关于世纪证券融享 24M004 号集合资产管理计划合同变更的公告

尊敬的投资者：

由我司作为管理人，兴业银行股份有限公司作为托管人的世纪证券融享 24M004 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2022 年 10 月 20 日成立，为满足客户需求，拟对《世纪证券融享 24M004 号集合资产管理计划资产管理合同》、《世纪证券融享 24M004 号集合资产管理计划说明书》、《世纪证券融享 24M004 号集合资产管理计划风险揭示书》进行变更，详细内容见本公告附件。

为保证投资者利益，本计划变更事宜已经获得托管人兴业银行股份有限公司的书面同意确认。投资者不同意本次合同变更的应在2024年10月21日提出退出申请。未提出退出申请的，视同投资者已经同意本次合同变更。截止2024年10月21日，若同意合同变更的投资者数量不少于 2 人（含 2 人），则我司约定2024年10月22日为合同变更生效日；若同意合同变更的客户数量少于 2 人，则本计划终止。

特此公告

附件 1：世纪证券融享 24M004 号集合资产管理计划资产管理合同变更明细表
附件 2：世纪证券融享 24M004 号集合资产管理计划说明书变更明细表
附件 3：世纪证券融享 24M004 号集合资产管理计划风险揭示书变更明细表

世纪证券有限责任公司

2024 年 10 月 21 日

附件 1：世纪证券融享 24M004 号集合资产管理计划资产管理合同变更明细表

序号	位置	原合同	变更后合同
1	“全文”	全文中“投资者委托资产”、“委托财产”、“委托资产”	修改为“受托资产”
2	“二、释义”	《管理办法》 中国证券监督管理委员会在 2018 年 10 月 22 日发布的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；	《管理办法》 指中国证监会发布的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（2023 年 1 月 12 日证监会公告〔2023〕2 号修订并于 2023 年 3 月 1 日施行）；
3	“二、释义”	《运作规定》 中国证券监督管理委员会在 2018 年 10 月 22 日发布的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》；	《运作规定》 指中国证监会发布的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（2023 年 1 月 12 日证监会令第 203 号修订并于 2023 年 3 月 1 日施行）；
4	“二、释义”	合格投资者 （三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构； （五）基本养老金、社会保障基金、**企业年金等养老基金**、慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；	合格投资者 （三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、**商业银行理财子公司**、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构； （五）基本养老金、社会保障基金、**年金基金等养老基金**、慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；
5	“二、释义”	临时开放期 指仅在合同变更、合同展期、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限三种情况下，管理人临时设置的投资者仅可以办理退出业务的日期，临时开放期的具体安排以管理人公告或管理人向投资者发出的通知为	临时开放期 指因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订或因本计划运作的实际情况需要变更合同及在发生其他必要情况时，管理人临时设置的投资者仅可以办理退出业务的日期，

		准；如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放期时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排执行；	临时开放期的具体安排以管理人公告为准；
6	“三、承诺与声明”	（三）投资者声明 投资者声明**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。 投资者声明其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；声明用于证券投资的**资金**来源不属于违法犯罪所得及其收益；声明证券投资的**资金**来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；声明出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；声明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。	（三）投资者声明 投资者声明**参与资金**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。 投资者声明其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；声明用于证券投资的**参与资金**来源不属于违法犯罪所得及其收益；声明证券投资的**参与资金**来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；声明出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；声明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。
7	“四、当事人及权利义务”	（一）当事人 管理人 法定代表人：余维佳 住所：深圳市前海深港合作区南山街道桂湾五路 128 号前海深港基金小镇对冲基金中心 406 通信地址：深圳市福田区金田路 2026 号能源大厦北塔楼 23-25 层 托管人	（一）当事人 管理人 法定代表人：李剑峰 住所：深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5073 号民生互联网大厦 C 座 1401-1408、1501-1508、1601-1606、1701-1705 通信地址：深圳市南山区梦海大道 5073 号华海金融创新中心 C 座 16-19 层 托管人

		法定代表人/授权代表：吕家进 邮政编码：350000 联系人：林诗琪	法定代表人：吕家进 邮政编码：200120 联系人：周敏敏
8	“四、当事人及权利义务”	（二）权益约定 本集合计划设定为均等份额，每份份额具有同等的合法权益。	（二）权益约定 本集合计划设定为均等份额，每份份额具有同等的合法权益，**承担同等风险**。
9	“四、当事人及权利义务”	（三）当事人的权利和义务 1、投资者的权利和义务 （2）投资者的义务 （j）保守商业秘密，不得泄露集合计划的投资计划、投资意向等；不得利用集合计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；	（三）当事人的权利和义务 1、投资者的权利和义务 （2）投资者的义务 （j）保守商业秘密，不得泄露集合计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；
10	“四、当事人及权利义务”	2、管理人的权利和义务 （1）管理人的权利 （d）根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对集合计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；	2、管理人的权利和义务 （1）管理人的权利 删除（d）
11	“四、当事人及权利义务”	2、管理人的权利和义务 （2）管理人的义务 （h）除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作本集合计划财产； （i）保守商业秘密，不得泄露集合计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外； （k）除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人	2、管理人的权利和义务 （2）管理人的义务 （h）不得向管理人以及任何第三人输送利益；不得委托第三人运作资产管理计划财产； （i）保守商业秘密，不得泄露集合计划的投资计划、投资意向、**投资信息**等，依法依规提供信息的除外； （k）不得利用资产管理计划，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，违规为本机构

		及其关联方提供融资； （q）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； （s）根据法律法规与本合同的规定，编制向投资者披露的集合计划季度、年度等定期报告，**向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构**； 新增（y）	及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资； （q）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； （s）根据法律法规与本合同的规定，编制向投资者披露的集合计划季度、年度等定期报告； 新增（y） （y）根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对集合计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构；
12	“四、当事人及权利义务”	3、托管人的权利和义务 （2）托管人的义务 （b）**除依据法律法规规定和本合同的约定外，**不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产； （i）编制私募资产管理业务托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构； （k）保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露； （m）监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构**和证券投资基金业协会**； 新增（p）	3、托管人的权利和义务 （2）托管人的义务 （b）不得为托管人以及任何第三人输送利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产； （i）编制托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构； （k）保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外； （m）监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构； 新增（p） （p）托管人向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息，具体以公开市场披露的主体信息和证券信息为准；

13	“五、资产管理计划的基本情况”	（四）集合计划的投资 2、投资范围 （1）固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金（**含已按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》等规定完成规范及合同变更的券商大集合产品**）、公募货币市场基金。 债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（不含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换私募债，不允许换股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、同业存单、**信用风险缓释工具（凭证、合约）**等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。	（四）集合计划的投资 2、投资范围 （1）固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金、公募货币市场基金。 债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（不含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换私募债，不允许换股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、**永续债**、同业存单等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。
14	“五、资产管理计划的基本情况”	（四）集合计划的投资 3、投资比例 投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或承销期内承销的证券，可以将集合计划的资产投资于管理人关联方发行的公募产品，或者从事其他重大关联交易。管理人运用集合计划财产从事上述交易时，应当遵守相关法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同的约定，遵循投资者利益优先原则，严格按照投资决策程序进行决策和审批，采取切实有效	（四）集合计划的投资 3、投资比例 删除

