
财富证券财富 3 个月定期开放（001 期）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 3 个月定期开放（001 期）集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）成立于 2019 年 11 月 15 日，经管理人与托管人协商一致，现拟对《财富证券财富 3 个月定期开放（001 期）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上海浦东发展银行股份有限公司长沙分行达成一致。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 2022 年 5 月 10 日至 2022 年 5 月 13 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 2022 年 5 月 16 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临时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 2022 年 5 月

16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》第二十章“资产管理计划的费用与税收”第（四）节“业绩报酬”第2条“业绩报酬计提方法”拟进行变更，变更后：管理人对投资者所持每笔份额的期间年化收益率超过业绩报酬计提基准的部分按一定比例分段计提业绩报酬。集合计划下一个运作周期为2022年5月16日至2022年8月15日，经管理人审慎考虑，下一个运作周期的业绩报酬计提基准 r_{i1} 、 r_{i2} 均为4.2%/年，提取比例 P_{i1} 、 P_{i2} 均为超过业绩报酬计提基准以上部分的60%。

本集合计划拟于2022年5月16日开放并进行收益分配，收益分配当日将根据变更前的《财富证券财富3个月定期开放（001期）集合资产管理计划资产管理合同》约定的业绩报酬计提方法计提业绩报酬。

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

2022年5月10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《财富证券财富 3 个月定期开放（001 期）集合资产管理计划资产管理合同（更新）》、《财富证券财富 3 个月定期开放（001 期）集合资产管理计划说明书》、《财富证券财富 3 个月定期开放（001 期）集合资产管理计划风险揭示书》。

《财富证券财富 3 个月定期开放(001 期)集合资产管理计划资产管理合同》	
变更前	变更后
二、释义	<p>增加：</p> <p>《民法典》：指 2020 年 5 月 28 日经第十三届全国人民代表大会第三次会议表决通过并于 2021 年 1 月 1 日起施行的《中华人民共和国民法典》。</p> <p>《证券法》：指 1998 年 12 月 29 日经第九届全国人民代表大会常务委员会第六次会议通过、2004 年 8 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第十一次会议第一次修正、2005 年 10 月 27 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议第一次修订、2013 年 6 月 29 日经第十二届全国人民代表大会常务委员会第三次会议第二次修正、2014 年 8 月 31 日经第十二届全国人民代表大会常务委员会第十次会议第三次修正、2019 年 12 月 28 日经第十三届全国人民代表大会常务委员会第十五次会议第二次修订通过，并于 2020 年 3 月 1 日起施行的《中华人民共和国证券法》。</p> <p>《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过、2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订、2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议修正的《中华人民共和国证券投资基金法》。</p> <p>《个人信息保护法》：指 2021 年 8 月 20 日经 2021 年 8 月 20 日第十三届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过的《中华人民共和国个人信息保护法》及颁布机关对其不时做出的修订。</p>

	<p>关联方：按照《企业会计准则第 36 号-关联方披露》的规定定义。</p>
<p>三、承诺与声明 (一) 管理人承诺</p>	<p>增加：</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 https://stock.hnchasing.com）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>三、承诺与声明 (三) 投资者声明</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。</p> <p>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。</p> <p>4、出示真实有效的身份证件或者其他</p>	<p>三、承诺与声明 (三) 投资者声明</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。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资料可能导致的无法认购或参与本集合计划的后果。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

<p>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>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。</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。</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>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>增加：</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>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</p>

	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>五、资产管理计划的基本情况</p> <p>(四) 集合计划的投资</p> <p>3、投资比例</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%。</p>	<p>五、资产管理计划的基本情况</p> <p>(四) 集合计划的投资</p> <p>3、投资比例</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) 股权类资产和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%。</p>
<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p> <p>(二) 参与和退出的时间</p>	<p>增加：</p> <p>3、违约退出</p> <p>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。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处置申请。违约退出费率参考本合同的退出费率，退出违约金（如有）应当全额归入本集合计划财产。</p>
<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p> <p>(十) 巨额退出及连续巨额退出的认定和处理方式</p> <p>1、巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(2) 当出现巨额退出时，集合计划管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出，或与托管人协商一致后决定部分延期退出或暂停退出。</p> <p>②部分延期退出：当集合计划管理人认为支付投资者的退出款项有困难或认为支付投资者的退出款项可能会对集合计划的资产净值造成较大波动时，集合计划管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额的 10%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日受理的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；投资者未能退出的部分，投资者可选择延期办理或撤</p>	<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p> <p>(十) 巨额退出及连续巨额退出的认定和处理方式</p> <p>1、巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(2) 当出现巨额退出时，集合计划管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出，或与托管人协商一致后决定部分延期退出或暂停退出。</p> <p>②部分延期退出：当集合计划管理人认为支付投资者的退出款项有困难或认为支付投资者的退出款项可能会对集合计划的资产净值造成较大波动时，集合计划管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额的 10%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日受理的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；投资者未能退出的部分，投资者可选择延期办理或撤销退出申请，未明确作出选择的投资者视为选择</p>

