

---

# 财信证券财富 612 号集合资产管理计划

## 合同变更征询及生效公告

财信证券财富 612 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）成立于 2021 年 3 月 16 日，经管理人与托管人协商一致，现拟对《财信证券财富 612 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》第二十四章“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 2024 年 3 月 14 日至 2024 年 3 月 18 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 2024 年 3 月 18 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（即征询意见期内填写《征询意见函》（见附件）并附上本人身份证/营业执照复印件，由本人分别签字/盖章后扫描发送至管理人邮箱 [cxzg@hncf.com](mailto:cxzg@hncf.com)）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2024年3月19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。

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

2024年3月14日

**附件 1：《资产管理合同》变更条款对照表**

（本附件仅列举关键变更条款，详情请参考《财信证券财富 612 号集合资产管理计划资产管理合同（更新）》、《财信证券财富 612 号集合资产管理计划说明书》、《财信证券财富 612 号集合资产管理计划风险揭示书》。

<b>《财信证券财富 612 号集合资产管理计划资产管理合同》</b>	
<b>变更前</b>	<b>变更后</b>
<p><b>三、承诺与声明</b> （一）管理人承诺</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>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><b>三、承诺与声明</b> （一）管理人承诺与声明</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资产，不保证受托资产一定盈利，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，在投资者购买本资产管理计划时，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。</p> <p>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> （三）投资者声明</p>	<p><b>三、承诺与声明</b> （三）投资者承诺与声明</p> <p>增加：</p> <p>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、本集合计划成立、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</p>

	<p>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。</p> <p>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>
<p><b>四、当事人及权利义务</b>  (二) 当事人权力义务  1、投资者的权利义务  (1) 投资者的权利  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><b>四、当事人及权利义务</b>  (二) 当事人权力义务  1、投资者的权利义务  (1) 投资者的权利  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；  7) 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权利。</p>
<p><b>五、资产管理计划的基本情况</b>  (四) 集合计划的投资  3、投资比例  (1) 债权类资产：占本集合计划总资产的 80-100%；  (2) 股权类资产、金融衍生品类资产账户权益：占本集合计划总资产的</p>	<p><b>五、资产管理计划的基本情况</b>  (四) 集合计划的投资  3、投资比例  (1) 现金及债权类资产：占本集合计划总资产的 80-100%；  (2) 股权类资产：占本集合计划总资产的 0-20%；</p>

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%;

(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。

(3) 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%;

(4) 本集合计划总资产/净资产不得超过200%;

(5) 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;

(6) 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, 大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算, 且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。

投资者在此同意, 集合计划存续期间内, 为规避特定投资风险, 集合计划投资于债权类资产及现金的比例可以低于计划总资产80%, 但不得持续6个月低于本集合计划总资产80%。上述特定风险主要指市场趋势性风险。管理人可基于对债权类资产市场风险的判断, 调整资产配置比例。

#### 五、资产管理计划的基本情况

(八) 本集合计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构为财信证券有限责任公司。

#### 五、资产管理计划的基本情况

(八) 资产管理计划的费用

- 1、认购/参与费;
- 2、退出费;
- 3、托管费;
- 4、固定管理费;
- 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。

(九) 本集合计划不设分级安排。

	<p>(十) 本集合计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构为财信证券股份有限公司 (PT0300011686)。</p>
<p><b>八、资产管理计划的参与、退出与转让</b></p> <p>(一) 参与和退出的场所</p> <p>本集合计划的销售机构包括财信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。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>(三) 临时开放期</p> <p>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。</p> <p>管理人将提前告知托管行临时开放期安排, 如未告知, 则相关条款由管理人自行监督。</p> <p>(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p><b>2、集合计划参与和退出的程序</b></p> <p>(1) 参与的程序与确认</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>(2) 退出的程序与确认</p> <p>④ 退出款项划付</p> <p>若管理人确认投资者退出申请成功, 相应退出款项将于退出申请确认后 2 个工作日内从托管账户划出, 经销售机构划往投资者指定账户。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。在发生大额退出、巨额退出及连续巨额退出的情形时, 款项的支付办法参照本合同的有关条款处理。</p>	<p><b>八、资产管理计划的参与、退出与转让</b></p> <p>(一) 参与和退出的场所</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>(三) 临时开放期</p> <p>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。</p> <p>(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p><b>2、集合计划参与和退出的程序及确认</b></p> <p>(1) 参与的程序与确认</p> <p>④ 销售机构在 T 日的规定时间内受理投资者申请, 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。</p> <p>(2) 退出的程序与确认</p> <p>④ 退出款项划付</p> <p>若管理人确认投资者退出申请成功, 相应退出款项将于退出申请确认后 2 个工作日内从托管账户划出, 经销售机构划往投资者指定账户。资产管理计划向投资者支付的受托资金及收益应当返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或者同名账户。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。在发生大额退出、巨额退出及连续巨额退出的情形时, 款项的支付办法参照本合同</p>