		措施防范利益冲突和利益输送。 在本集合计划利益冲突事项发生之日起 10 个工作日内，管理人应通知托管人，并通过管理人的网站向投资者予以披露或其他方式通知投资者，披露或通知内容包括但不限于交易的时间、标的名称、数量、金额等，并根据相关法律法规的要求（如有）向证券交易所或其他监管机构报告。托管人应配合向管理人提供关联方信息，不晚于本集合计划成立日将其、及其控股股东、实际控制人及其其他关联方名单提供给管理人，并负责及时更新该等名单及清单。 如法律法规或监管部门对从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定执行。	
15	“五、资产管理计划的基本情况”	（四）集合计划的投资 3、投资比例 本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的有关规定，因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致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本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整至符合相关要求。如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。	（四）集合计划的投资 3、投资比例 本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的有关规定，因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致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本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合相关要求。如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。
16	“五、资产管理计划的基本情况”	（十）封闭期、开放期安排 本集合计划自成立之日起每 24 个月开放一次，**开放时间为 1 个工作日，**开放当日可以办理参与和退出业务，具体开放安排以管理人公告为准。 本集合计划临时开放期仅在合同变更、合同展期、因集合计	（十）封闭期、开放期安排 本集合计划自成立之日起每 24 个月开放一次，开放当日可以办理参与和退出业务，具体开放安排以管理人公告为准。 临时开放期指因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规

		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限三种情况下设置，投资者在临时开放期仅可以办理退出业务，临时开放期的具体安排以管理人公告或管理人向投资者发出的通知为准。 如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放期时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排执行。	则修订或因本计划运作的实际情况需要变更合同及在发生其他必要情况时，管理人临时设置的投资者仅可以办理退出业务的日期，临时开放期的具体安排以管理人公告为准。 如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放期时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排执行。
17	“六、集合计划的募集”	（一）募集对象 本集合计划仅面向经推广机构世纪证券有限责任公司及**华融湘江银行股份有限公司**认可的合格投资者募集，合格投资者累计不得超过 200 人。	（一）募集对象 本集合计划仅面向经推广机构世纪证券有限责任公司及**湖南银行股份有限公司**认可的合格投资者募集，合格投资者累计不得超过 200 人。
18	“七、集合计划的成立与备案”	（一）集合计划成立的条件和日期 募集期内，集合计划的参与资金总额不低于1000万元人民币，投资者的人数为 2 人（含）以上且不超过 200 人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定，**并在集合计划募集资金缴足之日起 10 个工作日内经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后**，管理人宣布本集合计划成立。集合计划成立时间以管理人正式发出的成立公告为准。	（一）集合计划成立的条件和日期 募集期内，集合计划的参与资金总额不低于 1000 万元人民币，投资者的人数为 2 人（含）以上且不超过 200 人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定的，管理人宣布本集合计划成立。集合计划成立时间以管理人正式发出的成立公告为准。
19	“七、集合计划的成立与备案”	（三）集合计划开始运作的条件和日期 1、本集合计划开始运作的前提条件：本集合计划符合本合同约定的成立条件并经管理人公告成立。 2、本集合计划的备案：管理人应在集合计划成立起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。集合计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。	（三）集合计划开始运作的条件和日期 1、本集合计划开始运作的前提条件：本集合计划符合本合同约定的成立条件并经管理人公告成立。 2、本集合计划的备案：管理人应在集合计划成立起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。集合计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。**本集合计划自完成备案之日前不得开始投资运作，但以现**

		3、本集合计划开始运作的日期：本集合计划自完成备案之日起开始投资运作，但以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。	**金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。** 3、管理人开展投资活动前，应及时向托管人发送成立通知。备案完成后，应及时向托管人发送备案通过的材料。
20	“八、集合计划的参与、退出与转让”	**（七）管理人及其附属机构以自有资金参与集合计划** 1、自有资金参与、退出的条件 本集合计划的管理人及其附属机构可以自有资金参与本集合计划。管理人及其附属机构自有资金参与、退出本集合计划时，应符合监管机构发布的相关规定的要求。 2、参与比例或金额 管理人以自有资金参与本集合计划时，自有资金参与份额不超过集合计划总份额的16%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划时，参与份额合计不超过集合计划总份额的50%。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限的，管理人可在90个工作日内按照本合同约定在临时开放期内申请退出所持有的份额，直至参与比例符合本合同约定。 3、收益分配和责任承担方式 管理人及其附属机构自有资金参与本集合计划所形成的份额在本集合计划进行收益分配时，与其他投资者的份额享有同等权益。管理人及其附属机构自有资金参与本集合计划所形成的份额与其他投资者的份额享有同等权益、承担同等风险。 4、自有资金参与和退出的约定 （1）自有资金参与退出的约束 管理人以自有资金参与集合计划的持有期限不得低于6个月。	**（七）证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与和退出集合计划** 1、全体投资者和托管人在此不可撤销地同意并授权证券期货经营机构及其附属机构可在募集期以自有资金参与本集合计划，事后证券期货经营机构应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者，并及时通过电子邮件、纸质文件等方式告知托管人。 在开放期内由于投资者退出导致的证券期货经营机构自有资金投资被动超标的，无需事先取得投资者同意，但证券期货经营机构在自有资金退出后及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者，并及时通过电子邮件、纸质文件等方式告知托管人。 除上述情形外的自有资金参与、退出情形，证券期货经营机构应当提前五个工作日通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者，并提前五个工作日通过电子邮件、纸质文件等方式告知托管人，并取得投资者和托管人的同意。 证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与、退出本集合计划的，应符合《管理办法》《运作规定》和中国证监会等监管机构的规定。 2、证券期货经营机构将与投资者按照持有本集合计划份额的比例共担风险和共享收益。

		因本集合计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与比例或管理人及其附属机构自有资金参与比例被动超标的，在遵守相关监管要求的前提下，管理人可根据自有资金参与退出的有关法规适时安排自有资金的退出，不受前述条款限制。 （2）自有资金参与退出的信息披露 管理人以自有资金参与、退出时，应当提前 5 个工作日在管理人网站上披露并通知资产托管机构。 （3）应对集合计划巨额赎回，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出集合计划可不受上述参与比例和本款第（1）条、第（2）条限制，但管理人应通知托管人，通过管理人的网站告知投资者，并向中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会报告。 5、管理人特别提示 （1）管理人及其附属机构有权以自有资金参与集合计划，不构成管理人及其附属机构一定会以自有资金参与集合计划以及具体参与时间的承诺。 （2）管理人及其附属机构以自有资金参与集合计划，相关份额与投资者持有的同类份额享有同等参与收益分配的权利，不对投资者份额承担任何补偿责任。因此，管理人及其附属机构自有资金的参与不构成对投资者本金及收益的保证，也不能保证投资者份额本金不受损失。	3、证券期货经营机构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%，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。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比例的，证券期货经营机构应在上述情形出现的 20 个工作日内进行调整。 4、证券期货经营机构及其附属机构自有资金参与本集合计划的持有期限不得少于 6 个月。 5、为应对巨额退出以解决流动性风险，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，证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与、退出可不受上述条款的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。
21	“八、集合计划的参与、退出与转让”	新增（九）其他事项	（九）其他事项 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。

22	“十一、集合计划的投资”	（二）投资范围 1、固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金（**含已按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引）》等规定完成规范及合同变更的券商大集合产品**）、公募货币市场基金。 债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（不含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换私募债，不允许换股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、同业存单、**信用风险缓释工具（凭证、合约）**等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。	（二）投资范围 1、固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金、公募货币市场基金。 债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（不含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换私募债，不允许换股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、**永续债**、同业存单等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。
23	“十一、集合计划的投资”	（三）投资比例 投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或承销期内承销的证券，可以将集合计划的资产投资于管理人关联方发行的公募产品，或者从事其他重大关联交易。管理人运用集合计划财产从事上述交易时，应当遵守相关法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同的约定，遵循投资者利益优先原则，严格按照投资决策程序进行决策和审批，采取切实有效措施防范利益冲突和利益输送。 在本集合计划利益冲突事项发生之日起 10 个工作日内，管理	（三）投资比例 删除

