；

(15) 违规为地方政府及其部门提供融资，要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；

(16) 直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域；

(17) 为其他机构、个人或者资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道服务；

(18) 由投资者或其指定第三方自行负责尽职调查或者投资运作；

(19) 由投资者或其指定第三方下达投资指令或者提供具体投资标的等实质性投资建议；

(20) 管理人根据投资者或其指定第三方的意见行使资产管理计划所持证券的权利；

(21) 投资于法律依据不充分的收（受）益权；

(22) 除将集合计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际

	<p>控制人或者其他关联方发行或者承销期内承销的证券外，管理人不得将其管理的资产管理计划资产，直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于1000万元，并且事先取得投资者同意的除外；</p> <p>(23) 直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：  1) 投资项目被列入国家发展改革委最新发布的淘汰类产业目录；  2) 投资项目违反国家环境保护政策要求；  3) 通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目；</p> <p>(24) 利用本集合计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；</p> <p>(25) 为管理人或他人违规持有金融机构股权提供便利；</p> <p>(26) 通过投资其他资产管理产品变相扩大投资范围或者规避监管要求；</p> <p>(27) 开展明股实债投资；</p> <p>(28) 法律、行政法规、中国证监会和自律组织禁止的其他行为。</p>
<p><b>十四、利益冲突及关联交易</b>  <b>(一) 资产管理计划利益冲突的情形及处理方式</b>  1、本计划存在或可能存在如下利益冲突的情形：  (1) 若发生管理人开展的不同业务之间的敏感信息不当流动和使用，导致管理人其他业务与管理人资产管理业务可能存在利益冲突。  (2) 若发生不同投资经理管理的资产管理计划的持仓、交易等重大非公开信息的不当流动和使用，导致管理人管理的不同资产管理计划之间可能存在利益</p>	<p><b>十四、利益冲突及关联交易</b>  <b>(一) 资产管理计划利益冲突的情形及处理方式</b>  1、本计划存在或可能存在如下利益冲突的情形：  (1) 管理人与客户之间可能存在利益冲突；  (2) 客户与客户之间可能存在利益冲突；  (3) 其他可能产生利益冲突的情形。  2、本计划存在利益冲突的处理方式及披露  (1) 利益冲突的处理方式</p>



冲突。

(3) 其他可能存在的管理人、管理人从业人员与资产管理计划及管理人管理的不同资产管理计划之间可能存在的利益冲突情形。

## 2、本计划存在利益冲突的处理方式及披露

### (1) 利益冲突的处理方式

管理人在业务开展过程中严格执行业务隔离和利益冲突防范的机制，对利益冲突进行识别和管理，若发现存在利益冲突情形的，管理人将遵循如下原则及时予以处理，维护本计划及投资者的合法权益：

① 在处理涉及到公司、从业人员与投资者之间的利益冲突时，严格坚持投资者利益至上的原则。

② 在处理涉及到投资者与投资者之间的利益冲突时，严格坚持公平对待投资者的原则。

### (2) 利益冲突的披露

对于实际发生的利益冲突情形，管理人将自发现之日起5个工作日内通过管理人网站公告将利益冲突的具体情形及管理人的处理安排等告知投资者。

## (二) 资产管理计划关联交易

1、投资者、托管人同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方（关联方按照《企业会计准则》的规定确定）公司发行或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，采取切实有效措施，防范利益冲突，并有充分证据证明未损害投资者利益。管理人从事关联交易遵循投资者利益优先原则，保护投资者权益，事后通过管理人网站及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露，并向管理人所在地中国证监会派出机构和证券投资基金业协会报告。

2、管理人不得将其管理的资产管理计划资产，直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为本机构、托管人

管理人在业务开展过程中应当有效防范并妥善处理利益冲突，在涉及到管理人与客户之间的利益冲突时，应当坚持客户利益至上的原则；在涉及到客户与客户之间的利益冲突时，应当坚持公平对待客户的原则。

### (2) 利益冲突的披露

对于实际发生的利益冲突情形，管理人应当视具体利益冲突情形和重要程度选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形及管理人的处置安排。

## (二) 资产管理计划关联交易

### 1、关联方定义

资产管理计划的管理人及其管理的资管产品、托管人、管理人及托管人的控股股东、实际控制人、有其他重大利害关系的关联方及按照《企业会计准则》等相关法律法规、自律规范认定的其他关联方。关联交易涉及的关联方名单将在关联交易发生之前通过管理人公告（[zg.stock.hnchasing.com](http://zg.stock.hnchasing.com)）或电子邮件等方式向投资者披露。

### 2、一般关联交易和重大关联交易

关联交易指资产管理计划在投资运作中与关联方发生的所有交易，包括但不限于以下交易：买卖关联方发行的或者承销期内承销的证券（包括股票、债券、资产支持证券等，下同）；投资于管理人及关联方发行的资管产品；与关联方开展证券等交易，交易对手方、质押券涉及关联方；投资于关联方的非标准化资产；法律法规及中国证监会规定为关联交易的其他事项。

关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。一般关联交易和重大关联交易的区分标准，根据法律法规、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构的规定或要求执行。

其中，重大关联交易包括但不限于资产管理计划资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券。重大关联交易之外的关联交

及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得投资者同意的除外。

3、 管理人不得以资产管理计划的资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场。

易为一般关联交易。

但以下交易不视为重大关联交易，包括：财信证券作为管理人独立做出投资决策并通过相关证券交易场所以竞价交易方式进行的无法提前明确交易对手方的交易；产品通过关联方交易单元进行的交易；从产品资产中支付给管理人、托管人的管理费、托管费、佣金等关联方报酬；管理人自有资金投资于产品的情况；在托管户保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。

如相关法律法规、自律规范对本集合计划适用的关联方及关联交易范围、一般关联交易和重大关联交易的区分标准以及关联交易审批等内部管控机制等有进一步规定的，本集合计划从其规定。

### 3、 关联交易的审批机制

管理人资产管理业务部门负责关联方的初次识别和关联交易初步筛查，并按规定发起内部决策程序；管理人关联交易主管部门、财务部门、合规部门根据各自部门职责对关联交易进行审批。关联交易价格应参照市场价格或非关联方同类型业务的市场参考价定价，关联交易应当符合合同约定的投资目标及策略。

### 4、 其他

管理人以集合计划资产从事关联交易的，应根据监管机构及自律组织出具的规范性文件、通知或备案指导意见等监督管理要求，事先取得投资者同意，事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露，并按照法律法规和监管机构的规定履行报告义务。

投资者、托管人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产从事一般关联交易。如本集合计划从事重大关联交易的，管理人应事先采取逐笔征求意见或公告确认等方式（监管机构及自律组织另有规定的，从其规定）征得投资者的同意。管理人以集合计划资产从事关联交易，应当建立健全内部审批机制和评估机制，采取切实有效措施，防范利益冲突，并有充分证据证明未损害投资者利益。

除将集合计划的资产投资于管理人、托

	<p>管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行或者承销期内承销的证券外，管理人不得将其管理的资产管理计划资产，直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得投资者同意的除外。</p> <p>本章前文所列的关联方、重大关联交易与一般关联交易的划分标准、关联交易范围、关联交易的审批安排，均系法律法规要求或管理人公司制度规定。如管理人公司制度发生修改或变更导致上述范围调整，管理人将执行修改后的制度，并根据本合同约定向投资者披露调整事项。</p> <p>投资者、托管人一致同意并授权管理人可以自行决定是否将本集合计划的全部或者部分受托财产投资于管理人、投资者、托管人及其或其关联方担任管理人的资产管理产品。管理人在履行了必要的程序及信息披露、报告义务后，视为管理人已经审慎尽责充分地履行了管理人职责义务，相关风险由投资者自行承担。</p>
<p><b>十六、资产管理计划的财产</b>  <b>（一）集合计划资产的保管与处分</b>          6、管理人因违背本合同、处理集合计划事务不当而造成集合计划财产损失的，由管理人以固有财产赔偿；不足赔偿时，由投资者自担。管理人承诺以投资者的最大利益为宗旨处理集合计划事务，并谨慎管理集合计划财产，但不承诺集合计划财产不受损失，亦不承诺集合计划财产的最低收益。</p>	<p>删除</p>
<p><b>十六、资产管理计划的财产</b>  <b>（二）集合计划相关账户的开立和管理</b>  <b>5、开放式证券投资基金账户的开立和管理</b>          管理人负责为本计划开立所需的基金账户。管理人在开立计划账户时应将托管资金账户作为赎回款、分红款指定收款</p>	<p><b>十六、资产管理计划的财产</b>  <b>（二）集合计划相关账户的开立和管理</b>  <b>5、开放式证券投资基金账户的开立和管理</b>          管理人负责为本计划开立所需的基金账户。管理人在开立计划账户时应将托管资金账户作为赎回款、分红款指定收款</p>