	的有关条款处理。
<p><b>八、资产管理计划的参与、退出与转让</b>  <b>(十二) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式</b></p> <p>1、发生下列情形时，集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划投资者的参与申请：</p> <p>(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；</p> <p>(2) 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）；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(5) 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；</p> <p>(6) 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；</p> <p>(7) 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；</p> <p>(8) 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；</p> <p>(9) 法律法规、中国证监会规定或本合同认定的其它可拒绝或暂停参与的情形。</p> <p>发生上述(1)-(6)、(9)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。</p> <p>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：</p> <p>(1) 不可抗力的原因导致集合计划无</p>	<p><b>八、资产管理计划的参与、退出与转让</b>  <b>(十二) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式</b></p> <p>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：</p> <p>(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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1000万或仅剩余管理人自有资金（含子公司、孙公司）的；</p> <p>(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；</p> <p>(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）；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(11) 法律法规、中国证监会规定或本合同认定的其它可拒绝或暂停参与的情形。</p> <p>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</p>

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) 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；

(6) 法律、法规和中国证监会认定的其他情形。

发生上述(1)-(4)、(6)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，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。

发生计划说明书、资产管理合同中未予载明的事项，但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划退出申请的，应与托管人协商一致，并通过管理人网站公告。

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 1000 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，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。

发生计划说明书、资产管理合同中未予载明的事项，但集合计划管理人有正当

	<p>理由认为需要暂停接受集合计划退出申请的，应与托管人协商一致，并通过管理人网站公告。</p>
<p><b>八、资产管理计划的参与、退出与转让</b></p> <p>(十四) 管理人自有资金参与集合计划</p> <p>1、自有资金参与的条件：管理人募集期和存续期均可以以自有资金参与本集合计划。管理人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。</p> <p>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。</p> <p>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%。</p> <p>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。</p> <p>5、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、本合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； 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。 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><b>八、资产管理计划的参与、退出与转让</b></p> <p>(十四) 管理人自有资金参与集合计划</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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%。</p> <p>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。</p> <p>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：</p>

<p>(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的，应当及时调整达标，具体安排以管理人公告为准。</p> <p>6、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和时间限制，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报告。</p>	<p>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>(二) 投资范围及比例</p> <p>本集合计划投资范围及比例符合《运作规定》组合投资的要求，具体如下：</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</p>	<p><b>十一、资产管理计划的投资</b></p> <p>(二) 投资范围及比例</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、地方政府债券、中央银行票据、政府支持机构债券、政策性金融债、金</p>

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公司债和中小企业私募债券)、债券逆回购、中期票据、短期融资券及超短期融资券、资产属性为债权的可转换债券、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。资产证券化产品为在沪深交易所或银行间市场交易的优先级份额,且资产支持证券的基础资产不得为信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权),以及固定收益类公开募集证券投资基金、货币市场基金和经中国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;

(2) 股权类资产:因投资可转换债券、可交换债券进行转股、交换股票而形成的标准化股权类资产;

(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。

本集合计划的投资范围包含债券回购(含正回购、逆回购),债券回购为提升组合收益提供了可能,但也存在一定的风险。

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:占本集合计划总资产的80-100%;

(2) 股权类资产、金融衍生品类资产账户权益:占本集合计划总资产的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

融债券(包括金融机构次级债、混合资本债等)、同业存单、企业债券、公司债券、非金融企业债务融资工具(含中期票据、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)、可交换债券(包括私募品种)、可转换债券、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)、以及固定收益类公开募集证券投资基金、货币市场基金和经中国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、同业存款、大额存单等)以及债券逆回购形成的资产;