销退出申请，未明确作出选择的投资者视为选择延期办理。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以实际退出日前一个工作日的计划单位净值为基础计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

2、连续巨额退出的认定和处理方式

(2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

②当集合计划管理人认为连续支付投资者的退出申请确有困难或认为连续支付投资者的退出申请对集合计划的资产净值造成很大波动时，管理人可以暂停接受退出申请。对已经接受的退出申请，可以延缓支付退出款项，退出金额以实际退出日前一工作日的集合计划单位净值为基础进行计算，并通过管理人网站向投资者公告。

(十三) 集合计划份额的转让、非交易过户和冻结

1、集合计划份额的转让

集合计划存续期间，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，管理人有权单方面制定本集合计划份额的转让方案，无需事先征求投资者的同意。管理人无需就本集合计划份额转让事宜与投资者另行签订协议，或取得投资者书面同意。但管理人应在集合计划份额开始转让前在其网站予以公告。本集合计划份额持有人可根据管理人公告的规定参与转让，但转让后每个投资者持有集合计划份额净值不得少于参与本集合计划的最低金额，投资者合计不超过 200 人，不少于 2 人。受让方应符合本合同约定的合格投资者要求，受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。管理人、交易场所不得通过办理集合资产管理计划的份额转让，公开或变

延期办理。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以实际份额确认日（L 日）前一个工作日（L-1 日）的计划单位净值为基础计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。具体执行方法以管理人公告为准。

2、连续巨额退出的认定和处理方式

(2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

②当集合计划管理人认为连续支付投资者的退出申请确有困难或认为连续支付投资者的退出申请对集合计划的资产净值造成很大波动时，管理人可以暂停接受退出申请。对已经接受的退出申请，可以延缓支付退出款项，退出金额以实际份额确认日（L 日）前一工作日（L-1 日）的集合计划单位净值为基础进行计算，相关事宜通过管理人网站向投资者公告。具体执行方法以管理人公告为准。

(十三) 集合计划份额的转让、非交易过户和冻结

1、集合计划份额的转让

集合计划存续期间，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，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。转让后，持有本集合计划份额的合格投资者人数合计不得超过 200 人。

管理人应当在份额转让前，对受让人的合格投资者身份和本集合计划的投资者人数进行合规性审查。受让人首次参与本集合计划的，应先与管理人、托管人签订资产管理合同。

管理人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。

(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：管理人募集期和存续期均可以以自有资金参与本集合

相公开募集资产管理计划。

(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。

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

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。

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、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

(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。

(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。

6、为应对巨额赎回以解决流动性风险，

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。

8、风险揭示和信息披露

(1) 集合计划管理人按上述约定以自有资金参与集合计划份额, 不构成对其他投资者的本金及收益的保证, 也不能保证其他投资者的本金不受损失。

(2) 管理人自有资金退出, 可能遭遇流动性风险, 从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责, 关注计划规模变动情况, 控制流动性风险。

(3) 管理人自有资金的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投资者和托管行。

十一、资产管理计划的投资

(二) 投资范围及比例

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。另特别提示, 本计划投资范围包括债券正回购和逆回购, 具体如下:

1、投资范围

(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

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。

7、风险揭示

(1) 集合计划管理人按上述约定以自有资金参与集合计划份额, 不构成对其他投资者的本金及收益的保证, 也不能保证其他投资者的本金不受损失。

(2) 管理人自有资金退出, 可能遭遇流动性风险, 从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责, 关注计划规模变动情况, 控制流动性风险。

十一、资产管理计划的投资

(二) 投资范围及比例

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。另特别提示, 本计划投资范围包括债券正回购和逆回购, 具体如下:

1、投资范围

(1) 债权类资产: 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

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公司债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。