<p>账户。在托管人收到开户资料前，管理人不得利用该账户进行投资活动。托管人有权随时向份额登记机构查询该账户资料。</p>	<p>账户。在托管人收到开户资料前，管理人不得利用该账户进行投资活动。托管人有权随时向份额登记机构查询该账户资料。</p> <p>本集合计划可以通过第三方基金销售机构投资开放式基金。管理人确保所选择的销售机构取得基金销售业务资格，符合开展产品销售业务的各项资质和要求。对于第三方基金销售机构原因给本集合计划造成损失的，由管理人负责协商解决。</p>
<p>—</p>	<p><b>新增章节，其余章节序号顺延：</b></p> <p><b>十八、交易及交收清算安排</b></p> <p>本产品参与交易所场内证券投资，采取托管人结算模式，资产管理人与资产托管人/托管人总行应根据有关法律法规及相关业务规则，签订《托管银行证券资金结算协议》用以具体明确资产管理人与资产托管人/托管人总行在证券交易资金结算(含港股通)业务中的程序与责任。协议签署前，资产管理人应按资产托管人要求配合提供相应准入材料。资产管理人、资产托管人应遵守本合同下述（一）和（二）之约定。</p> <p>（一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序</p> <p>资产管理人负责选择代理本计划财产证券买卖的证券经营机构，使用其交易单元作为资产管理计划财产的交易单元。资产管理人应提前十个工作日书面通知资产托管人，并依据资产托管人要求提供相关资料，以便资产托管人申请办理接收结算数据手续。</p> <p>资产管理人应及时将资产管理计划财产交易单元专用号、佣金费率等基本信息以及变更情况以书面形式通知资产托管人。</p> <p>（二）投资证券后的清算交收安排</p> <p>1、结算备付金与保证金</p> <p>中国结算分别于每月前 6 个交易日及每月前 3 个交易日内，对结算参与人最低备付金限额与结算保证金限额进行重新核算、调整。资产托管人应分别于每月前 3 个交易日内及结算保证金调整当日通</p>

过《资金账户报告》通知资产管理人本计划最低备付金调整金额以及调整后的结算保证金金额。资产管理人应预留最低备付金和结算保证金，并根据中国结算确定的实际最低备付金、结算保证金数据为依据安排资金运作，调整所需的现金头寸。如因调整最低备付金、结算保证金后造成透支，资产管理人应视资产托管人最低结算备付金比例计收方式分别于下列时点补足透支金额：

(1) 固定备付金比例计收方式下，资产管理人应在调整最低备付金、结算保证金当日上午 11:00 之前补足金额。

(2) 差异化备付金比例计收方式下，资产管理人应最晚于资金交收日 8:30 前补足金额。

## 2、清算交收

资产托管人负责资产管理计划财产买卖证券交易的清算交收。证券交易所场内资金结算由资产托管人根据中国结算结算数据办理；其他场外资金汇划由资产托管人根据资产管理人的资金划款指令具体办理。

如果因为资产托管人自身过错在清算上造成资产管理计划财产的直接损失，应由资产托管人负责赔偿，但因中国人民银行、中国结算和银行间市场登记结算机构资金结算系统以及其他机构的结算系统发生故障等非资产托管人的过错造成清算资金无法按时到账的情形，资产托管人免责；如果因为资产管理人未事先通知资产托管人增加交易单元等事宜，致使资产托管人接收数据不完整，造成清算差错的责任由资产管理人承担；如果因为资产管理人未事先通知需要单独结算的交易，造成资产管理计划资产损失的由资产管理人承担；资产管理人应采取合理措施，确保在 T 日日终有足够的资金头寸用于 T+1 日中国结算的资金交收。如因资产管理人原因导致资金头寸不足，资产管理人应视资产托管人最低结算备付金比例计收方式分别于下列时点补足透支金额：

(1) 固定备付金比例计收方式下，资产

	<p>管理人应最晚于资金交收当日上午 11:00 之前补足金额。</p> <p>(2) 差异化备付金比例计收方式下, 资产管理人应最晚于资金交收日 8:30 前补足金额。</p> <p>如果资产管理人未遵循上述规定备足资金头寸, 影响了计划资产自身的清算交收及资产托管人与中国结算之间的一级交收, 由此给资产托管人、本资产管理计划财产及资产托管人托管的其他资产造成的损失由资产管理人负责。</p> <p>如果由于资产管理人违反市场操作规则的规定进行超买、超卖及质押券欠库等原因造成资产管理计划财产投资清算困难和风险的, 资产托管人在预清算结束后应通知资产管理人预透支和预欠库事项, 资产管理人应保持联系方式畅通, 后续补缴等事宜由资产管理人负责解决, 由此给资产托管人、本资产管理计划财产和资产托管人托管的其他资产造成的损失由资产管理人承担。</p> <p>根据中国结算结算规定, 资产管理人在进行融资回购业务时, 用于融资回购的债券将作为偿还融资回购到期购回款的质押券。如因资产管理人原因造成债券回购交收违约或因折算率变化造成质押欠库, 导致中国结算欠库扣款或对质押券进行处置造成的投资风险和损失由资产管理人承担。</p> <p>对于中国结算实行 T+0 非担保交收的业务, 资产管理人应在交易日 14:00 前将划款指令发送至资产托管人。因资产管理人指令传输不及时, 致使资金未能及时划入中国结算指定交收账户所造成的损失由资产管理人承担。包括赔偿在该市场引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用结算参与者最低备付金带来的利息损失。</p>
<p><b>十八、越权交易的界定</b></p> <p>(一) 越权交易的界定</p> <p>本合同约定的越权交易是指管理人违反有关法律法规的规定以及违反本合同的约定而进行的投资交易行为, 包括:</p> <p>1、违反本合同约定的投资范围和投资</p>	<p><b>十九、越权交易的界定</b></p> <p>(一) 越权交易的界定</p> <p>本合同约定的越权交易是指管理人违反有关法律法规的规定或违反本合同的约定而进行的投资交易行为。</p> <p>管理人应在有关法律法规和本合同规定</p>

比例限制等进行的投资交易行为；  
2、法律法规禁止的超买、超卖行为。  
管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用集合资产管理计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限从事投资。

#### （二）越权交易的处理程序

1、违反有关法律法规的规定或本合同约定的投资范围和投资比例限制进行的投资交易行为

托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反有关法律法规的规定，或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权向管理人所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的指令违反有关法律法规的规定，或本合同约定的，应立即通知管理人并有权向管理人所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

管理人应向托管人主动报告越权交易。托管人有权督促管理人在规定限期内改正并在该限期内对管理人报告的越权交易事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权报告相关监管机构。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为  
托管人在行使监督职能时，如果发现资产管理计划财产投资过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒资产管理人，由此给计划财产造成的损失由管理人承担。

#### （三）托管人对管理人投资运作的监督

1、托管人对管理人的越权交易行使监督权。托管人对集合资产管理计划财产的监督 and 检查自本集合计划成立之日起开始。

2、如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的，各方除履行必要的合同变更流程外，还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。

的权限内运用集合资产管理计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限从事投资。

#### （二）越权交易的处理程序

托管人在行使监督职责时，有充足理由认为管理人的投资指令有可能违反有关法律法规的规定或本合同约定的，应暂缓执行指令，并及时通知管理人，管理人收到通知后应及时核对并纠正（如需）；管理人未能按照托管人的通知对违规行为进行纠正的（如需），应当拒绝执行。如相关交易已生效，则应通知管理人及时纠正，并有权向管理人住所地中国证监会相关派出机构报告。

（三）托管人对管理人投资运作的监督  
托管人根据法律法规、本合同约定的《投资监督事项表》对管理人的投资行为行使监督权。托管人对管理人的投资监督和检查自本计划成立之日起开始。

#### （四）越权交易的例外

非因管理人主动投资行为导致的下列情形不构成本章所述越权交易：

1、如因管理人之外的因素造成本集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内将投资比例降至许可范围内。

如因管理人之外的因素造成本集合计划投资不符合限制内容的，管理人应当在不符事项发生之日起，在具备交易条件的 20 个交易日内调整至符合要求。

2、法律法规另有规定的从其规定。  
因越权交易例外的原因而对受托财产造成的损失由受托财产承担，管理人不因此而对受托财产的损失承担赔偿责任。

<p>(四) 越权交易的例外</p> <p>非因管理人主动投资行为导致的下列不符合投资政策的情形不构成本章所述越权交易：</p> <p>1、由于管理人之外的原因导致的投资比例出现不符合集合资产管理合同约定的投资政策的情形，管理人应在相应证券可交易之日起 15 个交易日内进行调整，以达到集合资产管理合同约定的投资政策的要求。</p> <p>2、法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>因越权交易例外的原因而对委托财产造成的损失由委托财产承担，管理人因此而对委托财产的损失承担赔偿责任。</p>	
<p><b>十九、资产管理计划财产的估值与会计核算</b></p> <p><b>(一) 集合计划财产的估值</b></p> <p>3、估值方法：</p> <p>在不违反现行法律法规的前提下，管理人按照公平、公允、保护投资者利益的原则选择合适的估值方法，并应就此与托管人达成一致。如国内证券投资会计原则及方法发生变化，由管理人与托管人另行协商确定估值方式。</p> <p>(1) 投资债权类资产的估值方法</p> <p>①同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p> <p>②在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p> <p>③在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且</p>	<p><b>二十、资产管理计划财产的估值与会计核算</b></p> <p><b>(一) 集合计划财产的估值</b></p> <p>3、估值方法：</p> <p>应符合本合同及法律、行政法规的规定，如未做明确规定的，参照行业通行做法处理。</p> <p>(1) 投资债权类资产的估值方法</p> <p>①证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>A、交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的相应品种对应的估值全价估值；</p> <p>B、交易所上市的可转换债券、可交换债券实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价；</p> <p>C、交易所市场挂牌转让的资产支持证券、非公开发行可转换债、非公开发行可交换债和私募债券等，选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的相应品种对应的估值全价估值；</p> <p>D、对于已申报成功回售登记的含投资人回售权的债券（法律法规另有规定的除外），在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价。在选择债券回售时或回售期内，由于债</p>