		人应通知托管人，并通过管理人的网站向投资者予以披露或其他方式通知投资者，披露或通知内容包括但不限于交易的时间、标的名称、数量、金额等，并根据相关法律法规的要求（如有）向证券交易所或其他监管机构报告。托管人应配合向管理人提供关联方信息，不晚于本集合计划成立日将其、及其控股股东、实际控制人及其其他关联方名单提供给管理人，并负责及时更新该等名单及清单。 如法律法规或监管部门对从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定执行。	
24	“十一、集合计划的投资”	（三）投资比例 本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的有关规定，因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致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本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的15个交易日内调整至符合相关要求。如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。	（三）投资比例 本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的有关规定，因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致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本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的20个交易日内调整至符合相关要求。如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。
25	“十一、集合计划的投资”	（七）投资限制及禁止行为 1、投资限制 （1）本集合计划完成备案前不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外； （2）本集合计划的总资产不得超过净资产的140%； （3）本集合计划投资于同一资产的资金不超过本集合计划资	（七）投资限制及禁止行为 1、投资限制 （1）本集合计划的总资产不得超过净资产的200%； （2）本集合计划投资于同一资产的资金不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金额不得超过该资产的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；

		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金额不得超过该资产的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）本集合计划参与债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，且不得超过拟发行公司本次发行的总量； （5）本集合计划投向的资产支持证券（票据），挂牌场所仅限沪深交易所和银行间市场，且不得投向以资管产品或其受益权作为底层资产的资产支持证券（票据）； （6）信用债的主体或担保人或债项评级不得低于AA；其中AA+、AAA占比不低于80%；不得投资于云南、贵州、广西、内蒙古地区的债券；不得投资于房地产企业、民营企业发行的债券； （7）法律、行政法规、中国证监会及《集合资产管理合同》规定的其他限制；	（3）本集合计划参与债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，且不得超过拟发行公司本次发行的总量； （4）本集合计划投向的资产支持证券（票据），挂牌场所仅限沪深交易所和银行间市场，且不得投向以资管产品或其受益权作为底层资产的资产支持证券（票据）； （5）信用债的主体评级不得低于AA； （6）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%的，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不受前述规定限制；管理人在资产管理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%后及时告知托管人； （7）法律、行政法规、中国证监会及《集合资产管理合同》规定的其他限制；
26	“十四、利益冲突及关联交易”	本集合计划可能存在利益冲突事项包括但不限于：（1）投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或承销期内承销的证券；（2）投资管理人关联方发行的公募产品。 投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或承销期内承销的证券，可以将集合计划的资产投资于管理人关联方发行的公募产品，或者从事其他重大关联交易。管理人运用集合计划财产从事上述交易时，应当遵守相关法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同的约定，遵循投资者利益优先原则，严格按照投资决策程序进行决策和审批，采取切实有效	（一）资产管理计划存在或可能存在利益冲突的情形 投资者知悉，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理本资产管理计划资产、公平对待各投资组合，本资产管理计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于： 1、将资产管理计划资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、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、管理人将本资产管理计划资产与关联方开展逆回购交易或以管理人及关联方发行的证券作为质押券的，或者从事其他关联交易事项； 2、将资产管理计划资产投资于管理人关联方发行的其他金融

		措施防范利益冲突和利益输送。 在本集合计划利益冲突事项发生之日起 10 个工作日内，管理人应通知托管人，并通过管理人的网站向投资者予以披露或其他方式通知投资者，披露或通知内容包括但不限于交易的时间、标的名称、数量、金额等，并根据相关法律法规的要求（如有）向证券交易所或其他监管机构报告。托管人应配合向管理人提供关联方信息，不晚于本集合计划成立日将其、及其控股股东、实际控制人及其其他关联方名单提供给管理人，并负责及时更新该等名单及清单。 如法律法规或监管部门对从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定执行。	产品； 3、本资产管理计划若为 FOF 产品的，管理人投资于管理人设立的资产管理计划； 4、其他可能产生重大利益冲突且对投资者利益有重大影响的情况； 5、因管理人、托管人业务特性或本资产管理计划运作特性存在的相关利益冲突情形： （1）管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突； （2）管理人管理的其他资产管理计划（包括本资产管理计划投资经理管理的其他资产管理计划）基于各自投资策略需要可能与本资产管理计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，该等利益冲突可能会不利于本资产管理计划，也可能使本资产管理计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等； （3）管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本资产管理计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本资产管理计划的投资运作； （4）其它因管理人、托管人业务特性或资产管理计划运作特性而本身存在的相关利益冲突情形。 （二）存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容及频率 1、存在利益冲突时的处理方式 管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本资管管理计划财产，公平对待全体投资者，实现在公司、股

			东和员工个人的利益与投资者利益发生冲突时，优先保障投资者的利益，不同投资者利益之间的利益发生冲突时，公平对待不同投资者。 2、存在利益冲突时的披露方式 本资产管理计划发生利益冲突情形的，将严格按照法律法规及本合同约定完成相应信息披露，投资者可通过管理人网站或管理人安排的其他信披方式查询。 投资者知悉并确认，对于本条第（一）款第 5 项利益冲突情形，管理人和托管人不再另行安排披露事宜。 3、存在利益冲突时的披露内容和频率 （1）管理人运用受托资产从事一般关联交易的，一般关联交易事后，管理人将定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。 管理人运用受托资产从事重大关联交易的，管理人将及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前取得投资者同意；重大关联交易事后，管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。 通知内容包括但不限于关联交易的关联方、时间、内容、数量、金额、投资者异议的处理方式等。 （2）发生前述其它利益冲突情形的，按照法律法规及本合同约定的方式、内容和频率完成信息披露。 （三）关联交易 1、本合同所称关联方包括：资产管理计划管理人以及管理人管理的其他账户，管理人的控股股东、实际控制人及其他关联

			方，管理人的子公司以及子公司管理的账户，资产管理计划托管人以及托管人的关联方，其他与资产管理计划管理人或托管人有重大利害关系的机构。管理人的关联方名单将于管理人网站披露，托管人的关联方名单以本合同或托管协议约定为准或以托管人公布的年度报告或其他定期报告中披露的关联方名单为准，投资者可按上述路径进行查阅。 2、资产管理计划的关联方与资产管理计划之间的交易视为资产管理计划的关联交易，包括但不限于： （1）投资关联方发行或承销的证券； （2）以关联方为交易对手进行银行间市场等场外交易； （3）通过关联方席位进行交易； （4）其他导致资产管理计划与关联方之间发生利益转移的活动。 3、一般关联交易和重大关联交易 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。重大关联交易具体指管理人运用财产出资投资于管理人、托管人及其控股股东、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证券，除此以外的其他关联交易为一般关联交易。法律法规、监管及自律机构对关联交易业务规范有其他规定的，从其规定。 投资者在此不可撤销地确认，投资者签署本合同即事先同意并授权管理人可将本资产管理计划从事一般关联交易；一般关联交易事后，管理人应定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会派出机构报告，具体以法律法规、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构的规定为准。