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公司债和中小企业私募债券）、债券逆回购、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），资产属性为债权的永续债及可转换债券，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（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、资产支持票据）、固定收益类公开募集证券投资基金、货币市场基金等标准化债权类资产；

（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；

（5）现金。

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）股权类资产和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。

十一、资产管理计划的投资

十一、资产管理计划的投资

<p>(六) 投资策略</p>	<p>(六) 投资策略</p> <p>1、删除第 3 点“风险控制”；</p> <p>2、第 4 点“投资管理的方法和标准”增加：</p> <p>(2) 基金投资策略</p> <p>本集合计划将精选货币市场基金、公开募集证券投资基金进行投资。管理人将从机构资质、收益风险及策略类型等角度对不同的基金产品进行评估、甄选和投资。</p> <p>3、第 4 点“投资管理的方法和标准”第 (4) 项“期货投资策略”第 3) 小项修改为：</p> <p>3) 投资期货的风险控制及责任承担</p> <p>① 风险控制</p> <p>由于期货交易，尤其是期货交易中的投机交易，会涉及对行情的判断，因而存在着较高的市场风险。管理人会对以投机为目的的交易进行严格控制和监管。首先，投机交易规模不得超过管理人有关规定；其次，监控期货的风险敞口，不得超过合同约定范围。</p> <p>② 责任承担</p> <p>管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定，对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，由过错方承担赔偿责任，但管理人可代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。</p> <p>投资者同意并授权管理人可以根据市场情况变化在投资范围内进行策略调整和更新，管理人在调整和更新投资策略时，应遵守法律法规及中国证监会的有关规定。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资</p> <p>(七) 投资限制及禁止行为</p> <p>1、投资限制</p> <p>(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；</p> <p>(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%；</p>	<p>十一、资产管理计划的投资</p> <p>(七) 投资限制及禁止行为</p> <p>1、投资限制</p> <p>(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（如无债项评级，以主体评级为准）；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；</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，其基础资产不得包含</p>

(8) 投资于可转换债券、可交换债券的，不得进行转股；

(八) 集合计划的建仓期

管理人应当自本集合计划成立之日起6个月的建仓期内使本集合计划的投资组合比例符合本集合合同的有关约定。建仓期内的投资活动，应当符合资产管理合同约定的投向和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、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种除外。建仓期结束，本集合计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。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%。上述特定风险指本合同第二十三章风险揭示中“资产管理计划面临的一般风险”中的“投资标的风险”所列情形。

信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权；

(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%；

(9) 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。

(八) 集合计划的建仓期

本集合计划的建仓期为6个月，建仓期的投资活动，应当符合资产管理合同约定的投向和资产管理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、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种除外。建仓期结束，本集合计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

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。

十四、利益冲突及关联交易

(一) 资产管理计划利益冲突的情形及处理方式

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

十四、利益冲突及关联交易

(一) 资产管理计划利益冲突的情形及处理方式

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

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

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)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,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。

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。

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

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)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。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。

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,为本机构、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>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>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。</p>	
---	--

<p>十五、投资经理的指定与变更</p> <p>(二) 本集合计划的投资经理</p> <p>1、姓名、从业简历、学历及兼职情况</p> <p>(1) 姓名：胡莎</p> <p>(2) 从业简历：2014 年加入财信证券股份有限公司，历任固定收益总部研究员；投顾业务部投资助理；固定收益产品投资部投资经理；现任固收配置部投资经理。</p> <p>(3) 学历：南开大学区域经济学硕士。</p> <p>(4) 兼职情况：无。</p> <p>2、投资经理的投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验</p> <p>本集合计划投资经理拥 5 年债券研究和投资经验，对债券市场收益走势、债券品种、利率波动、宏观经济等有深入研究。充分了解债券交易规则和业务流程，积累了丰富的投资交易经验和广泛的市场资源，投资业绩良好。</p>	<p>十五、投资经理的指定与变更</p> <p>(二) 本集合计划的投资经理</p> <p>1、姓名、从业简历、学历及兼职情况</p> <p>(1) 高洁，2016 年加入方正富邦基金管理有限公司，历任债券交易员；宏观与债券研究员；基金经理助理；2020 年加入财信证券股份有限公司，现任资管投资部投资经理。北京大学软件工程硕士，无兼职情况。</p> <p>(2) 刘梦，2016 年加入财信证券股份有限公司，历任固定收益部交易员、投资顾问业务部投资经理助理，现任资管投资部投资经理。北京大学汇丰商学院管理学硕士，无兼职情况。</p> <p>2、投资经理的投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验</p> <p>(1)高洁：拥有 6 年固定收益从业经验，入行开始，坚持撰写超 30 万字债市投资笔记，对债券投资和信用分析具有较为丰富的经验和心得，善于结合宏观、政策、资金等多重因素寻找资产配置机会，投资风格均衡稳健，工作业绩良好。</p> <p>(2) 刘梦：拥有数年的债券交易、债券投资经验，对宏观经济形势、债券收益率走势、债券品种有深入研究，能够捕捉债券市场的投资机会，风格稳健。</p>
<p>十六、资产管理计划的财产</p> <p>(一) 集合计划资产的保管与处分</p>	<p>删除：</p> <p>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>十七、投资指令的发送、确认和执行</p> <p>(四) 托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序</p> <p>托管人发现管理人发送的指令有可能违反本合同约定或有关法律法规的规定时，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；如相关交易已生效，则应通知管理人及时纠正。</p>	<p>十七、投资指令的发送、确认和执行</p> <p>(四) 托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序</p> <p>托管人有充足理由认为管理人发送的指令有可能违反本合同约定或有关法律法规的规定时，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</p>