最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

④首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值。

⑤对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，采用估值技术确定的公允价值进行估值。

⑥在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。

⑦对在银行间市场上交易的资产支持证券，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。对在银行间市场上交易且第三方估值机构未提供价格的，采用估值技术确定的公允价值进行估值。对在交易所上市的资产支持证券品种，采用估值技术确定的公允价值进行估值。

⑧中小企业私募债采用估值技术确定的公允价值进行估值。

⑨同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，采用估值技术确定公允价值。

⑩持有的银行存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，管理人应及时通知托管人，双方及时进行账务调整。

⑪持有的债券逆回购（正回购）以本金列示，按约定利率逐日确认利息收入（利息支出）。

#### （2）投资证券投资基金的估值方法

①持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公

券发行人信用风险显著增加或发生其他可能导致债券回售失败的突发、异常情形，按管理人、托管人协商一致的方法处理估值相关事宜。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

②首次公开发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。

#### ③全国银行间市场的有价证券的估值

A、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。

B、对于已申报成功回售登记的含投资人回售权的债券（法律法规另有规定的除外），在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价。在选择债券回售时或回售期内，由于债券发行人信用风险显著增加或发生其他可能导致债券回售失败的突发、异常情形，按管理人、托管人协商一致的方法处理估值相关事宜。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

C、对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，应采用估值技术确定公允价值。管理人持续评估该估值方式的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

D、原则上，第三方估值机构选取中债金融估值中心有限公司。

④同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

⑤持有的银行存款或通知存款以本金列

允价值进行估值；

②持有的场外基金（包括保管在场外的上市开放式基金（LOF））以估值日前一工作日基金单位净值估值，估值日前一工作日开放式基金单位净值未公布的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以此前最近一个工作日基金净值计算。尚未公布过基金单位净值的，采用估值技术确定公允价值。

③持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计算。

（3）国债期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近一日的当日结算价计算。

（4）其他资产的估值方法：按照管理人和托管人协商后的方法进行，同时应符合监管机构的相关要求。

（5）如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

#### 5、估值程序：

集合计划资产的日常估值由管理人进行，托管人复核。资产管理人应于估值日交易结束后计算当日的资产净值并以电话或邮件等双方认可的方式与资产托管人核对。管理人每周第一个工作日将上一个工作日集合计划单位净值以传真或以其他双方认可的方式发送给托管人进行复核，托管人复核无误后，签章并发回给管理人，由管理人负责在其网站上进行披露。月末和年末估值复核与会计账目的核对同时进行。

当管理人与托管人的估值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值结果为准。由此产生的后果，托管人予以免责。

#### 6、估值错误与遗漏的处理方式：

（1）估值错误与遗漏：本集合计划单位净值及累计单位净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。管理人和托管人必须采取必要、适

示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，管理人应及时通知托管人，双方及时进行账务调整。

⑥持有的债券逆回购（正回购）以本金列示，按约定利率逐日确认利息收入（利息支出）。

#### （2）投资资产管理产品的估值方法

①持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

②持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；尚未公布过基金份额净值的，采用估值技术确定公允价值。

③持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计算。

④持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按成本价估值。

（3）国债期货以估值日交易所的当日结算价估值，该日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近一日的当日结算价计算。

（4）其他资产的估值方法：按照管理人和托管人协商后的方法进行，同时应符合国家有关规定。

（5）如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。本集合计划应按照法律法规、监管部门或自律组织出具的相关规定进行减值计提。

当有充足证据表明按上述规定不能真实公允反映集合计划相关资产价值的，管

当、合理的措施确保资产估值的准确性、及时性，当集合计划资产的估值导致集合计划单位净值小数点后四位内发生错误时，视为资产估值错误。

(2) 处理方式：当集合计划单位净值出现错误时，管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。因计划单位净值发生估值差错造成集合计划投资者和集合计划损失的，由管理人负责先行赔偿，赔偿原则如下：赔偿仅限于因差错而导致的投资者的直接损失；管理人代表本集合计划保留要求相关当事人返还不当得利的权利；管理人在赔偿后，有权向有关责任方追偿；如果管理人计算的计划单位资产净值错误，且已由托管人复核确认后披露的，由此给计划或计划投资者造成的损失，就实际支付的赔偿金额，管理人和托管人按照各方的过错程度各自承担相应责任。如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

#### 7、估值调整的情形与处理

管理人应当定期对集合计划估值执行效果进行评估，如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，必要时调整完善，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

#### 8、暂停估值的情形：

当出现下列情形致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。

(1) 集合计划投资所涉及的证券交易所遇到法定节假日或其他原因暂停营业时；

(2) 因不可抗力或其他原因致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

(3) 中国证监会认定的其他情形。

#### 9、集合计划份额净值的确认

理人可根据具体情况，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

#### 5、估值程序：

集合计划资产的日常估值由管理人进行，托管人复核。管理人应于估值日交易结束后计算当日的资产净值并以电话或邮件等双方认可的方式与资产托管人核对。月末和年末估值复核与会计账目的核对同时进行。

当管理人与托管人就估值方法和估值数据无法达成一致的，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值方法和估值数据为准。

#### 6、估值错误与遗漏的处理方式：

(1) 估值错误：本集合计划单位净值计算结果，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。当集合计划资产的估值导致集合计划单位净值小数点后四位内发生错误时，视为资产估值错误。国家另有规定的，从其规定。

#### (2) 处理方式：

管理人和托管人采取必要、适当、合理的措施保证集合计划资产估值的准确性和及时性。当集合计划份额净值出现错误时，管理人、托管人立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

因集合计划估值错误给投资者和集合计划财产造成的损失，由管理人和托管人根据各自过错情况承担赔偿责任，管理人和托管人没有过错的不负赔偿责任，赔偿责任由过错方承担。

法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护集合计划持有人利益的原则进行协商确定处理原则。

#### 7、估值调整的情形与处理

管理人应当定期对集合计划估值执行效果进行评估，必要时调整完善，保证本计划估值的公平、合理。当有充足证据表明本计划相关资产的计量方法已不能真实公允反映其价值时，管理人与托管人进

<p>(1) 资产总值：集合计划资产总值是指用集合计划的资金进行的各类投资、购买的各种有价证券、银行存款本息、集合计划应收款项及其他投资等所形成的价值总和。</p> <p>(2) 资产净值：集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。</p> <p>(3) 份额净值：即集合计划份额的单位净值，是指集合计划资产净值除以总份额数。集合计划的累计单位净值指本集合计划单位净值加上单位累计分红。本集合计划单位净值及累计单位净值的计算，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。</p> <p>用于信息披露的集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人复核，托管人复核无误后，由管理人负责在其网站上进行披露。</p> <p>10、特殊情况的处理</p> <p>由于证券交易所或者份额登记机构发送错误数据，或其他不可抗力的原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能正确进行估值，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人不承担责任，但管理人和托管人应当采取积极措施减轻或消除由此造成的影响。估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。</p>	<p>行协商后，可采用公允价值计量方法对计划资产净值进行调整。</p> <p>8、暂停估值的情形：</p> <p>当出现下列情形致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。</p> <p>(1) 集合计划投资所涉及的证券交易所遇到法定节假日或其他原因暂停营业时；</p> <p>(2) 因不可抗力或其他原因致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；</p> <p>(3) 占集合计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值的情形。</p> <p>(4) 集合计划的管理人和托管人对集合计划估值结果核对不一致时；</p> <p>(5) 中国证监会认定的其他情形。</p> <p>9、集合计划份额净值的确认</p> <p>集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人复核。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对计划财产份额净值的计算结果为准。</p> <p>本集合计划单位净值及累计单位净值的计算结果，保留到小数点后4位，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。</p> <p>10、特殊情况的处理</p> <p>由于不可抗力原因，或由于证券交易所、证券登记结算机构或证券经纪商发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误或即使发现了错误但因前述原因无法纠正的，由此造成的集合计划财产估值错误，管理人和托管人免除赔偿责任，但管理人和托管人应当采取积极措施减轻或消除由此造成的影响。</p>
<p>二十、资产管理计划的费用与税收</p> <p>(一) 本集合计划的各项费用</p> <p>1、认购/参与费：0；</p> <p>2、退出费：0；</p>	<p>二十一、资产管理计划的费用与税收</p> <p>(一) 本集合计划的各项费用</p> <p>1、认购/参与费；</p> <p>2、退出费；</p>

- 3、管理费：0.4%/年；
- 4、托管费：0.02%/年；
- 5、业绩报酬：详见本章的相关约定；
- 6、其他费用：详见本章的相关约定。

## （二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

### 1、托管费

本集合计划的年托管费率为 0.02%，每日托管费计算方法如下：

$$T = E \times 0.02\% \div 365;$$

T 为每日托管费；

E 为前一日的集合计划资产净值（成立日按当日总份额计提）。

本集合计划托管费自计划成立之日起，每日计提，逐日累计，按季支付。经管理人和托管人核对后，于每自然季末月的 20 日后 5 个工作日内由托管人根据管理人划款指令从本集合计划资产中支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。若集合计划现金形式资产不足以支付的，则顺延至下一个工作日支付，以此类推。

### 2、管理费

本集合计划的年管理费率为 0.4%，每日管理费计算方法如下：

$$T = E \times 0.4\% \div 365;$$

T 为每日管理费；

E 为前一日的集合计划资产净值（成立日按当日总份额计提）。

本集合计划管理费自计划成立之日起，每日计提，逐日累计，按季支付。经管理人和托管人核对后，于每自然季末月的 20 日后 5 个工作日内由托管人根据管理人划款指令从本集合计划资产中支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。若集合计划现金形式资产不足以支付的，则顺延至下一个工作日支付，以此类推。