			若从事重大关联交易的，管理人应当通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前通知投资者，事先取得投资者的同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。投资者未在约定时间内提出书面异议的视为同意，投资者提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确；重大关联交易事后，管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。 4、关联交易的内控机制 （1）管理人应当遵循诚信公平、投资者利益优先原则，以公平、合理的市场价格进行关联交易，防范利益冲突，禁止利益输送，保护投资者权益。管理人已制定相应的关联交易管理制度，明确了关联交易的认定标准、交易定价方法、信息披露、内部审批和评估机制等。本集合计划开展关联交易前，将采取一事一批的形式，说明交易的必要性和相关费用定价的公允性、合理性。不得以集合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。管理人内部制度对关联交易有新的规定的，从其规定。 （2）审批程序 业务部门在上报业务审批时，应就业务是否存在关联交易进行明确说明。暂时不存在关联交易的无需说明，后期投资过程中如涉及的需另行发起审批。在公司关联交易已审批额度内的投资者认购和标准化资产通过系统直接交易的，仍应按照规定进行信息披露、报送、报告等。 交易事项经判断属于重大关联交易的，投资经理及其他业务人员在每次投资执行前应提交投资决策委员会审议，经投资决策委员会审议同意后方可执行，并按公司制度要求报备，根据规

			定接受审计。 所有关联交易在投资前均应当按照法律法规和资管合同的约定履行投资者的提前告知并征得投资者同意方可执行。在资管合同中明确约定已经取得投资者的概括授权同意的一般关联交易除外。 （四）其他 1、除将本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外，管理人不得将本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，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、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（专业投资者为私募资产管理产品的，穿透认定该私募资产管理产品的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）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。 2、法律法规、其他规范性文件、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构或管理人内部制度对关联方的范围、一般关联交易和重大关联交易的区分、管理人的内控机制、存在利益冲突的情形、存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容和频率等另有规定或要求的，管理人遵照执行。
27	“十五、投资经理的指定与变更”	（一）投资经理简介 冯冰，法国雷恩高等商学院硕士，9年债券从业经验，曾就职于华林证券固定收益部、华英证券债券投资交易部。经历债券投资、交易、发行工作，在利率及衍生品、信用债板块均	（一）投资经理简介 冯冰，法国雷恩高等商学院硕士，10年债券从业经验，曾就职于华林证券固定收益部、华英证券债券投资交易部。经历债券投资、交易、发行工作，在利率及衍生品、信用债板块均有实

		有实践，获得银行间本币市场2019年度优秀交易主管。	践，获得银行间本币市场2019年度优秀交易主管。
28	“十六、集合计划的财产”	（二）集合计划财产的保管与处分 1、集合计划的债务由集合计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对集合计划财产的债务承担责任。	（二）集合计划财产的保管与处分 1、资产管理计划财产为信托财产，其债务由资产管理计划财产本身承担，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。
29	“十七、投资指令的发送、确认和执行”	修改（一）交易清算授权	（一）投资指令的授权
30	“十八、越权交易的界定”	（二）越权交易的处理程序 1、违反有关法律法规和本合同的规定进行的投资交易行为： （3）管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告**管理人住所地**中国证监会派出机构。	（二）越权交易的处理程序 1、违反有关法律法规和本合同的规定进行的投资交易行为： （3）管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会派出机构。
31	“十八、越权交易的界定”	（三）托管人对管理人投资运作的监督 1、对本合同约定的投资范围按照如下标准进行监督： （1）固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金**（含已按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引）》等规定完成规范及合同变更的券商大集合产品）**、公募货币市场基金。 债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（不含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可	（三）托管人对管理人投资运作的监督 1、对本合同约定的投资范围按照如下标准进行监督： （1）固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金、公募货币市场基金。 债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（不含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换私募债，不允许换股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、**永续债**、同业存单等在证

		交换私募债，不允许换股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、同业存单、**信用风险缓释工具（凭证、合约）**等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。	券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。
32	“十八、越权交易的界定”	（二）托管人对管理人投资运作的监督 2、对本计划以下投资比例和投资限制进行监督： （1）固定收益类资产占集合计划总资产的比例不低于 80%； （2）国债期货持仓合约价值占集合计划总资产的比例不超过 80%； （3）本集合计划参与债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过上一日净资产的 100%； （4）本集合计划完成备案前不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外； （5）本集合计划的总资产不得超过净资产的 140%； （6）本集合计划投资于同一资产的资金不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金额不得超过该资产的 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； （7）本集合计划参与债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，且不得超过拟发行公司本次发行的总量； （8）本集合计划投向的资产支持证券（票据），挂牌场所仅	（三）托管人对管理人投资运作的监督 2、对本计划以下投资比例和投资限制进行监督： （1）固定收益类资产占集合计划总资产的比例不低于 80%； （2）国债期货持仓合约价值占集合计划总资产的比例不超过 80%； （3）本集合计划参与债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过上一日净资产的 100%； （4）本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%； （5）本集合计划投资于同一资产的资金不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金额不得超过该资产的 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）本集合计划参与债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，且不得超过拟发行公司本次发行的总量； （7）本集合计划投向的资产支持证券（票据），挂牌场所仅限沪深交易所和银行间市场； （8）信用债的主体评级不得低于 AA； （9）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%的，本集合计划的总资产不得超过净资

		限沪深交易所和银行间市场，且不得投向以资管产品或其受益权作为底层资产的资产支持证券（票据）； （9）信用债的主体或担保人或债项评级不得低于 AA；其中 AA+、AAA 占比不低于 80%； （10）法律、行政法规、中国证监会规定的其他限制；	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不受前述规定限制；管理人在资产管理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%后及时告知托管人； （10）法律、行政法规、中国证监会规定的其他限制。
33	“十八、越权交易的界定”	（三）托管人对管理人投资运作的监督 3、托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内，对本计划的直接投资履行监督职能。托管人发现管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同时，不予执行，应当通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式向托管人进行解释或举证，由此造成的损失由管理人承担。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地证监会派出机构、**证券投资基金业协会**。 6、如需托管人对本计划关联交易进行监督的，管理人应于合同生效前提供管理人关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。若管理人没有及时提供关联方信息，导致托管人无法及时对关联方证券进行监督，所产生的一切后果过错方承担责任。托管人应根据自身的关联方名单对本计划关联交易进行监督。	（三）托管人对管理人投资运作的监督 3、托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内，对本计划的投资履行监督职能。托管人发现管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同时，不予执行，应当通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式向托管人进行解释或举证，由此造成的损失由管理人承担。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告证监会派出机构。 6、如需托管人对本计划关联交易进行监督的，管理人应于合同生效前提供管理人关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。**托管人仅根据上述名单对资产管理计划买卖关联方发行的或者承销期内承销的证券进行关联交易监督。**若管理人没有及时提供关联方信息，导致托管人无法及时对关联方证券进行监督，所产生的一切后果过错方承担责任。托管人应根据自身的关联方名单对本计划关联交易进行监督。
34	“十九、集合计划财产的估值和会计核算”	7、估值方法 （1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值，具体估值机构由计划管理人与计划托管人	7、估值方法 （1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值，具体估值机构由计划管理人与计划托

		另行协商约定； 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值； 交易所上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中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债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； （2）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净价估值。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净价或推荐估值净价进行估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，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。对银行间市场未上市的债券，应采用估值技术确定其公允价值。 （3）对在交易所及银行间市场上市交易或挂牌转让的信用风险缓释工具，按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值价进行估值，第三方估值机构未提供估值价格的，采用其他估值技术确定公允价值； （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）持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金	管人另行协商约定； 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务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进行估值； 交易所上市交易的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，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。 （2）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值基准服务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，按照第三方估值基准服务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进行估值。 （3）对于含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，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估值，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。 （4）对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。 （5）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； （6）持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金