(2) 股权类资产:因投资可转换债券、可交换债券进行转股、交换股票而形成的标准化股权类资产;

(3) 期货和衍生品类资产:国债期货;

(4) 现金;

(5) 本集合计划可参与债券正回购业务。

本集合计划可参与债券回购(含正回购、逆回购),债券回购为提升组合收益提供了可能,但也存在一定的风险。法律法规或中国证监会允许集合计划改变投资范围和比例的,资产管理人应事先取得投资者同意并履行合同变更程序。

## 2、资产配置比例

(1) 现金及债权类资产:占本集合计划总资产的80-100%;

(2) 股权类资产:占本集合计划总资产的0-20%;

(3) 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%;

(4) 本集合计划总资产/净资产不得超过200%;

(5) 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

<p>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>(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 个工作日内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。</p> <p>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, 管理人应当在具备交易条件的 10 个工作日内调整完毕, 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。</p>	<p>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。</p> <p>(6) 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, 大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算, 且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>投资者在此同意, 集合计划存续期间内, 为规避特定投资风险, 集合计划投资于债权类资产及现金的比例可以低于计划总资产 80%, 但不得持续 6 个月低于本集合计划总资产 80%。上述特定风险主要指市场趋势性风险。管理人可基于对债权类资产市场风险的判断, 调整资产配置比例。</p> <p>(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 个工作日内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报告。</p> <p>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, 管理人应当在具备交易条件的 10 个工作日内调整完毕, 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。</p>
<p><b>十一、资产管理计划的投资</b></p> <p>(七) 投资限制及禁止行为</p> <p>1、投资限制</p> <p>为维护投资者的合法权益, 本集合计划的投资限制为:</p>	<p><b>十一、资产管理计划的投资</b></p> <p>(七) 投资限制及禁止行为</p> <p>1、投资限制</p> <p>为维护投资者的合法权益, 本集合计划的投资限制为:</p>

<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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%。</p> <p>(5) 本集合计划不得投资除公募基金以外的其他资产管理产品。</p> <p>(6) 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。</p> <p>(7) 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（如无债项评级，则以主体评级为准）。</p> <p>(8) 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%。</p> <p>(9) 本集合资产管理计划投资于资产管理产品的，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。</p> <p>中国证监会另有规定的除外。</p> <p>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 个工作日内调整至符合要求。</p>	<p>(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。</p> <p>(2) 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。</p> <p>(3) 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%。</p> <p>(4) 本集合计划不得投资除公募基金以外的其他资产管理产品。</p> <p>(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。</p> <p>(6) 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；投资于资产证券化产品优先档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）。</p> <p>(7) 本集合计划如投资于资产支持证券或资产支持票据的，其基础资产不得为信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权。</p> <p>(8) 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%。（如无主体评级，则以债项评级为准）</p> <p>(9) 本集合资产管理计划投资于资产管理产品的，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。</p> <p>(10) 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%。</p>
---	---

<p>若法律法规有变化，管理人可以对上述投资限制进行调整，并在管理人网站公告告知投资者。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>(24) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>	<p>(11) 本集合计划参与债券正回购资金余额不超过本集合计划上一日净资产的 100%。</p> <p>中国证监会另有规定的除外。</p> <p>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。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。</p> <p>2、禁止行为</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>十二、投资顾问</b></p> <p>本集合计划不聘请投资顾问。</p>	<p><b>十二、服务机构及投资顾问</b></p> <p>本集合计划管理人未委托其他机构为资产管理计划提供份额登记、估值、投资顾问等服务。</p>
<p><b>十四、利益冲突及关联交易</b></p> <p>(二) 资产管理计划关联交易</p> <p>1、投资者、托管人不可撤销地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）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</p>	<p><b>十四、利益冲突及关联交易</b></p> <p>(二) 资产管理计划关联交易</p> <p>1、关联方范围</p> <p>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）或电子邮件等方式向投资者披露。</p> <p>2、一般关联交易和重大关联交易</p> <p>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</p>

<p>进行披露。重大关联交易应向管理人所在地中国证监会派出机构报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。</p> <p>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>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。</p> <p>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、自律组织的规定或要求执行。</p> <p>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易为一般关联交易。</p> <p>但以下交易不视为重大关联交易，包括：公司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。</p> <p>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。</p> <p><b>3、关联交易的审批机制</b></p> <p>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</p>
---	--