	<p>（如需），托管人应当拒绝执行。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派出机构及中国证券投资基金业协会报告。</p> <p>对于管理人的有效指令和通知，除非违反本合同约定或有关法律法规的规定或具有本章第（五）项所述错误，托管人不得无故拒绝或拖延执行，否则应就资产管理计划财产或管理人由此产生的损失负赔偿责任。</p>
<p>十八、越权交易的界定</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等进行的投资交易行为；</p> <p>2、法律法规禁止的超买、超卖行为。</p> <p>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。</p> <p>（二）越权交易的处理程序</p> <p>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</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>	<p>十八、越权交易的界定</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。</p> <p>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。</p> <p>（二）越权交易的处理程序</p> <p>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派出机构及中国证券投资基金业协会报告。</p> <p>（三）托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>托管人根据法律法规、本合同的约定等相关规定对管理人的投资行为行使监督权。托管人对集合资产管理计划财产的监督和检查自本集合计划成立之日起开始。</p> <p>托管人对投资范围、投资比例和投资限制的监督内容如下：</p> <p>1、投资范围</p> <p>（1）债权类资产：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</p>

<p>改正并在该期限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。</p> <p>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过错方承担。</p> <p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>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和检查自本集合计划成立之日起开始。</p> <p>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。</p> <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 个工作日内进行调整，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，管理人不由因此而对委托财产的损失承担赔偿责任。</p>	<p>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公司债和中小企业私募债券）、债券逆回购、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），资产属性为债权的永续债及可转换债券、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（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、资产支持票据）、固定收益类公开募集证券投资基金、货币市场基金等标准化债权类资产；</p> <p>(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；</p> <p>(3) 金融衍生品类资产：国债期货；</p> <p>(4) 本集合计划可参与债券正回购业务；</p> <p>(5) 现金。</p> <p>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，资产管理人应履行合同变更程序。</p> <p>2、资产配置比例</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) 股权类资产和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%。</p> <p>3、投资限制</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%。</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%（托管人不对其他托管人托管资产进行监督）。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（如无债项评级，以主体评级为准）；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；

(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%。

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。

（四）越权交易的例外

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

	<p>权交易：</p> <p>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 15 个交易日内将投资比例降至许可范围内。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。</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。</p> <p>3、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，管理人不因此而对委托财产的损失承担赔偿责任。</p>
<p>十九、资产管理计划财产的估值与会计核算</p> <p>（一）集合计划财产的估值</p> <p>3、估值方法：</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</p>	<p>十九、资产管理计划财产的估值与会计核算</p> <p>（一）集合计划财产的估值</p> <p>3、估值方法：</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净价估值；</p> <p>B、交易所上市的可转换债券、可交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；</p> <p>C、交易所市场挂牌转让的资产支持证券</p>

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，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。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

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净价估值；

D、对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的，按照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净价估值；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），按债券回售实施公告约定的回售价格估值。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。

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估值。

B、对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记截止日（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），按债券回售实施公告约定的回售价格估值。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。

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。

4、估值对象：集合计划资产所持有的一切金融资产和金融负债。

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。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。