		（LOF）等），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； 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； 持有的货币市场基金，按所投资基金前一交易日的万份收益计提估值日基金收益； 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，按照成本估值； 按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引）》等规定完成规范及合同变更的券商大集合产品参照公募基金进行估值。 （6）银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。 （7）债券回购以成本列示，按实际利率在回购期间内逐日计提应收/应付利息。 （8）国债期货以估值日相关证券交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。 （9）该计划应当按照新金融工具准则规定，以预期信用损失为基础，对适用的金融资产进行减值会计处理。 （10）相关法律法规以及监管部门另有新规定的，从其规定。	（LOF）等），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； 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； 持有的货币市场基金，按所投资基金前一交易日的万份收益计提估值日基金收益； 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，按照成本估值； （7）银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。 （8）债券回购以成本列示，按实际利率在回购期间内逐日计提应收/应付利息。 （9）国债期货以估值日相关证券交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。 （10）该计划应当按照新金融工具准则规定，以预期信用损失为基础，对适用的金融资产进行减值会计处理。 （11）相关法律法规以及监管部门另有新规定的，从其规定。 9、估值错误与遗漏的处理方式 （b）差错处理原则 5）差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因集合计划托管人过错造成集合计划资产损失，集合计划管理人应为集合计划的利益

		9、估值错误与遗漏的处理方式 （b）差错处理原则 5）差错责任方拒绝进行赔偿时，**如果因集合计划管理人过错造成集合计划资产损失，集合计划托管人应为集合计划的利益向集合计划管理人追偿；**如果因集合计划托管人过错造成集合计划资产损失，集合计划管理人应为集合计划的利益向集合计划托管人追偿。除集合计划管理人和托管人之外的第三方造成集合计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由集合计划管理人负责向差错方追偿。	向集合计划托管人追偿。除集合计划管理人和托管人之外的第三方造成集合计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由集合计划管理人负责向差错方追偿。
35	“二十、集合计划的费用与税收”	（一）集合计划费用 3、业绩报酬 业绩报酬计提办法 K为业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准由管理人公告，业绩报酬计提基准将在产品的推广公告中列示，若产品存续期间，管理人需变更业绩报酬计提基准的，则管理人将公告新的业绩报酬计提基准，管理人将设置临时开放期供不同意新的业绩报酬计提基准的**委托人**退出。 因涉及份额的注册登记，管理人负责计算与复核，托管人配合进行资金汇划。	（一）集合计划费用 3、业绩报酬 （2）业绩报酬计提办法 K为业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准由管理人公告，业绩报酬计提基准将在产品的推广公告中列示，若产品存续期间，管理人需变更业绩报酬计提基准的，则管理人将公告新的业绩报酬计提基准，管理人将设置临时开放期供不同意新的业绩报酬计提基准的**投资者**退出。
36	“二十二、信息披露与报告”	（一）定期报告 3、年度审计报告 管理人应当聘请**具有证券相关业务资格的**会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，审计机构应当对本集合计划会计核算及净值计算等出具意见。管理人应在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给投资者和托管人。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人不	（一）定期报告 3、年度审计报告 管理人应当聘请**符合《证券法》规定的**会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，审计机构应当对本集合计划会计核算及净值计算等出具意见。管理人应在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给投资者和托管人。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人不编制集合计划

<table>
<tr><td></td><td></td><td>编制集合计划当期的年度审计报告。</td><td>当期的年度审计报告。</td></tr>
<tr><td>37</td><td>“二十二、信息披露与报告”</td><td>（二）临时报告
8、发生本合同约定的关联交易的事项；</td><td>（二）临时报告
8、发生本合同约定的重大关联交易的事项；</td></tr>
<tr><td>38</td><td>“二十二、信息披露与报告”</td><td>（三）托管人履职报告（以下称“托管报告”）
1. 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。
3. 管理人应当在每年度结束后两个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。</td><td>（三）托管人履职报告（以下称“托管报告”）
1. 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。
3. 管理人应当在每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。</td></tr>
<tr><td>39</td><td>“二十二、信息披露与报告”</td><td>（五）特殊主体参与披露
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集合计划，管理人应通过季度报告或其他方式向投资者进行披露，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</td><td>（五）特殊主体参与披露
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集合计划，管理人应通过季度报告或其他方式向投资者进行披露，并向中国证监会相关派出机构报告。</td></tr>
<tr><td>40</td><td>“二十二、信息披露与报告”</td><td>（六）监管报告
表格
报送主体：管理人<table><tr><td>种类</td><td>事项</td><td>时间</td><td>途径</td></tr><tr><td>报</td><td>资管计划成立</td><td>资产管理计</td><td>证券投资基金业</td></tr></table></td><td>（六）监管报告
表格
报送主体：管理人<table><tr><td>种类</td><td>事项</td><td>时间</td><td>途径</td></tr><tr><td>报</td><td>资管计划成立</td><td>资产管理计</td><td>证券投资基金业</td></tr></table></td></tr>
</table>

		告		划成立之日起五个工作日内	协会、中国证监会相关派出机构	告		划成立之日起五个工作日内	协会、中国证监会相关派出机构
		报告	资管计划变更	资产管理合同变更之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、**中国证监会相关派出机构**	报告	资管计划变更	资产管理合同变更之日起五个工作日内	证券投资基金业协会
		报告	资管计划终止	自资产管理计划终止之日起五个工作日内	**证券投资基金业协会**、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划终止	自资产管理计划终止之日起五个工作日内	中国证监会相关派出机构
		报告	资管计划清算结果	在资产管理计划清算结束后五个工作日内	**证券投资基金业协会**、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划清算结果	在资产管理计划清算结束后五个工作日内	中国证监会相关派出机构
		报告	资管计划因流动性受限等原因延期清算	及时	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划因流动性受限等原因延期清算	及时	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
		报告	资管计划产品季报	每季度结束之日起一个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划产品季报	每季度结束之日起一个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
		报告	资管计划产品年报	每年度结束之日起四个月内披露	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划产品年报	每年度结束之日起四个月内披露	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
		报告	私募资产管理业务季报	每季度结束之日起一个	**证券投资基金业协会**、中国证	报告	私募资产管理业务季报	每季度结束之日起一个	中国证监会相关派出机构

		月内	监会相关派出机构
报告	私募资产管理业务年报	每年度结束之日起四个月内	**证券投资基金业协会、**中国证监会相关派出机构
报告	对私募资产管理业务的内部控制情况进行年度审计	每年度结束之日起四个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
报告	重大关联交易	**发生之日起10个工作日内**	**证券投资基金业协会、**中国证监会相关派出机构**、证券期货交易所（如涉及）**
报告	高级管理人员、私募资产管理业务部门负责人以及投资经理离任	自离任之日起三十个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
报表	持续募集情况、投资运作情况、资产最终投向等信息	每月 10 日前	证券投资基金业协会、**中国证监会相关派出机构**
报表	资管产品数据报送	每月 10 日前	人民银行

报送主体：托管人

		月内	
报告	私募资产管理业务年报	每年度结束之日起四个月内	中国证监会相关派出机构
报告	对私募资产管理业务的内部控制情况进行年度审计	每年度结束之日起四个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
报告	重大关联交易	及时	中国证监会相关派出机构
报告	**一般关联交易**	**定期**	**中国证监会相关派出机构**
报告	高级管理人员、私募资产管理业务部门负责人以及投资经理离任	自离任之日起三十个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
报表	持续募集情况、投资运作情况、资产最终投向等信息	每月 10 日前	证券投资基金业协会
报表	资管产品数据报送	每月 10 日前	**证券投资基金业协会**