管理人和托管人可以协商调减管理费和托管费，并在新的费率开始实施前 3 个工作日在管理人指定网站公告。

3、证券交易费用：本集合计划应按规定比例支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金、结算

- 3、固定管理费；
- 4、托管费；
- 5、业绩报酬；
- 6、证券交易费用；
- 7、集合计划份额登记费用；
- 8、法律行为相关费用；
- 9、其他费用。

## （二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

### 1、托管费

本集合计划的年托管费率为 0.02%，每日托管费计算方法如下：

$$T = E \times 0.02\% \div 365;$$

T 为每日托管费；

E 为前一日的集合计划资产净值（成立日按当日总份额计提）。

本集合计划托管费自计划成立之日起，每日计提，逐日累计，按自然季度支付。经管理人和托管人核对后，于每自然季度首月的前 5 个工作日内由托管人根据管理人指令或授权文件从本集合计划资产中支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。若集合计划现金形式资产不足以支付的，则顺延至下一个工作日支付，以此类推。本计划终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付托管人尚未收取的托管费。

投资者同意，管理人可与托管人协商一致调整托管费支付频率和支付时间，并在管理人官网公告。

### 2、固定管理费

本集合计划的固定年管理费率为 0.6%，每日固定管理费计算方法如下：

$$T = E \times 0.6\% \div 365;$$

T 为每日固定管理费；

E 为前一日的集合计划资产净值（成立日按当日总份额计提）。

本集合计划固定管理费自计划成立之日起，每日计提，逐日累计，按自然季度支付。经管理人和托管人核对后，于每自然季度首月的前 5 个工作日内由托管人根据管理人指令或授权文件从本集合计划资产中支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。若集合计划现

费、开放式基金的认（申）购和赎回费等费用，作为交易成本直接扣除。

本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已扣除风险金），其费率由管理人根据有关政策法规确定。佣金支付频率由管理人与经纪商协商确定，具体划款时间和金额以管理人划款指令为准。

#### 4、与本集合计划相关的审计费

在存续期间发生的集合计划审计费用，在合理期间内摊销计入集合计划。

5、集合计划份额登记费用：集合计划份额登记机构收取的相关费用，包括存续期参与、退出、转换、权益分派登记结算费、服务月费等。份额登记费用由集合计划财产承担，发生时按费用实际支出金额支付。

6、其他费用：集合计划成立后的信息披露费用、会计师费、诉讼或仲裁费（含律师费、评估费、执行费等相关费用）、银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费集合计划运营过程中发生的相关费用。

银行结算费用，在每个费用支付日一次计入集合计划费用；

银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间一次性计入费用；

开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；

与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，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，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。

上述计划费用中第3至6项费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付。

以上所列费用管理人以固有财产先行垫付的，有权从本集合计划资产中优先受偿。

.....

金形式资产不足以支付的，则顺延至下一个工作日支付，以此类推。本计划终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付管理人尚未收取的固定管理费。投资者同意，管理人可与托管人协商一致调整固定管理费支付频率和支付时间，并在管理人官网公告。

### 3、业绩报酬

#### （1）业绩报酬的计提原则

1) 本集合计划的业绩报酬计提基准日为集合计划投资者退出申请日、分红权益登记日或集合计划终止日（含提前终止日）。其中，在投资者退出申请日计提的，仅对投资者退出的份额计提业绩报酬。

2) 按投资者每笔认购/参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

3) 本集合计划仅在符合本款第（2）点所述条件时收取业绩报酬。

4) 若业绩报酬计提基准日为本集合计划的分红权益登记日，业绩报酬从分红金额中扣除，当分红金额不足以扣除业绩报酬时，以分红金额为限进行扣除；若业绩报酬计提基准日为投资者退出申请日或集合计划终止日的，业绩报酬在投资者退出资金或清算分配资金中扣除。

5) 从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次。

#### （2）业绩报酬计提方法

当投资者申请退出本集合计划，或本集合计划分红、终止清算时，管理人根据以下条款计算并计提业绩报酬。

每笔集合计划份额以上一业绩报酬核算日（业绩报酬核算日指：业绩报酬计提基准调整日或业绩报酬计提基准日）到本次业绩报酬核算日的年化收益率，作为计提业绩报酬的依据，如核算期间年化收益率大于业绩报酬计提基准，管理人对超出业绩报酬计提基准额持有期差额收益按一定比例计算业绩报酬。若投资者持有计划份额期间，发生业绩报酬计提基准调整，则该笔份额存在多个业绩报酬核算期，需分别计算调整前后不同核算期间的产品年化收益率，并加总计算管理人业绩报酬。

**(四) 业绩报酬**

**1、业绩报酬的计提原则**

(1) 本集合计划的业绩报酬计提基准日为集合计划投资者退出申请日、分红权益登记日或集合计划终止日(含提前终止日)。若业绩报酬计提基准日为集合计划退出申请日或分红权益登记日,则业绩报酬计提日为基准日下一个工作日;若业绩报酬计提基准日为集合计划终止日,则业绩报酬计提日以管理人清算方案为准。

(2) 按投资者每笔认购/参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

(3) 本集合计划仅在符合本款第2点所述条件时收取业绩报酬。

(4) 若业绩报酬计提基准日为本集合计划的分红权益登记日,业绩报酬从分红金额中扣除,当分红金额不足以扣除业绩报酬时,以分红金额为限进行扣除;若业绩报酬计提基准日为投资者退出申请日或集合计划终止日的,业绩报酬在投资者退出资金或清算分配资金中扣除。

(5) 业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次,因投资者退出或本集合计划终止的,不受前述提取频率的限制。

**2、业绩报酬计提方法**

在业绩报酬计提日,集合计划投资者所持每笔份额在每个运作周期内的年化收益率大于该运作周期的业绩报酬计提基准时,管理人计算应收取业绩报酬的每笔集合计划份额在每个运作周期的年化收益率(R),对超出业绩报酬计提基准的持有期差额收益按【60%】比例计提为业绩报酬。

每笔集合计划份额每个运作周期内持有期间的年化收益率R计算如下:

$$R = \frac{A-B}{B'} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

A为该笔份额在本业绩报酬计提基准日的累计单位净值;

B为该笔份额上一个业绩报酬计提基准日的累计单位净值(若上一个业绩报酬计提基准日不存在,初始募集期参与的

每笔集合计划份额业绩报酬核算期内持有期间的年化收益率R计算如下:

$$R = \frac{A-B}{B'} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

A为该笔份额在本次业绩报酬核算日的累计单位净值;

B为该笔份额上一个业绩报酬核算日的累计单位净值(若上一个业绩报酬核算日不存在,初始募集期参与的为本集合计划成立日,存续期参与的为参与申请日);

B'为该笔份额上一个业绩报酬核算日的单位净值(若上一个业绩报酬核算日不存在,初始募集期参与的为本集合计划成立日,存续期参与的为参与申请日);

T表示该笔份额在每个业绩报酬核算期内的持有期天数;

管理人按照如下标准和方法计算每个业绩报酬核算期间的管理人业绩报酬:

R	提取比例	业绩报酬H的计算方式
$R \leq r_{i1}$	0%	$H=0$
$r_{i1} < R \leq r_{i2}$	$P_{i1}$	$H = M \times (R - r_{i1}) \times \frac{T}{365} \times P_{i1}$
$R > r_{i2}$	$P_{i2}$	$H = M \times (R - r_{i2}) \times \frac{T}{365} \times P_{i2} + M \times (r_{i2} - r_{i1}) \times \frac{T}{365} \times P_{i1}$

本集合计划第i个运作周期业绩报酬计提基准 $r_{i1}$ 、 $r_{i2}$ 和提取比例 $P_{i1}$ 、 $P_{i2}$ 会在该运作周期开始的开放日前在管理人网站公布,每个业绩报酬核算期间各运作周期计提基准和提取比例均保持一致。 $P_{i1}$ 和 $P_{i2}$ 不得超过60%。

其中:

H为该笔份额在本次业绩报酬核算期间应计提的业绩报酬

M=该笔份额数×该笔份额上一个业绩报酬核算日的单位净值(若上一个业绩报酬核算日不存在,初始募集期参与的为



为本集合计划成立日，存续期参与的为参与申请日）；

B' 为该笔份额上一个业绩报酬计提基准日的单位净值（若上一个业绩报酬计提基准日不存在，初始募集期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与申请日）；

T 表示该笔份额在每个运作周期的持有期天数；

本集合计划每个运作周期的业绩报酬计提基准会有所不同，第 i 个运作周期业绩报酬计提基准（ $r_i$ ）会在该运作周期开始的开放日前在管理人网站公布。其中，第 1 个运作周期的业绩报酬计提基准（ $r_1$ ）会以募集公告的形式在管理人网站公布。当  $R > r_i$  时，管理人计提 R 大于  $r_i$  的剩余收益部分的 60% 作为业绩报酬；当  $R \leq r_i$  时，管理人不计提业绩报酬。

$$H = M \times (R - r_i) \times \frac{T}{365} \times 60\%$$

其中：

H 为该笔份额在本次业绩报酬计提日应计提的业绩报酬

M=该笔份额数×该笔份额上一个业绩报酬计提基准日的单位净值（若上一个业绩报酬计提基准日不存在，初始募集期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与申请日）；