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、适当、合理的措施确保资产估值的准确

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；如估值技术难以实现的，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。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）投资股权类资产的估值方法

①上市流通股票的估值

A、交易所上市的流通股票，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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，可参考类似投资品种的现行市价、重大变化因素及监管有关规定，调整最近交易市价，确定公允价格。

B、交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

②处于未上市期间的股票应区分如下情况处理：

A、送股、转增股、配股和公开增发的新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

B、首次发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难

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

(1) 资产总值：集合计划资产总值是

以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值。

C、流通受限股票（发行时明确一定期限限售期股票），包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等按以下方法估值：

$$FV = S \times (1 - LoMD)$$

其中：FV：估值日该流通受限股票的价值

S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值

LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣（流动性折扣由第三方估值机构提供）。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 其他资产的估值方法：按照管理人

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。

(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。

(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。

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。

10、特殊情况的处理

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。

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。

(6) 如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

当有充足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，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。

4、估值对象：集合计划资产所持有的一切金融资产和金融负债。

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。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时的，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、估值错误的处理方式：

(1) 估值错误：

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。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。

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。

(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)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；

(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；

(5)中国证监会认定的其他情形。

9、集合计划份额净值的确认

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。

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。

10、特殊情况的处理

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，

	<p>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>
--	---

二十、资产管理计划的费用与税收
(二) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

2、管理费

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：

$$T=E \times 0.5\% \div 365;$$

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

二十、资产管理计划的费用与税收
(二) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

2、管理费

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：

$$T=E \times 0.5\% \div 365;$$

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。

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

律师费、差旅费、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。

(三) 不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用,以及存续期间发生的与募集有关的费用,不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项或不合理事项发生的费用等不列入集合计划费用。

其他不列入集合计划费用的具体项目依据中国证监会有关规定执行。

(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

所持每笔份额的期间年化收益率超过业绩报酬计提基准的部分按一定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;

管理人按照如下标准和方法提取业绩报酬:

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}	$H = M \times (R - r_{i2}) \times \frac{T}{365} \times P_{i2} + M \times (r_{i2} - r_{i1}) \times \frac{T}{365} \times P_{i1}$

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;

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；

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、银行间市

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

因涉及注册登记数据，业绩报酬以管理人提供的数据为准，由管理人复核，托管人配合进行划付。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。

(五) 税收

本合同各方当事人应根据国家有关税收规定，履行纳税义务。投资者投资本计划应缴纳的税收由投资者自行负责，管理人、托管人不承担代扣代缴义务。

场账户维护费、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费等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，投资者不得以任何方式要求管理人向其返还或补偿该等费用。

(三) 不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项或不合理事项发生的费用等不列入集合计划费用。

其他不列入集合计划费用的具体项目依据中国证监会有关规定执行。

(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，并在新的费率开始实施前在管理人指定网站公告。

(五) 税收

本合同各方当事人应根据国家有关税收规定，履行纳税义务。投资者投资本计划应缴纳的税收由投资者自行负责，管理人不承担代扣代缴义务。

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单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

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。

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%。

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。

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；

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。

（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。

（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

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。

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位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

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。

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；

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。

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。

（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。

（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。

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。

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。

二十二、信息披露与报告

(二) 临时报告

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（www.cfzq.com）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：

- 1、集合计划运作过程中，负责集合资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；
- 2、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；
- 3、发生巨额退出并延期支付；
- 4、集合计划终止和清算；
- 5、集合计划存续期满并展期；
- 6、合同的补充、修改与变更；
- 7、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- 8、负责本集合计划的销售机构发生变更；
- 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；
- 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；
- 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；
- 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；
- 13、管理人或托管人变更；
- 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）；
- 15、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；

二十二、信息披露与报告

(二) 临时报告

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（zg.stock.hnchasing.com）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：

- 1、投资经理发生变更；
- 2、以资产管理计划资产从事重大关联交易的；
- 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；
- 4、资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延长清算时间的；
- 5、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事件的；
- 6、管理人认为需要公告的其他事项。

(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投资者和托管行。

(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。

(六) 管理人、托管人应当根据《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》等监管要求履行报告义务，并将向投资者提供的信息披露文件根据相关规定及时报送管理人住所地中国证监会派出机构、中国证券投资基金业协会。如法律法规、监管部门或自律组织对管理人和托管人应履行的信息披露及报告、报备义务另有规定的，从其规定。