报送主体：托管人

种类	事项	时间	途径
报告	私募资产管理业务托管年度报告	每年度结束之日起四个	中国证监会相关派出机构

<table>
<tr><td></td><td></td><td><table>
<tr><td>种类</td><td>事项</td><td>时间</td><td>途径</td></tr>
<tr><td>报告</td><td>私募资产管理业务托管年度报告</td><td>每年度结束之日起四个月内</td><td>证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构</td></tr>
<tr><td>报告</td><td>监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的</td><td>及时</td><td>证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构</td></tr>
</table></td><td><table>
<tr><td></td><td></td><td>月内</td><td></td></tr>
<tr><td>报告</td><td>监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的</td><td>及时</td><td>中国证监会相关派出机构</td></tr>
</table></td></tr>
<tr><td>41</td><td>“二十三、风险揭示”</td><td>（一）特殊风险揭示
9、备案风险
本集合计划完成备案前不得开展投资活动，仅可以现金管理为目的投资于高流动性资产，如本集合计划不能在短期内完成备案，则将影响本集合计划的投资收益。如本集合计划未能在成立之日起 3 个月内取得证券投资基金业协会产品备案成功的确认，管理人单方面选择终止本集合计划的或基金业协会不予备案，投资者不但面临投资收益不及预期的风险，而且面临资金未按照预期回流的再投资风险。</td><td>（一）特殊风险揭示
9、备案风险
如本集合计划未能在成立之日起 3 个月内取得证券投资基金业协会产品备案成功的确认，管理人单方面选择终止本集合计划的或基金业协会不予备案，投资者不但面临投资收益不及预期的风险，而且面临资金未按照预期回流的再投资风险。</td></tr>
<tr><td>42</td><td>“二十三、风险揭示”</td><td>（二）一般风险揭示
9、关联交易风险
本集合计划可能将委托资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或者承销期内承销的证券，可以将集合</td><td>（二）一般风险揭示
9、关联交易风险
管理人可能将本资产管理计划资产从事关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、充分关注。同时，托管人关联</td></tr>
</table>

		计划的资产投资于管理人关联方发行的公募产品，或者从事其他重大关联交易。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，但投资者应充分知悉此关联交易风险。	方名单由托管人提供，可能存在托管人不提供前述名单或提供的名单不完整的情形。投资者可能面临因本计划关联方名单的获取、界定、识别不明确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关重大关联交易以至于本计划从事前述相关重大关联交易未事先再单独征询投资者意见及其他可能的相关风险，以及投资者认知的本计划关联方、一般和重大关联交易的区分标准与管理人采用的名单和标准不完全一致的风险。投资者一旦签署本合同即代表投资者同意管理人从事除重大关联交易以外的一般关联交易，不会另行逐笔事先征询投资者的意见，造成投资者无法事前知悉每笔一般关联交易的风险。管理人从事重大关联交易的，会事先通知全体投资者并征询投资者的意见，但管理人的征询方式、投资者反馈的方式和时限均由管理人确定，可能存在投资者在管理人或销售机构处留存的通讯信息不准确、不更新的，将导致管理人无法及时通知到投资者，或发生投资者未及时查询相关信息导致最终未及时反馈意见的风险；或发生因投资者未按照管理人通知中要求的时间和方式进行反馈或在反馈意见中意见表示不明确，而被视为反馈了同意意见的情形，从而可能存在进行该笔重大关联交易与投资者主观意愿不相符的风险。
43	“二十四、合同的变更、终止与财产清算”	（一）合同的补充、修改与变更 1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则或根据中国证券投资基金业协会的要求须变更、调整合同条款的，本集合计划将变更合同的相关内容，本合同相关内容及条款按该要求办理并在管理人网站公告。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说明书与新的法	（一）合同的补充、修改与变更 1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则或根据中国证券投资基金业协会的要求须变更、调整合同条款的，本集合计划将变更合同的相关内容，本合同相关内容及条款按该要求办理并在管理人网站公告。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说明书与新的法律法规

		律法规或有关政策不一致的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公告满 5 个工作日后生效**。投资者对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。 6、管理人应当自合同变更之日起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，**并抄报中国证监会相关派出机构**。	或有关政策不一致的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，**更新或修改的内容于管理人网站公告所载明的日期起生效**。投资者对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。 6、管理人应当自合同变更之日起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案。
44	“二十四、合同的变更、终止与财产清算”	（四）集合计划的终止 新增（8） 管理人应自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，**并抄报中国证监会相关派出机构**，前述第（7）项约定的情形除外。	（四）集合计划的终止 新增（8） （8）管理人有权根据产品的运作情况决定提前终止本计划；管理人应自资产管理计划终止之日起五个工作日内报告证券投资基金业协会，前述第（7）项约定的情形除外。
45	“二十四、合同的变更、终止与财产清算”	（五）集合计划的清算 6、管理人应当在集合计划清算结束后 5 个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案，**并抄报中国证监会相关派出机构**； 7、集合计划因资产流动性受限等原因延期清算的，管理人可对此制定延期清算方案，该方案应经托管人认可，并在管理人网站公告或其他方式通知投资者。当本集合计划达到可清算条件时，管理人须按照上述清算流程予以清算。当延期清算发生时，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；	（五）集合计划的清算 6、管理人应当在集合计划清算结束后 5 个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案； 7、集合计划因资产流动性受限等原因延期清算的，管理人可对此制定延期清算方案，该方案应经托管人认可，并在管理人网站公告或其他方式通知投资者。当本集合计划达到可清算条件时，管理人须按照上述清算流程予以清算。当延期清算发生时，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告；
46	“二十七、合同效力”	（一）合同的成立与生效 新增	（一）合同的成立与生效 本计划存续期内，管理人应依据法律法规履行相应反洗钱义务，并主动配合托管账户开立结算银行根据监管部门有关反洗钱要求开展客户身份识别工作，提供真实、准确、完整的客户

			资料：根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，遵守各方反洗钱与反恐怖融资相关管理规定。对具备合理理由怀疑涉嫌洗钱、恐怖融资的客户，任何一方有权按照中国人民银行反洗钱监管规定采取必要管控措施，或单方面终止本合作。 合同其他方签署本合同即视为知悉/授权托管人可为订立、履行个人作为一方当事人的合同所必需或为履行法定职责或者法定义务所必需而处理个人信息；托管人承诺对上述个人信息的处理合法合规，其他方亦已知悉其享有《个人信息保护法》项下所有相关权利。如果个人信息系由一方向另一方提供的，该方承诺已告知并获得相关个人同意向另一方提供个人信息，且个人已知晓个人信息的使用用途。
47	“二十七、合同效力”	（二）合同的组成 本合同适用托管协议**《世纪证券融享24M004号集合资产管理计划资产托管协议》**，但各方特别认可并同意，该托管协议中与本合同不一致的内容均以本合同约定内容为准。资管合同未尽事宜，依据托管协议的约定执行。	（二）合同的组成 本合同适用托管协议**《世纪证券系列集合资产管理计划之资产托管协议（托管人结算模式 【统签】）》**，但各方特别认可并同意，该托管协议中与本合同不一致的内容均以本合同约定内容为准。资管合同未尽事宜，依据托管协议的约定执行。

附件 2：世纪证券融享 24M004 号集合资产管理计划说明书变更明细表

序号	位置	原说明书	变更后说明书
1	开放期	本集合计划自成立之日起每 24 个月开放一次，**开放时间为 1 个工作日**，开放当日可以办理参与和退出业务，具体开放安排以管理人公告为准。	本集合计划自成立之日起每 24 个月开放一次，开放当日可以办理参与和退出业务，具体开放安排以管理人公告为准。
2	销售机构	世纪证券有限责任公司、华融湘江银行股份有限公司、北京度小满基金销售有限公司及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本计划的机构	世纪证券有限责任公司与湖南银行股份有限公司及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本计划的机构