T 表示该笔份额在每个运作周期的持有期天数；

已计提的业绩报酬无回拨机制。业绩报酬的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入集合计划资产。

### 3、业绩报酬的提取程序

业绩报酬在集合计划业绩报酬计提日计提，由管理人负责计算，托管人不负责复核，根据管理人提供的数据进行账务处理。

业绩报酬的提取频率不得超过每 6 个月一次，因委托人退出本集合计划，不受前述提取频率的限制。由管理人向托管

本集合计划成立日，存续期参与的为参与申请日）；

T 表示该笔份额在每个业绩报酬核算期内的持有期天数；

业绩报酬计提基准的调整周期不得短于两次开放期的间隔时间。

已计提的业绩报酬无回拨机制。业绩报酬的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入集合计划资产。

### （3）业绩报酬的提取程序

业绩报酬在集合计划业绩报酬计提日计提，因涉及份额登记数据，由管理人负责计算并以管理人的计算结果为准。

由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据划付指令从集合计划资产中将计提的业绩报酬一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

4、证券交易费用：本集合计划应按规定比例支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金、结算费、开放式基金的认（申）购和赎回费等费用，作为交易成本直接扣除。

本集合计划向所租用交易单元（如有）的券商支付佣金（该佣金已扣除风险金），其费率由管理人根据有关政策法规确定。佣金支付频率由管理人与经纪商协商确定，具体划款时间和金额以管理人划款指令为准。

5、集合计划份额登记费用：集合计划份额登记机构收取的相关费用，包括存续期参与、退出、转换、权益分派登记结算费、服务月费等。份额登记费用由集合计划财产承担，发生时按费用实际支出金额支付。

6、法律行为相关费用：在存续期间，管理人代表投资者利益行使诉讼权利、采取违约处置措施或者实施其他法律行为发生的各项费用，包括但不限于诉讼费（仲裁费）、律师费（含律师差旅费）、评估费、保全费、拍卖费、执行费、管理人代表集合计划行使投资过程中产生的权属登记等权利产生的相关费用等，由



人发送业绩报酬划付指令，托管人根据划付指令从集合计划资产中将计提的业绩报酬一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

集合计划承担。

7、其他费用：按照法律、行政法规的规定及本合同的约定可以在本集合计划财产中列支的其他费用，包括但不限于集合计划成立后的信息披露费用、会计师费、审计费、银行结算费用、开户费、银行间市场账户维护费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费集合计划运营过程中发生的相关费用。

与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，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，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。

上述计划费用中第4至7项费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付。

以上所列费用如需管理人以固有财产先行垫付的，管理人有权从本集合计划资产中优先受偿，投资者不以任何方式要求管理人向其返还或补偿该等费用。

.....

#### **（四）费率的调整**

投资者同意管理人和托管人可以协商调减管理费和托管费，无需履行合同变更程序，并在新的费率开始实施前在管理人指定网站公告。

### **二十一、资产管理计划的收益分配**

本集合计划收益分配方案依据现行法律法规以及本合同约定执行。

#### **（一）收益的构成**

本集合计划收益指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。集合计划已实现收益指集合计划收益减去公允价值变动收益后的余额。

本集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### **（二）收益分配原则**

- 1、每份集合计划份额享有同等收益分配权；
- 2、收益分配基准日的份额净值减去每

### **二十二、资产管理计划的收益分配**

本集合计划收益分配方案依据现行法律法规以及本合同约定执行。

#### **（一）收益的构成**

本集合计划收益指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。

本集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日（即可供分配利润计算截止日）集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

#### **（二）收益分配原则**

- 1、每份集合计划份额享有同等收益分配权（因管理人业绩报酬的存在，每份额集合计划实际得到的分红金额可能有所不同）；
- 2、收益分配基准日的份额净值减去每单

<p>单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>3、收益分配对象为分红权益登记日所有持有集合计划份额的投资者。</p> <p>4、在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，本集合计划在每个固定开放期进行收益分配，分配比例为100%。</p> <p>5、收益分配基准、收益分配比例、分配时间由管理人根据计划运作情况决定，并在管理人网站上公告。</p> <p>6、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担；</p> <p>7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p> <p>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原则进行调整，并在管理人网站上公告。</p> <p>（三）收益分配方案的确定与通知 本集合计划收益分配方案由管理人拟定，托管人复核后确定，并在管理人网站公告。收益分配方案应包括本集合计划收益分配的分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</p> <p>（四）收益分配的执行方式 本集合计划的分红方式为现金分红，现金分红保留到小数点后两位，由小数点保留所产生的尾差由集合计划承担。</p>	<p>位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>3、收益分配对象为分红权益登记日所有持有集合计划份额的投资者。</p> <p>4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担；</p> <p>在符合上述原则和具备收益分配条件的前提下，本集合计划的收益分配基准、收益分配比例、分配时间、次数由管理人根据计划运作情况决定，并在管理人网站上公告。</p> <p>法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p> <p>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原则进行调整，并在管理人网站上公告。</p> <p>（三）收益分配方案的确定与通知 本集合计划收益分配方案由管理人拟定，托管人复核后确定，并在管理人网站公告。</p> <p>（四）收益分配的执行方式 本集合计划的分红方式原则上为现金分红，现金分红保留到小数点后两位，由小数点保留所产生的尾差由集合计划承担。</p> <p>管理人就支付的红利款项向托管人发送划款指令，托管人按照管理人的指令及时进行划付。</p> <p>投资者和托管人同意，管理人有权选择采用现金分红或者红利再投资方式进行分红，如本集合计划增加采用红利再投资方式，由管理人在管理人网站公告即可，无需履行合同变更程序。</p>
<p><b>二十二、信息披露与报告</b></p> <p><b>（二）临时报告</b></p> <p>集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起五日内以管理人公告（<a href="http://www.cfzq.com">www.cfzq.com</a>）或电子邮件的方式向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>1、集合计划运作过程中，负责集合资</p>	<p><b>二十三、信息披露与报告</b></p> <p><b>（二）临时报告</b></p> <p>集合计划存续期间，发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，管理人应当在事项发生之日起五日内以管理人公告（<a href="http://zg.stock.hnchasing.com">zg.stock.hnchasing.com</a>）或电子邮件等方式向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>1、投资经理发生变更；</p>

<p>产管理业务的投资经理发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；</p> <p>2、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>3、发生巨额退出并延期支付；</p> <p>4、集合计划终止和清算；</p> <p>5、集合计划存续期满并展期；</p> <p>6、合同的补充、修改与变更；</p> <p>7、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>8、负责本集合计划的销售机构发生变更；</p> <p>9、集合计划投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易；</p> <p>10、管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划的；</p> <p>11、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>12、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>13、管理人或托管人变更；</p> <p>14、资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；</p> <p>15、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；</p> <p>16、其他发生对集合计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件；</p> <p>17、管理人认为需要公告的其他事项。</p>	<p>2、以资产管理计划资产从事重大关联交易的；</p> <p>3、涉及产品重大诉讼、仲裁、财产纠纷的，以及出现延期兑付、负面舆论、群体性事件等重大风险事件的；</p> <p>4、资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延长清算时间的；</p> <p>5、发生其他对持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响事件的。</p> <p>6、管理人认为需要公告的其他事项。</p> <p><b>（三）管理人自有资金的认购/参与和退出应当按照法律法规相关规定及本合同约定及时告知全体投资者和托管行。</b></p> <p><b>（四）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的，应向投资者充分披露。</b></p>
<p><b>二十三、风险揭示</b></p> <p>本集合计划面临包括但不限于以下风险：</p> <p><b>（一）资产管理计划面临的一般风险</b></p> <p>8、关联交易风险</p> <p>本计划可能将集合计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方（关联方按</p>	<p><b>二十四、风险揭示</b></p> <p>本集合计划面临包括但不限于以下风险：</p> <p><b>（一）资产管理计划面临的一般风险</b></p> <p>8、关联交易风险</p> <p><b>（1）重大关联交易风险</b></p> <p>本计划进行重大关联交易时，管理人应遵守法律法规、监管规定、行业自律组织</p>

照《企业会计准则》的规定确定)公司发行或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易。虽然本资产管理计划的相关行为全部基于市场公平行为,资产管理人将在管理人已知的范围内确保交易价格公允并竭力避免非公平交易,但是依然不能避免未来可能发生的关联交易风险。

### (二) 资产管理计划面临的特定风险

#### 2、资产管理计划份额转让所涉风险

本集合计划成立后,管理人有权决定本集合计划份额在证券交易所以及中国证监会认可的其他方式开展转让交易,可能存在投资者通过交易平台转让份额的价格和集合计划份额净值不一致的风险。

#### 3、资产管理计划未在中国证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

若因政策变动或者相关监管机构认为本集合计划约定不适当而导致未在中国证券投资基金业协会完成备案、不予备案或者备案通过后被监管机构叫停的,管理人有权在不影响投资者实质性利益的前提下和托管人协商一致修改本集合合同条款或者提前终止本集合计划,提请投资者注意此风险。

### (三) 其他风险

#### 1、集合计划提前终止的风险

集合计划运作期间,当本集合计划单位净值低于0.8000,或发生本合同约定的提前终止情形,本集合计划有提前终止的风险。

#### 2、投资者可能无法参与的风险

由于管理人有权设定每一运作周期的规模上限,管理人将根据合同的约定对份额的规模上限进行控制,因此投资者可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