	<p>交易应当符合合同约定的投资目标及策略。</p> <p>4、其他</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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><b>新增章节：</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</p>

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。

（一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

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。

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。

（二）投资证券后的清算交收安排

1、结算备付金与保证金

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, 资产管理人应最晚于资金交收当日上午 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。

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。如果由于资产管理人违反市场操作规

	<p>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。根据中国结算规定，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>其余章节序号顺延。</b></p>
<p><b>十九、资产管理计划财产的估值与会计核算</b></p> <p>(一) 集合计划财产的估值</p> <p>3、估值方法: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，可参考监管机构或行业协会有关规</p>	<p><b>二十、资产管理计划财产的估值与会计核算</b></p> <p>(一) 集合计划财产的估值</p> <p>3、估值方法: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</p>

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。

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；估值日无交易的，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，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可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。

④对在交易所市场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。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。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，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

⑤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。

⑥对在银行间市场上市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。对未在银行间市场上市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，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券品种，鉴于目前尚不存在活跃市场而应采用估值技术确定其公允价值。如管理人认为成本能够近似体现公允

税前应计利息作为估值全价；

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；

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

<p>价值，管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。</p> <p>⑦对在交易所市场挂牌转让的私募债券，鉴于目前尚不存在活跃市场而应采用估值技术确定其公允价值。如管理人认为成本能够近似体现公允价值，管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。</p> <p>⑧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，按成本估值。</p> <p>⑨持有的银行存款或通知存款以本金列示，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。</p> <p>⑩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）。</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>⑤持有的银行存款或通知存款以本金列示，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。</p> <p>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）。</p>
<p><b>二十、资产管理计划的费用与税收</b></p> <p>（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、管理费</p> <p>本集合计划的年管理费率为 0.5%，每日管理费计算方法如下：</p> $T = E \times 0.5\% \div 365;$ <p>T 为每日管理费；</p> <p>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）。</p> <p>本集合计划管理费自计划成立之日起，每日计提，逐日累计，按自然季度支付。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。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管理费。</p> <p>2、托管费</p>	<p><b>二十一、资产管理计划的费用与税收</b></p> <p>（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、固定管理费</p> <p>本集合计划的固定年管理费率为 0.5%，每日固定管理费计算方法如下：</p> $T = E \times 0.5\% \div 365;$ <p>T 为每日固定管理费；</p> <p>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）。</p> <p>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。</p>

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。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。

### 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) 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

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，管理人对投资者所持每笔份额的期间年化收益率超

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。

### 2、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。

### 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。

过业绩报酬计提基准的部分按【60%】比例计提为业绩报酬。

每笔集合计划份额期间年化收益率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 表示该笔份额在本次业绩报酬计提期间的持有期天数；

本集合计划第 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 超过  $r_i$  的部分的 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 表示该笔份额在本次业绩报酬计提期间的持有期天数；

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。

⑤从分红资金中提取业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次。

2) 业绩报酬计提方法

本集合计划分段计提业绩报酬，当投资者申请退出本集合计划，或本集合计划在分红、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。

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，如本集合计划第 i 个运作周期  $r_{i1}=r_{i2}$ ， $P_{i1}=P_{i2}$ ，则该运作周期业绩报酬计提基准为  $r$ ， $r=r_{i1}=r_{i2}$ 、提取比例为  $P$ ， $P=P_{i1}=P_{i2}$ ，如核算期间年化收益率大于业绩报酬计提基准  $r$ ，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  $P$  计算业绩报酬。每个业绩报酬核算期间各运作周期计提基准  $r_{i1}$ 、 $r_{i2}$  和提取比例  $P_{i1}$ 、 $P_{i2}$  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；  
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。  
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。