3	投资范围	1、固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金**（含已按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引）》等规定完成规范及合同变更的券商大集合产品）**、公募货币市场基金。 债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（不含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换私募债，不允许换股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、同业存单、**信用风险缓释工具（凭证、合约）**等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。	1、固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金、公募货币市场基金。 债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（不含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换私募债，不允许换股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、**永续债**、同业存单等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。
4	投资比例	投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或承销期内承销的证券，可以将集合计划的资产投资于管理人关联方发行的公募产品，或者从事其他重大关联交易。管理人运用集合计划财产从事上述交易时，应当遵守相关法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同的约定，遵循投资者利益优先原则，严格按照投资决策程序进行决策和审批，采取切实有效措施防范利益冲突和利益输送。 在本集合计划利益冲突事项发生之日起 10 个工作日内，管理人应通知托管人，并通过管理人的网站向投资者予以披露或其他方式通知投资者，披露或通知内容包括但不限于交易的	删除

		时间、标的名称、数量、金额等，并根据相关法律法规的要求（如有）向证券交易所或其他监管机构报告。托管人应配合向管理人提供关联方信息，不晚于本集合计划成立日将其、及其控股股东、实际控制人及其其他关联方名单提供给管理人，并负责及时更新该等名单及清单。 如法律法规或监管部门对从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定执行。	
5	投资比例	本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的有关规定，因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致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本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的15个交易日内调整至符合相关要求。如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。	本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的有关规定，因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致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本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的20个交易日内调整至符合相关要求。如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。
6	投资策略	1、债券类属策略 2、期限结构策略 3、利差交易策略 4、持有到期策略	1、资产配置策略 2、债券投资策略 3、正回购的投资策略 4、基金投资策略 5、国债期货投资策略
7	投资限制	1、本集合计划完成备案前不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外； 2、本集合计划的总资产不得超过净资产的140%； 3、本集合计划投资于同一资产的资金不超过本集合计划资产	1、本集合计划的总资产不得超过净资产的200%； 2、本集合计划投资于同一资产的资金不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金额不得超过该资产的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；

		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金额不得超过该资产的 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、本集合计划参与债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，且不得超过拟发行公司本次发行的总量； 5、本集合计划投向的资产支持证券（票据），挂牌场所仅限沪深交易所和银行间市场，且不得投向以资管产品或其受益权作为底层资产的资产支持证券（票据）； 6、信用债的主体或担保人或债项评级不得低于 AA；其中 AA+、AAA 占比不低于 80%；不得投资于云南、贵州、广西、内蒙古地区的债券；不得投资于房地产企业、民营企业发行的债券； 7、法律、行政法规、中国证监会及《集合资产管理合同》规定的其他限制； 本集合计划自成立之日起 6 个月为建仓期，管理人在建仓期内的投资应当符合本合同约定的投资范围和本集合计划的风险收益特征（以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债、货币市场基金的除外），但无须满足本集合计划的投资组合比例限制。建仓期结束，本集合计划的投资组合比例应符合本合同约定的投资组合比例限制的要求。	3、本集合计划参与债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，且不得超过拟发行公司本次发行的总量； 4、本集合计划投向的资产支持证券（票据），挂牌场所仅限沪深交易所和银行间市场，且不得投向以资管产品或其受益权作为底层资产的资产支持证券（票据）； 5、信用债的主体评级不得低于 AA； 6、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%的，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不受前述规定限制；管理人在资产管理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%后及时告知托管人； 7、法律、行政法规、中国证监会及《集合资产管理合同》规定的其他限制； 本集合计划自成立之日起 6 个月为建仓期，管理人在建仓期内的投资应当符合本合同约定的投资范围和本集合计划的风险收益特征（以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债、货币市场基金的除外），但无须满足本集合计划的投资组合比例限制。建仓期结束，本集合计划的投资组合比例应符合本合同约定的投资组合比例限制的要求。
8	费用与税收	3、业绩报酬 （3）业绩报酬支付 因涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核由管理人完成，托管人根据管理人的划款指令进行划款。业绩报酬在业绩报	3、业绩报酬 （3）业绩报酬支付 业绩报酬在业绩报酬计提日（如有）计提，由管理人在计提次日向托管人发送业绩报酬划付指令，根据管理人的划付指令从

		酬计提日（如有）计提，由管理人在计提次日向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人的划付指令从集合计划资产中将计提的业绩报酬划付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。	集合计划资产中将计提的业绩报酬划付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。
9	费用与税收	（二）税收 本集合计划运营过程中发生的应税行为（含增值税）须按相关规定缴纳的，该税款由集合计划**委托资产**承担，由管理人从集合计划**委托资产**中提取并根据相关法律法规支付。如法律法规对上述税收事宜另有具体规定的，从其规定。	（二）税收 本集合计划运营过程中发生的应税行为（含增值税）须按相关规定缴纳的，该税款由集合计划**受托资产**承担，由管理人从集合计划**受托资产**中提取并根据相关法律法规支付。如法律法规对上述税收事宜另有具体规定的，从其规定。
10	信息披露与报告	（一）定期报告 3、年度审计报告 管理人应当聘请**具有证券相关业务资格的**会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，审计机构应当对本集合计划会计核算及净值计算等出具意见。管理人应在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给投资者和托管人。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人不编制集合计划当期的年度审计报告。	（一）定期报告 3、年度审计报告 管理人应当聘请**符合《证券法》规定**的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，审计机构应当对本集合计划会计核算及净值计算等出具意见。管理人应在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给投资者和托管人。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人不编制集合计划当期的年度审计报告。
11	信息披露与报告	（二）临时报告 8、发生资产管理合同约定的关联交易的事项；	（二）临时报告 8、发生资产管理合同约定的**重大**关联交易的事项；
12	信息披露与报告	（三）托管人履职报告（以下称“托管报告”） 1. 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，**同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，**由管理人根据资产管理合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监	（三）托管人履职报告（以下称“托管报告”） 1. 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，由管理人根据资产管理合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

		督情况及有关报告财务数据的复核意见等。 3. 管理人应当在每年度结束后两个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。	3. 管理人应当在每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。
13	信息披露与报告	（五）特殊主体参与披露 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集合计划，管理人应通过季度报告或其他方式向投资者进行披露，并向中国证监会相关派出机构**和证券投资基金业协会**报告。	（五）特殊主体参与披露 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集合计划，管理人应通过季度报告或其他方式向投资者进行披露，并向中国证监会相关派出机构报告。
14	投资者的权益和义务	2、投资者的义务 （10）保守商业秘密，不得泄露集合计划的投资计划、投资意向等；不得利用集合计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；	2、投资者的义务 （10）保守商业秘密，不得泄露集合计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；
15	利益冲突及关联交易	本集合计划可能存在利益冲突事项包括但不限于：（1）投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或承销期内承销的证券；（2）投资管理人关联方发行的公募产品。 投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或承销期内承销的证券，可以将集合计划的资产投资于管理人关联方发行的公募产品，或者从事其他重大关联交易。管理人运用集合计划财产从事上述交易时，应当遵守相关法律、行政法规、中国证监会的规定和资产管理合同的约定，遵循投资者利益优先原则，严格按照投资决策程序进行决策和审批，采取切实有效措施防范利益冲突和利益输送。 在本集合计划利益冲突事项发生之日起10个工作日内，管理	（一）资产管理计划存在或可能存在利益冲突的情形 投资者知悉，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理本资产管理计划资产、公平对待各投资组合，本资产管理计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于： 1、将资产管理计划资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、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、管理人将本资产管理计划资产与关联方开展逆回购交易或以管理人及关联方发行的证券作为质押券的，或者从事其他关联交易事项； 2、将资产管理计划资产投资于管理人关联方发行的其他金融产品； 3、本资产管理计划若为FOF产品的，管理人投资于管理人设