#### 3、强制退出风险

本集合计划的单笔退出最低份额为1,000份,若某笔退出导致该投资者在某一销售机构处持有的计划份额净值低于300,000元,则管理人对该余额部分

要求、合同约定及管理人相关内控制度,保护投资者的合法权益,但投资者仍有可能面临重大关联交易存在相关投资风险等情况,导致投资者利益受到损害的风险。

投资者应充分知悉本合同条款关于重大关联交易的各项机制安排和所涉风险,关注管理人相关公告并及时做出相应安排。

#### (2) 一般关联交易风险

根据本合同约定:“投资者、托管人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产从事一般关联交易。”管理人虽会采取措施防范利益冲突,保护投资者的合法权益,但投资者仍有可能面临一般关联交易存在相关投资风险、无法事前知悉每笔一般关联交易等情况,导致投资者利益受到损害的风险。

### (二) 资产管理计划面临的特定风险

#### 2、资产管理计划份额转让所涉风险

本集合计划成立后,在具备可交易条件时,经管理人同意后,投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式,向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额,可能存在投资者通过交易平台转让份额的价格和集合计划份额净值不一致的风险。

#### 3、资产管理计划未在中国证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

若因政策变动或者相关监管机构、自律组织认为本集合计划约定不适当而导致未在中国证券投资基金业协会完成备案、不予备案或者应监管或自律组织要求及时整改规范的,管理人有权在不影响投资者实质性利益的前提下和托管人协商一致修改本集合合同条款或者提前终止本集合计划,并及时告知投资者,提请投资者注意此风险。

#### 4、资产管理计划在中国证券投资基金业协会备案过程中进行合同变更的风险

若因政策变动或者相关监管机构认为本集合计划约定不适当,管理人应监管或自律组织要求及时整改规范而需要变更

做强制退出处理，强制退出会导致投资者的份额减少至零。

#### 4、默认处理的风险

在本集合计划合同变更或展期安排中，可能存在但不限于以下潜在风险：

合同中约定投资者不同意集合计划合同变更或展期安排的，需在规定期限内按照管理人公告规定的形式回复意见。在此情况下，存在投资者对默认情况的忽略或误解的风险。

部分投资者可能因为未能及时关注管理人网站公告，而无法及时获知合同变更事项或展期安排，或者投资者未能及时在公告发出后按照公告中规定的方式回复意见，在上述情况下，如果投资者没有能够提出明确意见，可能被视为同意集合计划合同变更或展期安排，提请投资者注意此潜在风险。

.....

#### 8、使用电子签名合同的风险

如本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署的，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。

#### 9、证券交易资金额度前端控制风险

为防范交易参与人、结算参与人因技术故障、操作失误等造成的交易异常风险和结算风险，维护交易结算秩序，保障证券市场安全稳定运行，上海证券交易所、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司共同制定了《上海证券交易所深圳证券交易所中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》，对管理人相关业务交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，当管理人的相关业务交易单元全天净买入申报金额超过管理人的自设额度和最高额度，存在资产管理计划申报的，实行竞价交易且净额担保结算的交易品种无法成交，进而可能影响资产管理计划的投资机会和收益水平的风险。

#### 10、管理人、托管人因停业、解散、撤

合同，且该变更影响投资者实质利益的，管理人将在与托管人协商一致并征询投资者意见后进行合同变更，并及时告知投资者，提请投资者注意此风险。

### （三）其他风险

#### 1、集合计划提前终止的风险

集合计划运作期间，发生本合同约定的提前终止情形时，本集合计划有提前终止的风险。①如本集合计划单位净值低于0.8000，管理人依据本合同约定提前终止本集合计划，管理人在变现过程中有权对持有的非现金资产进行连续不可逆的变现操作，根据管理人变现操作的交易执行情况，本计划最终清算后的单位净值可能低于0.8000。②提请投资者特别注意，如果本集合计划存续期间总份额低于1000万、某开放日确认投资者参与、退出申请后将导致集合计划总份额低于1000万或仅剩余管理人自有资金（含子公司、孙公司），管理人有权提前终止本集合计划。③如果某开放日确认投资者参与、退出申请后将导致剩余投资者少于二人，管理人有权提前终止本集合计划。若发生合同约定的提前终止情形，投资者（特别是新参与的投资者）将面临本集合计划短期内终止且资产管理计划财产进入清算程序，导致投资者参与财产难以及时退出、财产本金和收益发生损失的风险。

#### 2、投资者可能无法参与、及时退出的风险

①由于管理人有权设定每一运作周期的规模上限，管理人将根据合同的约定对份额的规模上限和人数上限进行控制，因此投资者可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

②如出现本合同约定的拒绝或暂停集合计划投资者的参与、退出申请的情况，届时投资者可能存在无法及时参与本集合计划或难以及时退出参与财产的风险，甚至导致财产本金、收益发生损失。

#### 3、强制退出风险

本集合计划的单笔退出最低份额为1,000份，若某笔退出导致该投资者持有

销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险  
管理人、托管人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

的计划份额资产净值低于 300,000 元，则管理人对该余额部分做强制退出处理，强制退出会导致投资者的份额减少至零。

投资者申请在临时开放期退出本集合计划的，应当选择一次性全部退出，不允许部分退出。若投资者申请部分退出的，管理人有权对投资者的全部份额做强制退出处理，强制退出会导致投资者的份额减少至零。管理人在符合监管规定及不损害投资者权益的情况下可更改上述退出原则。

#### 4、默认处理的风险

在本集合计划合同变更、展期安排、管理人及其子公司(孙公司)自有资金存续期参与、退出或集合计划从事重大关联交易中，可能存在但不限于以下潜在风险：合同中约定投资者不同意集合计划合同变更、展期安排、管理人及其子公司(孙公司)自有资金存续期参与、退出或集合计划从事重大关联交易的，需在规定期限内按照管理人公告要求回复意见或退出本集合计划。在此情况下，存在投资者对默认情况的忽略或误解的风险。

部分投资者可能因为未能及时关注管理人网站公告，而无法及时获知合同变更事项、展期安排、管理人及其子公司(孙公司)自有资金存续期参与、退出或集合计划从事重大关联交易，或者投资者未能及时在公告发出后在规定期限内提出明确意见或退出本集合计划，则投资者可能被视为同意集合计划合同变更、展期安排、管理人及其子公司(孙公司)自有资金存续期参与、退出或集合计划从事重大关联交易，提请投资者注意此潜在风险。

.....

#### 8、业绩报酬计提基准未能达到的风险

本合同“业绩报酬计提基准”仅是管理人计提业绩报酬的基准，也是管理人在运作内投资管理努力的方向和目标。业绩报酬计提基准不是预期收益和保证收益率，不构成管理人对受托财产的任何承诺或担保，投资者仍可能面临实际收益

率达不到业绩报酬计提基准甚至本金受损的风险。

#### 9、使用电子签名合同的风险

如本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署的，投资者应积极采取安全措施、妥善保管密码，经投资者密码等有效身份验证登录投资者账户后的所有操作视同投资者本人行为，投资者需承担由此产生的一切法律后果。

此外，由于使用电子签名，在集合计划的交易过程当中，可能存在以下风险：

（1）由于互联网和移动通讯网络数据传输等原因，交易指令可能会出现中断、停顿、延迟、数据错误等情况；

（2）投资者账号及密码信息泄露或客户身份可能被仿冒；

（3）由于互联网和移动通讯网络上存在黑客恶意攻击的可能性，网络服务器可能会出现故障及其他不可预测的因素，交易信息可能会出现错误或延迟；

（4）投资者的网络终端设备及软件系统可能会受到非法攻击或病毒感染，导致电子签名合同数据无法传输或传输失败。

#### 10、证券交易资金额度前端控制风险

本资产管理计划由管理人作为交易参与人通过交易单元在上海和深圳证券交易所进行证券交易。根据《证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，证券交易所、证券登记机构对交易参与人相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过交易所对交易参与人实施前端控制。可能存在如下风险：

（1）当管理人的相关业务交易单元全天净买入申报金额超过管理人的自设额度和最高额度，存在资产管理计划申报的，实行竞价交易且净额担保结算的交易品种无法成交，进而可能影响资产管理计划的投资机会和收益水平的风险。

（2）管理人操作失误，合计资产总额发生变动导致最高额度未能及时变更等，存在影响产品正常交易、无法有效进行风险控制等风险。

（3）因不可抗力、意外事件、技术故障

	<p>或者重大差错等原因导致资金前端控制出现异常，中国结算及沪、深交易所采取最高额度调整、暂停资金前端控制、限制交易单元接入等处置措施，产生业务风险。</p> <p>本资产管理计划可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易，由此造成的损益由计划财产承担。</p> <p>11、管理人、托管人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险</p> <p>管理人、托管人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。</p> <p>12、个人信息（含敏感个人信息）泄露、篡改、丢失的风险</p> <p>本资产管理计划在运作过程中，可能需要针对个人信息进行必要的收集、存储、传递、分析、利用、处理，可能存在由于物理、技术或管理防护设施遭到破坏、信息技术系统故障等原因，导致个人信息被非法授权访问、泄露、篡改或损毁、丢失的风险。</p> <p>敏感个人信息是指一旦泄露或者非法使用，容易导致自然人的人格尊严受到侵害或者人身、财产安全受到危害的个人信息，包括生物识别、宗教信仰、特定身份、医疗健康、金融账户、行踪轨迹等信息，以及不满十四周岁未成年人的个人信息。相比其他个人信息，敏感个人信息可能对投资者的个人权益影响更大：敏感个人信息的泄露或者非法使用容易导致个人的人身安全受到危害；其不当处理将容易导致个人财产遭受他人侵害，使得个人的财产安全面临威胁；敏感个人信息与个人的人格尊严高度相关。对于投资者而言，需在谨慎考虑后再向管理人提供敏感个人信息。</p>
<p><b>二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算</b></p> <p><b>（一）集合计划合同变更的条件和程序</b></p> <p>1、本合同签署后，以下情况可由管理人和托管人协商一致后对本合同作出修</p>	<p><b>二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算</b></p> <p><b>（一）集合计划合同变更的条件和程序</b></p> <p>1、投资者同意，本合同签署后以下情况可由管理人和托管人协商一致后对本合</p>