<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>（四）管理人、托管人应当根据中国证监会和中国证券投资基金业协会等监管机构的要求履行报告义务，报告的种类、内容、时间和途径应符合上述监管机构的要求。</p>	
<p>二十三、风险揭示</p> <p>（一）资产管理计划面临的一般风险</p> <p>7、投资标的风险</p> <p>（1）投资可转换债券的风险</p> <p>可转债的价格受到证券市场政策、市场利率、公司股票价格、转股价格、赎回条款及回售条款、投资者心理预期、剩余期限等多种因素的影响，其价格波动较为复杂，甚至出现异常波动或与其投资价值严重背离的现象，存在价格波动风险。</p> <p>（2）投资可交换债券的风险</p> <p>1) 可交换债券的收益波动风险</p> <p>可交换债券与标的股票挂钩，其波动因素除利率风险、流动性风险外，还受换股价格、标的股票价格、赎回条款、向下修正条款、投资者的预期等诸多因素的影响。</p> <p>（二）资产管理计划面临的特定风险</p> <p>2、资产管理计划份额转让所涉风险</p> <p>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。</p> <p>（三）其他风险</p> <p>1、集合计划提前终止的风险</p> <p>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。</p> <p>8、使用电子签名合同的风险</p> <p>如本集合计划资产管理合同采用电子</p>	<p>二十三、风险揭示</p> <p>（一）资产管理计划面临的一般风险</p> <p>7、投资标的风险</p> <p>（1）投资股票的风险</p> <p>股票投资面临经济周期风险、政策风险、行业风险、上市公司经营风险等，这些都会导致股票价格发生波动，进而影响本计划的投资收益。此外，本计划在投资管理中可能将维持部分股票投资比例，因此无法完全规避股票市场的下跌风险。投资者须在理性判断的基础上做出投资选择。</p> <p>（2）投资可转换债券的风险</p> <p>1) 价格波动的风险。可转债的价格受到证券市场政策、市场利率、公司股票价格、转股价格、赎回条款及回售条款、投资者心理预期、剩余期限等多种因素的影响，其价格波动较为复杂，甚至出现异常波动或与其投资价值严重背离的现象，存在价格波动风险。</p> <p>2) 提前赎回的风险。大部分可转债都规定了发行者可以在发行一段时之后，以某一价格赎回债券，限定了可转债投资的最高收益率。</p> <p>3) 利息损失风险。当股价下跌到转换价格以下时，可转债投资者被迫转为债券投资者，不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值。因可转债利率一般低于同等级的普通债券利率，所以会给集合计划带来利息损失。</p> <p>（3）投资可交换债券的风险</p> <p>1) 可交换债券的收益波动风险</p> <p>可交换债券与标的股票挂钩，其波动因素除利率风险、流动性风险外，还受换</p>

<p>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。</p> <p>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。</p> <p>10、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 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。</p>	<p>股价格、标的股票价格、赎回条款、向下修正条款、投资者的预期等诸多因素的影响。具有波动风险的收益包括:①持有期间获取利息,持有至到期被发行人以到期赎回价格赎回而获取的赎回收益,或在存续期内被发行人按照债券面值加应计利息赎回而获取的赎回收益;②当标的股票二级市场价格高于换股价时,通过交换股票获取二级市场价格与换股价之间差价;③以高于票面价值转让的收益等。</p> <p>(14) 投资永续债的风险</p> <p>1) 次级风险 永续债的受偿顺序可能在存款人、一般债权人和处于高于债券顺位的次级债务之后,发行人股东持有的所有类别股份之前。发行人如因解散、破产等原因进行清算,本集合计划可能面临由于无法获得全部或部分的债券总金额和当期应付但尚未支付的利息而收益受损的风险。</p> <p>2) 减记损失风险 根据监管要求,永续债可能设置无法生存触发事件下的减记条款。在触发事件发生并获得监管部门批准的前提下,发行人有权在无需获得债券投资者同意的情况下对债券进行减记。由于本集合计划在购买债券时无法预期减记触发事件的发生时间,其实际发生时间可能无法契合本集合计划的实际投资意愿和资金使用计划,本集合计划可能面临收益受损的风险。</p> <p>3) 交易流动性风险 永续债在债券市场可能由于暂时无法找到交易对象而不能及时将债券变现,本集合计划投资永续债可能存在无法随时并足额转让的风险。</p> <p>4) 付息和利息不可累积风险 如果发行人在经营管理中,受到自然环境、经济形势、国家政策和自身管理等有关因素的影响,使其经营效益恶化或流动性不足,可能影响永续债的利息支付。此外,永续债可能采取非累积利息支付方式,即在发行人决议取消部分或</p>
--	--