## 二十一、资产管理计划的收益分配

### （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，每份集合计划实际得到的分红金额可能

## 二十二、资产管理计划的收益分配

### （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，每份集合计划实际得到的分红金额可能

<p>有所不同)；</p> <p>2、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；</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，本集合计划原则上每年进行一次收益分配。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。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</p> <p>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</p> <p>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>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>有所不同)；</p> <p>2、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；</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>5、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>6、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>7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在法律法规和监管机构允许的范围内，管理人、托管人协商一致，可以对上述收益分配原则进行调整，并在管理人网站上公告。</p> <p>(三) 收益分配方案的确定、通知和实施</p> <p>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，管理人根据公告内容实施收益分配。</p>
<p><b>二十三、风险揭示</b></p> <p>(一) 资产管理计划面临的一般风险</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(关联方按照《企业会计准则》的规定确定)发行或者承销期内承销的证券，或者从</p>	<p><b>二十四、风险揭示</b></p> <p>(一) 资产管理计划面临的特殊风险</p> <p>7、关联交易风险</p> <p>(1) 重大关联交易风险</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</p>

<p>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不公平交易，但是依然不能避免未来可能发生的关联交易风险。</p>	<p>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。</p> <p>(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。</p>
<p><b>二十三、风险揭示</b> (三) 其他风险</p> <p>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，本集合计划有提前终止的风险。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>	<p><b>二十四、风险揭示</b> (三) 其他风险</p> <p>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0.8500元，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0.8500元。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。</p> <p>2、投资者可能无法参与、及时退出的</p>

<p>险。</p> <p>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或展期安排，提请投资者注意此潜在风险。</p>	<p>风险</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p><b>3、强制退出风险</b></p> <p>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。</p> <p><b>4、默认处理的风险</b></p> <p>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：</p> <p>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。</p> <p>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</p>
---	---

投资者注意此潜在风险。

增加：

### 12、个人信息（含敏感个人信息）泄露、篡改、丢失的风险

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。

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。

### 13、技术风险、操作风险、不可抗力因素导致的风险等。

（1）在本集合计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等：

（2）管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险；

（3）战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致本集合计划财产的损失，从而带来风险；

（4）因集合计划业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方

	<p>面不完善而产生的风险；</p> <p>（5）因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；</p> <p>（6）金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管银行违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划投资者利益受损。</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>（一）集合计划合同变更的条件和程序</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同作出修改：</p> <p>（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，包括但不限于资产管理计划备案过程中，被要求补正备案材料，涉及到本合同修改的；</p> <p>（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，包括但不限于管理人与托管人之间指令、清算交收规则的变更；</p> <p>（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（newzg.cfzq.com）公告后生效，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。</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>（一）集合计划合同变更的条件和程序</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同作出修改：</p> <p>（1）因监管规则变化，需要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；</p> <p>（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；</p> <p>（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。</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>（三）集合计划/合同的终止</p> <p>有下列情形之一的，集合计划/合同应</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>（三）集合计划/合同的终止</p> <p>有下列情形之一的，集合计划/合同应</p>

<p>当终止：</p> <p>(6) 未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；</p> <p>(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；</p> <p>(8) 本集合计划单位净值低于 0.8500 元，管理人依据本合同约定提前终止的；</p> <p>(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；</p> <p>(10) 本计划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；</p> <p>(11) 因战争、自然灾害等不可抗力力的发生导致本集合计划不能存续；</p> <p>(12) 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。管理人应当自本集合计划终止之日起五个工作日内报中国证券投资基金业协会备案，前述第（6）项约定的情形除外。</p>	<p>当终止：</p> <p>(6) 未在证券投资基金业协会完成备案的情形；</p> <p>(7) 本集合计划单位净值低于 0.8500 元，管理人依据本合同约定提前终止的；</p> <p>(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；</p> <p>(9) 本计划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；</p> <p>(10) 因战争、自然灾害等不可抗力力的发生导致本集合计划不能存续；</p> <p>(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、退出申请并终止本资产管理计划、进入清算程序；</p> <p>(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、退出申请并终止本资产管理计划、进入清算程序；</p> <p>(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。管理人应当自本集合计划终止之日起五个工作日内报告中国证券投资基金业协会。</p>
<p>财信证券有限责任公司</p>	<p>管理人更名为“财信证券股份有限公司”</p>
<p>管理人住所：湖南省长沙市岳麓区茶子山东路 112 号滨江金融中心 T3、T4 及裙房 718</p>	<p>管理人住所变更为：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>管理人指定网站、管理人网站： newzg.cfzq.com</p>	<p>管理人指定网站、管理人网站变更为 <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《财信证券财富 612 号集合资产管理计划合同变更征询及生效公告》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@hncf.com](mailto:cxzg@hncf.com)