改：

(1) 因法律法规或中国证监会、中国证券投资基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的；

(2) 本合同的修改对投资者利益无实质性不利影响或修改不涉及本计划当事人权利义务关系；

(3) 管理人与托管人之间指令、清算交收规则的变更；

(4) 按照法律法规或本合同规定，资产管理人有权变更本合同的其他情形。

投资者特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及计划说明书按照上述内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站（www.cfzq.com）公告满5个工作日后生效，无需另行征得投资者同意。投资者对更新或修改的内容有异议，可按照本合同的规定申请退出本集合计划，未申请退出本集合计划的，视为同意，管理人不再另行通知。

本集合计划成立后，相关材料需要报相关监管机构或自律组织等备案。管理人按照监管机构或自律组织等的要求补正备案材料涉及到本合同修改的，投资者特此授权管理人经与托管人协商一致后，由管理人公告补正后的合同，补正的内容在管理人网站公告后生效，具体以管理人公告为准。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以管理人指定网站公告或邮寄等方式向投资者发送合同变更征询意见函。投资者需于征询意见函规定的期间内回复同意或不同意的意见，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

① 投资者不同意变更的，应在征询意见函规定期间内提出不同意的意见或退出本集合计划。

② 投资者未在前述时间回复意见也未退出集合计划的，视为投资者同意合同变更。

同作出修改：

(1) 因法律法规或中国证监会、中国证券投资基金业协会的相关规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订必须变更资产管理合同的；资产管理计划备案过程中，被要求补正备案材料或补正后被要求整改规范且对投资者利益无实质性不利影响，涉及到本合同修改的；

(2) 本合同的修改对投资者利益无实质性不利影响或修改不涉及本计划投资者权利义务关系；

(3) 按照法律法规或本合同规定，资产管理人有权变更本合同的其他情形。

投资者特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及计划说明书按照上述内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站（zg.stock.hnchasing.com）公告后生效，无需另行征得投资者同意。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以管理人指定网站公告或书面等方式向投资者发送合同变更征询意见函。

① 投资者不同意变更的，应在征询意见函规定期间内退出本集合计划。

② 投资者未在规定的期间内回复意见也未退出集合计划的，则投资者已以行为表明其同意公告中载明的全部变更事项。

③ 对于明确答复不同意合同变更但在规定期限内仍未退出本集合计划的投资者，管理人将有权在规定期限届满后将相关份额做强制退出处理（以实际退出日前一工作日集合计划单位净值计算退出金额），由此产生的相关费用及或有损失由投资者自行承担。

投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致后根据本合同规定变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行

③对于明确答复不同意合同变更但在规定期限内仍未退出本集合计划的投资者，管理人将有权在规定期限届满后将相关份额做强制退出处理（退出金额以实际退出日前一工作日集合单位净值为基础进行计算），由此产生的相关费用及或有损失由投资者自行承担。

投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致后根据本合同规定变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

经上述合同变更程序后，合同变更于征询意见期限届满次一工作日起生效，公告内容即成为本合同组成部分。

管理人应在合同变更之日起5个工作日内报中国证券投资基金业协会备案，并抄报管理人住所地中国证监会派出机构。

3、当发生“（1）管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接；（2）托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他托管人承接”情形时，管理人和托管人的更换程序如下：

（1）管理人的更换程序

1) 公告：管理人更换后，由托管人在中国证监会批准后5个工作日内公告。如果托管人和管理人同时更换，由中国证监会指定机构或经其认可的机构进行公告。

2) 交接：原管理人应作出处理集合计划事务的报告，并向新任管理人办理集合计划事务的移交手续；新任管理人应与托管人核对集合计划资产总值和资产净值。

3) 集合计划名称变更及合同修改：管理人更换后，应按其要求替换或删除集合计划名称中原管理人名称的字样，并对合同进行变更。

（2）托管人的更换程序

1) 公告：托管人更换后，由管理人在中国证监会和中国人民银行批准后5个工

为。

经上述合同变更程序后，合同变更于征询意见期限届满次一工作日起生效，公告内容即成为本合同组成部分。

3、管理人应在合同变更之日起5个工作日内报中国证券投资基金业协会备案。

4、当发生“（1）管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接；（2）托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他托管人承接；（3）其他管理人变更或者托管人变更等事项。”情形时，由新管理人或新托管人承接合同相应的权利与义务，并按上述第2项履行合同变更程序，具体以产品公告为准。

<p>作日内公告。如果托管人和管理人同时更换，由中国证监会指定或经其认可的机构进行公告。</p> <p>2) 交接：原托管人应作出处理集合计划事务的报告，并向新任托管人办理集合计划事务的移交手续；新任管理人应与托管人核对集合计划资产总值和资产净值。</p>	
<p><b>二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算</b></p> <p><b>(二) 集合计划的展期</b></p> <p>2、展期的程序与期限</p> <p>(1) 展期的程序：本集合计划原存续期届满前，管理人可以决定到期清算终止或展期继续管理本集合计划。本集合计划拟展期的，管理人应当在指定网站上公告，并同时公告集合计划的具体展期方案。</p> <p>(2) 展期的期限：管理人可以决定展期的期限，应在征得托管人书面同意后，并以公告形式通知投资者，具体期限以管理人公告为准。</p> <p>3、展期的安排</p> <p>(1) 通知展期的时间</p> <p>管理人在获得托管人同意继续托管展期的集合计划资产的意见后在管理人网站进行公告，对集合计划展期事宜进行说明。</p> <p>(2) 通知展期的方式</p> <p>管理人决定展期的，将在管理人网站进行公告。</p> <p>(3) 投资者回复的方式</p> <p>管理人将通过公告对投资者回复的方式做出安排，并通知投资者如不同意参与集合计划展期，应在公告规定期限内按照管理人公告规定的形式作出答复；未在规定时间内作出答复的，视为同意本集合计划展期。</p> <p>4、投资者不同意展期的处理办法</p> <p>投资者不同意集合计划展期的，管理人应当对投资者的退出事宜作出公平、合理的安排，具体办理要求和相关事项以管理人公告为准。</p> <p>5、展期的实现</p>	<p><b>二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算</b></p> <p><b>(二) 集合计划的展期</b></p> <p>2、展期的程序</p> <p>(1) 展期的公告</p> <p>集合计划符合展期条件拟展期时，管理人在管理人指定网站上公告，管理人将同时公告集合计划的具体展期方案。</p> <p>(2) 投资者答复</p> <p>管理人将通过公告对投资者回复的方式做出安排，并通知投资者如不同意参与集合计划展期，应在公告规定期限内按照管理人公告规定的形式作出答复；未在规定时间内作出答复的，则投资者已以行为表明其同意公告中载明的全部展期事项。</p> <p>(3) 投资者不同意展期的处理办法</p> <p>投资者不同意集合计划展期的，管理人应当对投资者的退出事宜作出公平、合理的安排，具体办理要求和相关事项以管理人公告为准。</p> <p>3、展期的实现</p> <p>(1) 原存续期届满日符合展期条件的，且持续符合集合资产管理计划的成立条件的，本集合计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本集合计划到期终止。</p> <p>(2) 本集合计划可以连续展期，且展期次数不限。</p> <p>4、展期的备案</p> <p>管理人应在展期之日起 5 个工作日内将展期情况报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会相关派出机构。</p> <p><b>(三) 集合计划/合同的终止</b></p> <p>有下列情形之一的，集合计划/合同应当</p>

(1) 如果展期后的集合资产管理合同、计划说明书与原集合资产管理合同、计划说明书有变更之处，管理人将在其指定网站上对新的集合资产管理合同、计划说明书进行公告。

(2) 原存续期届满日符合展期条件的，且持续符合集合资产管理计划的成立条件的，本集合计划在原存续期届满日的次日实现展期，否则本集合计划不能展期。

(3) 若本集合计划在原存续期届满日有未能流通变现的资产，同意展期的投资者需同意继续持有该未能流通变现的资产，且同意展期的投资者持有的集合计划资产净值不得低于本集合计划未能流通变现资产规模。

(4) 本集合计划可以连续展期，且展期次数不限。

(5) 管理人应在展期后 5 个工作日内将展期情况报中国证券投资基金业协会或其他机构备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

### (三) 集合计划的终止

1、有下列情形之一的，集合计划应当终止：

(7) 集合计划备案通过后被监管机构叫停的，管理人有权提前终止本集合计划而免除违约责任；

(8) 本集合计划单位净值低于 0.8000 元的；

(9) 如因市场环境的变化，管理人认为须提前终止集合计划的，管理人在征得托管人书面同意后，提前 5 个工作日通过管理人网站公告通知全体投资者后本集合计划可提前终止；

(10) 本计划资产投资品种的交易对手在管理、运用、处分相关财产的过程中，发生违约、担保人违约或投资品种所涉其他法律关系的当事人违约，管理人认为有必要提前终止的；

(11) 因战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；

(12) 发生资产管理合同约定的或法律、行政法规及中国证监会规定的其他应当

终止：

(7) 本集合计划单位净值低于 0.8000 元的；

(8) 如因市场环境的变化，管理人认为须提前终止集合计划的，管理人在征得托管人书面同意后，提前 5 个工作日通过管理人网站公告通知全体投资者后本集合计划可提前终止；

(9) 本计划资产投资品种的交易对手在管理、运用、处分相关财产的过程中，发生违约、担保人违约或投资品种所涉其他法律关系的当事人违约，管理人认为有必要提前终止的；

(10) 因战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；

(11) 本集合计划总份额低于 1000 万时，管理人有权(但并非必须)终止本集合计划；特别的，如某开放日确认投资者参与、退出申请后将导致集合计划总份额低于 1000 万或仅剩余管理人自有资金(含子公司、孙公司)的，管理人有权拒绝当日全部参与、退出申请并终止资管计划、进入清算程序；

(12) 若某开放日确认投资者参与、退出申请后将导致剩余投资者少于二人的，管理人有权拒绝当日全部参与、退出申请并终止资管计划、进入清算程序；

(13) 法律、行政法规及中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。

### (四) 集合计划的清算

2、集合资产管理计划财产清算的程序

(1) 集合计划达到终止条件管理人应通知托管人准备进入清算程序，并成立集合计划清算小组；

(2) 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；

(3) 清算结束后管理人应当按照本条中约定的清偿顺序分配集合计划剩余财产，在扣除清算费用、管理费、托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例，原则上以货币资金的形式全部分配给投资者。

.....