全部债券利息的情形下，当期末向债券持有人足额派发利息的差额部分不累积至之后的计息期。因此，如发行人在特定年度未能向本集合计划支付或足额支付利息，由于该部分利息无法累积到之后的计息年度，本集合计划将可能面临因利息损失而导致的收益受损风险。

5) 评级风险

在债券存续期内，可能出现由于发行人经营情况变化，导致信用评级机构调整对债券本身或者发行人的信用级别，从而引起债券交易价格波动，存在价格波动风险，可能影响本集合计划的收益实现。

(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。

(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。

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，管理人有权提前终止本集合计划。届时，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委托财产进入清算程序，导致委托财产难以及时退出、财产本金和收益发生损失的风险。

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，不构成管理人对委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，可能导致委托资产的损失，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>
--	---

二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算

(一) 集合计划合同变更的条件和程序

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。

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。

(二) 集合计划的展期

2、展期的程序与期限

(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

二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算

(一) 集合计划合同变更的条件和程序

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；（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。

(二) 集合计划的展期

2、展期的程序

(1) 展期的公告

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。

(2) 投资者答复

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。

(3) 投资者不同意展期的处理办法

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。

3、展期的实现

(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，否则本集合计划不到期终止。

(2) 本集合计划可以连续展期，且展期次数不限。

4、展期的备案

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

期方案。

(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。

3、展期的安排

(1) 通知展期的时间

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。

(2) 通知展期的方式

管理人决定展期的，将在管理人网站进行公告。

(3) 投资者回复的方式

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。

4、投资者不同意展期的处理办法

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。

5、展期的实现

(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

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

增加：

(12) 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；

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。

二十五、违约责任

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

二十五、违约责任

1、第 1 点增加:

(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;

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,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

<p>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。</p>	<p>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。</p>
<p>二十七、资产管理合同的效力 (一) 合同的生效条件 本合同成立后,投资者参与资金实际交付并确认后生效。 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>二十七、资产管理合同的效力 (二) 合同的生效条件 本合同成立后,同时满足以下条件时生效: 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; 2、本集合计划成立; 3、合同变更生效; 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>二十八、其他事项</p>	<p>增加: 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。</p>
<p>附件一:投资者承诺书 本人为机构的,本机构承诺参与资产管理计划的资金为自有资金,没有使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划,且资金来源符合法律法规及监管要求。本机构代表产品投资贵公司发起设立的资产管理产品的,本机构承诺所代表的产品的投资者均符合法律法规规定的合格投资者的认定标准,本机构承诺所代表的产品的最终资金来源符合相关法律法规的要求。 本人/机构同意向管理人或销售机构提供与资金和财产来源、个人及家庭金融资产、负债等情况有关的证明文件。本人/机构承诺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,不存在任何重大遗漏、虚假或误导。管理人或</p>	<p>附件一:投资者承诺书 本人为机构的,本机构承诺参与资产管理计划的资金为自有资金,没有使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划,且资金来源符合法律法规及监管要求。本机构代表私募资产管理产品投资贵公司发起设立的资产管理产品的,本机构承诺所代表的产品的投资者均符合法律法规规定的合格投资者的认定标准且不得为资产管理产品,本机构承诺所代表的产品的最终资金来源符合相关法律法规的要求。 本人/机构同意向管理人或销售机构提供与资金和财产来源、个人及家庭金融资产、负债等情况有关的证明文件。本人/机构承诺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、金融资产情况、投资知识和经验、专业能力以及风险承受能力</p>

<p>销售机构有权要求本人/机构提供资产来源及用途合法性证明,对资产来源及用途及合法性进行调查,本人/机构愿意配合。</p>	<p>等基本情况真实、完整、准确、合法,不存在任何重大遗漏、虚假或误导。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。管理人或销售机构有权要求本人/机构提供资产来源及用途合法性证明,对资产来源及用途及合法性进行调查,本人/机构愿意配合。</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:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26层</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 www.cfzq.com</p>	<p>管理人指定网站、管理人网站变更为 zg.stock.hnchasing.com</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 3 个月定期开放（001 期）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@hnchasing.com