		人应通知托管人，并通过管理人的网站向投资者予以披露或其他方式通知投资者，披露或通知内容包括但不限于交易的时间、标的名称、数量、金额等，并根据相关法律法规的要求（如有）向证券交易所或其他监管机构报告。托管人应配合向管理人提供关联方信息，不晚于本集合计划成立日将其、及其控股股东、实际控制人及其其他关联方名单提供给管理人，并负责及时更新该等名单及清单。 如法律法规或监管部门对从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定执行。	立的资产管理计划； 4、其他可能产生重大利益冲突且对投资者利益有重大影响的情况； 5、因管理人、托管人业务特性或本资产管理计划运作特性存在的相关利益冲突情形： （1）管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突； （2）管理人管理的其他资产管理计划（包括本资产管理计划投资经理管理的其他资产管理计划）基于各自投资策略需要可能与本资产管理计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，该等利益冲突可能会不利于本资产管理计划，也可能使本资产管理计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等； （3）管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本资产管理计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本资产管理计划的投资运作； （4）其它因管理人、托管人业务特性或资产管理计划运作特性而本身存在的相关利益冲突情形。 （二）存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容及频率 1、存在利益冲突时的处理方式 管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本资管管理计划财产，公平对待全体投资者，实现在公司、股东和员工个人的利益与投资者利益发生冲突时，优先保障投资者的利益，不同投资者利益之间的利益发生冲突时，公平对待

			不同投资者。 2、存在利益冲突时的披露方式 本资产管理计划发生利益冲突情形的，将严格按照法律法规及本合同约定完成相应信息披露，投资者可通过管理人网站或管理人安排的其他信披方式查询。 投资者知悉并确认，对于本条第（一）款第 5 项利益冲突情形，管理人和托管人不再另行安排披露事宜。 3、存在利益冲突时的披露内容和频率 （1）管理人运用受托管理资产从事一般关联交易的，一般关联交易事后，管理人将定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。 管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，管理人将及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前取得投资者同意；重大关联交易事后，管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。 通知内容包括但不限于关联交易的关联方、时间、内容、数量、金额、投资者异议的处理方式等。 （2）发生前述其它利益冲突情形的，按照法律法规及本合同约定的方式、内容和频率完成信息披露。 （三）关联交易 1、本合同所称关联方包括：资产管理计划管理人以及管理人管理的其他账户，管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方，管理人的子公司以及子公司管理的账户，资产管理计划托管人以及托管人的关联方，其他与资产管理计划管理人或托管

			人有重大利害关系的机构。管理人的关联方名单将于管理人网站披露，托管人的关联方名单以本合同或托管协议约定为准或以托管人公布的年度报告或其他定期报告中披露的关联方名单为准，投资者可按上述路径进行查阅。 2、资产管理计划的关联方与资产管理计划之间的交易视为资产管理计划的关联交易，包括但不限于： （1）投资关联方发行或承销的证券； （2）以关联方为交易对手进行银行间市场等场外交易； （3）通过关联方席位进行交易； （4）其他导致资产管理计划与关联方之间发生利益转移的活动。 3、一般关联交易和重大关联交易 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。重大关联交易具体指管理人运用财产出资投资于管理人、托管人及其控股股东、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证券，除此以外的其他关联交易为一般关联交易。法律法规、监管及自律机构对关联交易业务规范有其他规定的，从其规定。 投资者在此不可撤销地确认，投资者签署本合同即事先同意并授权管理人可将本资产管理计划从事一般关联交易；一般关联交易事后，管理人应定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会派出机构报告，具体以法律法规、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构的规定为准。 若从事重大关联交易的，管理人应当通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前通知投资者，事先取得投资者的

			同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。投资者未在约定时间内提出书面异议的视为同意，投资者提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确；重大关联交易事后，管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。 4、关联交易的内控机制 （1）管理人应当遵循诚信公平、投资者利益优先原则，以公平、合理的市场价格进行关联交易，防范利益冲突，禁止利益输送，保护投资者权益。管理人已制定相应的关联交易管理制度，明确了关联交易的认定标准、交易定价方法、信息披露、内部审批和评估机制等。本集合计划开展关联交易前，将采取一事一批的形式，说明交易的必要性和相关费用定价的公允性、合理性。不得以集合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。管理人内部制度对关联交易有新的规定的，从其规定。 （2）审批程序 业务部门在上报业务审批时，应就业务是否存在关联交易进行明确说明。暂时不存在关联交易的无需说明，后期投资过程中如涉及的需另行发起审批。在公司关联交易已审批额度内的投资者认购和标准化资产通过系统直接交易的，仍应按照规定进行信息披露、报送、报告等。 交易事项经判断属于重大关联交易的，投资经理及其他业务人员在每次投资执行前应提交投资决策委员会审议，经投资决策委员会审议同意后方可执行，并按公司制度要求报备，根据规定接受审计。 所有关联交易在投资前均应当按照法律法规和资管合同的约

			定履行投资者的提前告知并征得投资者同意方可执行。在资管合同中明确约定已经取得投资者的概括授权同意的一般关联交易除外。 （四）其他 1、除将本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外，管理人不得将本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，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、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（专业投资者为私募资产管理产品的，穿透认定该私募资产管理产品的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）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。 2、法律法规、其他规范性文件、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构或管理人内部制度对关联方的范围、一般关联交易和重大关联交易的区分、管理人的内控机制、存在利益冲突的情形、存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容和频率等另有规定或要求的，管理人遵照执行。

附件 3：世纪证券融享 24M004 号集合资产管理计划风险揭示书变更明细表

序号	位置	原风险揭示书	变更后风险揭示书
1	二、风险揭示	（二）一般风险揭示 9、关联交易风险 本集合计划可能将委托资产投资于管理人、托管人及管理人、	（二）一般风险揭示 9、关联交易风险 管理人可能将本资产管理计划资产从事关联交易，相关投资存

		托管人的关联方发行或者承销期内承销的证券，可以将集合计划的资产投资于管理人关联方发行的公募产品，或者从事其他重大关联交易。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，但投资者应充分知悉此关联交易风险。	在一定风险，提请投资者知悉、充分关注。同时，托管人关联方名单由托管人提供，可能存在托管人不提供前述名单或提供的名单不完整的情形。投资者可能面临因本计划关联方名单的获取、界定、识别不明确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关重大关联交易以至于本计划从事前述相关重大关联交易未事先再单独征询投资者意见及其他可能的相关风险，以及投资者认知的本计划关联方、一般和重大关联交易的区分标准与管理人采用的名单和标准不完全一致的风险。 投资者一旦签署本合同即代表投资者同意管理人从事除重大关联交易以外的一般关联交易，不会另行逐笔事先征询投资者的意见，造成投资者无法事前知悉每笔一般关联交易的风险。 管理人从事重大关联交易的，会事先通知全体投资者并征询投资者的意见，但管理人的征询方式、投资者反馈的方式和时限均由管理人确定，可能存在投资者在管理人或销售机构处留存的通讯信息不准确、不更新的，将导致管理人无法及时通知到投资者，或发生投资者未及时查询相关信息导致最终未及时反馈意见的风险；或发生因投资者未按照管理人通知中要求的时间和方式进行反馈或在反馈意见中意见表示不明确，而被视为反馈了同意意见的情形，从而可能存在进行该笔重大关联交易与投资者主观意愿不相符的风险。