7、清算未尽事宜

<p>终止的情形。</p> <p><b>(四) 集合计划的清算</b></p> <p>2、集合资产管理计划财产清算的程序</p> <p>(1)集合计划达到终止条件管理人应通知托管人准备进入清算程序。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)清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</p> <p>(3)清算结束后5个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者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投资者，并注销集合计划专用证券账户、资金账户等，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>(4)对于由计划交纳、中国证券登记结算有限责任公司收取的最低结算备付金和交易单元保证金，在中国证券登记结算有限责任公司对其进行调整交收日才能收回，届时，集合计划清算小组将及时按照投资者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配给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。</p> <p>(5)清算结束后5个工作日内，管理人应当按照本条中约定的清偿顺序分配集合计划剩余财产。</p> <p>.....</p> <p>7、集合资产管理计划财产清算完毕后，管理人、托管人应按照相应的办理程序完成资产管理计划财产相关账户的注销。管理人应于托管产品到期后及时完成收益兑付、费用结清及其他应收应付款项资金划转，确保后续不再发生款项进出后20个工作日内向托管人发出销户申请。托管人按照规定注销集合资产管理计划财产的托管账户、证券账户和期货账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。</p>	<p>本合同中关于集合计划清算的未尽事宜以清算报告或管理人公告为准。</p> <p>8、集合资产管理计划财产清算完毕后，管理人、托管人应按照相应的办理程序完成资产管理计划财产相关账户的注销。托管人按照规定注销集合资产管理计划财产的托管账户、证券账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。资产管理计划财产清算工作结束，并全部划入指定账户后(含备付金、保证金)，资产管理人应在十个工作日内向资产托管人发出销户申请，由资产托管人尽快完成托管资金账户的销户工作，并将销户结果通知资产管理人。如因本合同相关当事人故意拖延等行为造成销户不及时而出现直接损失或造成相关费用，应当对各自行为承担赔偿责任。</p>
<p><b>二十五、违约责任</b></p> <p>1、管理人、托管人在履行各自职责的过</p>	<p><b>二十六、违约责任</b></p> <p>1、合同当事人在履行各自职责的过程</p>

程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者投资者造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。本合同能够继续履行的应当继续履行。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

(1) 不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、份额登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易或不可预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障等，此外，同行业现有技术水平无法预见或无法避免或无法抗拒的技术原因亦属于不可抗力等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知其他方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划资产及其他当事人损失扩大。任何一方当事人迟延履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

(2) 管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

(3) 管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

(4) 在没有过错的情况下，托管人执行管理人的生效指令对集合计划资产造成的损失；

(5) 在计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

(6) 管理人或托管人任一方不因另一方

中，违反本合同约定的，应当承担违约责任；给合同其他当事人造成损失的，应当承担赔偿责任。本合同能够继续履行的应当继续履行。但是发生下列情况的，当事人免责：

(1) 不可抗力；

(2) 管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

(3) 管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

(4) 在没有过失的情况下，托管人由于按照本合同规定行使托管职责而造成的损失等；

(5) 在计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的；

(6) 管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给集合计划财产或投资者造成的损失向投资者承担连带责任；

(7) 投资者未能事前向管理人及托管人履行信息披露义务，致使发生违规投资行为的，管理人与托管人均不承担任何责任，投资者需就管理人与托管人由此遭受的损失承担赔偿责任；

(8) 相关法律、行政法规和规定的变更。

2、合同当事人在履行各自职责的过程中，违反法律法规的规定或者本合同约定，给资产管理计划财产或者其他当事人造成直接损失的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给资产管理计划财产或者其他当事人造成直接损失的，应当承担连带赔偿责任，并按照各自过错承担相应赔偿。

3、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

4、由于不可抗力原因或由于证券交易

的失职行为而给集合计划财产或投资者造成的损失向投资者承担连带责任。

(7)相关法律、行政法规和规定的变更。

2、合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。

3、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

4、由于不可抗力原因或份额登记机构非正常暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易、证券交易所、份额登记机构等发送的数据错误等非管理人、托管人的原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成计划资产或投资者损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

5、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

6、管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

7、投资者的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成集合计划资产损失的，管理人和托管人不承担任何责任。在投资者的集合计划资产被司法机关或其他政府机构扣押和查封的情况下，管理人和托管人没有义务代表投资者就针对集合计划资产所提起的司法或行政程序进行答辩，但是可以提供必要的协助。

所、份额登记机构等发送的数据错误等非管理人、托管人的原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成计划资产或投资者损失，管理人和托管人免除赔偿责任，由过错方承担相关责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

5、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接经济损失。

6、投资者的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成集合计划资产损失的，管理人和托管人不承担任何责任，由投资者承担相关责任。在投资者的集合计划资产被司法机关或其他政府机构扣押和查封的情况下，管理人和托管人没有义务代表投资者就针对集合计划资产所提起的司法或行政程序进行答辩，但是可以提供必要的协助。

二十七、资产管理合同的效力  
(三) 合同的生效条件

二十八、资产管理合同的效力  
(三) 合同的生效条件



<p>本合同成立后，投资者参与资金实际交付并确认后生效。</p> <p>资产管理合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。本集合计划终止，本合同终止。但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。托管人自管理人公告计划成立之日起履行托管职责。</p>	<p>本合同成立后，同时满足以下条件时生效：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、投资者认购/参与资金实际交付并确认，募集资金到达托管账户；</li> <li>2、本集合计划成立。</li> </ol> <p>资产管理合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。托管人自管理人公告计划成立之日起履行托管职责。</p>
<p><b>二十八、其他事项</b></p> <p>本合同所称的或有事件是指，根据相关法律法规的规定，管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。</p> <p>投资者在此同意，如果或有事件发生，在管理人与托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给本条上一款所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和投资者另行签订资产管理合同。但在转让前管理人应在管理人网站通告投资者。管理人保障投资者退出本集合计划的权利，并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。</p>	<p><b>二十九、其他事项</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、根据相关法律法规的规定，管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。投资者在此同意，如果上述事件发生，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给本条上一款所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和投资者另行签订资产管理合同。但在转让前管理人应在管理人网站通告投资者。管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。</li> <li>2、在不损害投资者实质利益的前提下，管理人有权根据管理运作实际情况对集合计划管理运作过程的相关事项进行调整或补充明确并及时予公告。</li> </ol>
<p><b>财富证券有限责任公司</b></p>	<p><b>管理人更名为“财信证券股份有限公司”</b></p>
<p><b>管理人住所：</b>长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 层</p>	<p><b>管理人住所变更为：</b>湖南省长沙市岳麓区茶子山东路 112 号滨江金融中心 T2 栋 (B 座) 26 层</p>
<p><b>管理人指定网站、管理人网站：</b><a href="http://www.cfzq.com">www.cfzq.com</a></p>	<p><b>管理人指定网站、管理人网站变更为：</b><a href="http://zg.stock.hnchasing.com">zg.stock.hnchasing.com</a></p>



---

**附件 2：《征询意见函》样本**

财信证券股份有限公司：

本投资者确认，已充分阅读并理解《财富证券财富 606 号集合资产管理计划合同变更及生效公告》及其附件的相关内容，承诺自行承担投资风险和损失。

本投资者 同意 不同意（请打勾）此次合同变更。

**投资者**

**个人填写：**

姓名：\_\_\_\_\_证件类型：\_\_\_\_\_证件号码：\_\_\_\_\_

住所：\_\_\_\_\_

联系电话：\_\_\_\_\_

传真：\_\_\_\_\_电子信箱：\_\_\_\_\_

通讯地址：\_\_\_\_\_

联系人：\_\_\_\_\_

**机构填写：**

机构名称：\_\_\_\_\_法定代表人：\_\_\_\_\_

住所：\_\_\_\_\_

联系电话：\_\_\_\_\_

传真：\_\_\_\_\_电子信箱：\_\_\_\_\_

通讯地址：\_\_\_\_\_

联系人：\_\_\_\_\_

投资者（签字/盖章）：\_\_\_\_\_

签署日期： 年 月 日

《征询意见函》请本人签字/盖章后扫描发送至 [cxzg@hnchasing.com](mailto:cxzg@hnchasing.com)