

财富证券财富 6 个月定期开放（001 期）集合资产 管理计划合同变更征询公告

财富证券财富 6 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 1 月 28 日。经管理人与托管人协商一致，现拟对《财富证券财富 6 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》第二十六条“合同的补充、修改与变更”的有关约定，我司已就本次合同变更事宜与托管人中国工商银行股份有限公司深圳市分行达成一致。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。投资者可于本公告日起十个工作日内（不含第十个工作日），即 2023 年 1 月 10 日至 2023 年 1 月 20 日内对本次合同变更做出如下选择：

①投资者不同意本次合同变更的，可在上述期限内提出不同意的意见（需回复附件 2）。对于明确答复不同意合同变更的投资者，需于下一固定开放日（2023 年 1 月 30 日）申请退出本集合计划，未申请退出的，管理人将有权在合同变更确认日（本公告发送后的第十个工作日）次一工作日，即 2023 年 1 月 31 日做强制退出处理（退出金额以实际退出日前一工作日集合计划单位净值为基础进行计算），由此产生的相关费用及或有损失由投资者自行承担；

②不同意本次合同变更且拟于开放日（2023 年 1 月 30 日）申请退出本集合计划的投资者，亦需在上述期限（2023 年 1 月 10 日至 2023 年 1 月 20 日）内提出不同意的意见（需回复附件 2）；

③投资者未在上述期间内明确回复不同意意见的，视为投资者同意合同变更。

二、合同变更的生效

如本次合同变更通过，合同变更的内容将于合同变更确认日次一工作日（即

2023年1月31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》第十三章“集合计划的费用”第(二)节“业绩报酬”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2023年1月30日至2023年7月28日,经管理人审慎考虑,该运作周期的业绩报酬计提基准 r_1 为2.5%/年, r_2 为3.8%/年,提取比例为超过业绩报酬计提基准以上部分 r_1 至 r_2 提取10%, r_2 以上提取60%,具体安排管理人将另行公告。

本集合计划拟于2023年1月30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6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,请您致电本公司资产管理业务客户服务电话咨询,服务电话0731-84403481。

附件1:《资产管理合同》变更条款对照表

附件2:《征询意见函》样本

财信证券股份有限公司

2023年1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 6 个月定期开放(001 期)集合资产管理计划资产管理合同补充协议》、《财富证券财富 6 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 6 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 6 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
<p>二、释义</p>	<p>二、释义 增加: 《个人信息保护法》:指 2021 年 8 月 20 日经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>三、合同当事人 委托人 签订《财富证券财富 6 个月定期开放(001 期)集合资产管理计划资产管理合同》的投资者即为本合同的委托人,委托人的详细情况(包括但不限于名称、通讯地址、联系电话等信息)在电子签名合同数据电文中列示。</p> <p>个人填写: 姓名: 证件类型: 证件号码: 移动电话: 邮政编 码: 联系电话: 传真: 电子信箱: 通信地址:</p> <p>机构填写: 机构名称: 法定代表人: 通信地址: 邮政编码: 联系电话: 传真: 经办人: 移</p>	<p>三、当事人及承诺与声明 (一)合同当事人</p> <p>1、委托人 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/负责人: 住所: 通讯地址: 联系电话: 传真: 电子信箱: 联系人: (特别提示:通讯地址、电子信箱用于接受本集合计划的相关信息;委托人姓名/名称、证件号码及联系电话用于在管理人官网查阅信息披露等相关信息,请</p>

动电话：
电子信箱：
(注：通信地址、电子邮箱用于接受本集合计划的相关信息；委托人名称、证件号码及移动电话用于在管理人官网查阅信息披露等相关信息，请审慎填写)

管理人
机构名称：财信证券股份有限公司
法定代表人：刘宛晨
通讯地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心28楼
邮政编码：410005
联系电话：13261786886
传真：0731-88403367

托管人
机构名称：中国工商银行股份有限公司深圳市分行
法定代表人：董建军
通信地址：深圳市罗湖区深南东路5055号金融中心北座
邮政编码：518000
联系电话：0755-2590300
传真：

审慎填写)
委托人以电子签名方式签订本合同的，委托人的有关情况在电子签名合同数据电文中列示。

2、管理人
名称：财信证券股份有限公司
法定代表人：刘宛晨
住所：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
通讯地址：长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心28层
联系电话：13261786886
联系人：张宇导

3、托管人
托管人名称：中国工商银行股份有限公司深圳市分行
法定代表人/负责人：董建军
住所：深圳市罗湖区深南东路金塘街1号
通讯地址：深圳市罗湖区深南东路5055号金融中心北座
联系电话：0755-89443451
联系人：何映璇

(二) 承诺与声明

1、管理人承诺

(1)在签订本合同前充分向委托人说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险。

(2)已经了解委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对委托人的财务状况进行了充分评估。

(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。

(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。

(5)管理人尊重并保护委托人隐私，在委托人购买本资管计划时，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。请委托人在使用管理人的服务前仔细阅读相关条款，并确认已经充分理解条款全部内容。

管理人承诺对委托人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，管理人会征得委托人同意。

2、托管人承诺

(1) 按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。

(2) 根据法律法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

3、委托人声明

(1) 符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况、金融资产状况、投资知识和经验、专业能力以及风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。管理人已告知未提供或者未按照要求提供信息的后果，本人自愿承担因未提供或者未按照要求提供前述资料可能导致的无法认购或参与本集合计划的后果。

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

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

	<p>投资风险。</p> <p>(4) 委托人同意管理人根据《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委托人提供产品或服务、本产品成立、备案、投资运作需要以及有权机构要求，包括但不限于向委托人提供各类产品和服务及提高产品和服务质量，与委托人进行联络、沟通，了解委托人的需求，建立、复查、维护、发展与委托人的关系，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、履行委托人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，为提升委托人对管理人服务的使用体验、增强管理人的安全机制等目的，使用并处理委托人提供的个人信息，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委托人自身且委托人同意提供超出委托人自身的个人信息，委托人保证其向管理人提供该等超过委托人自身的个人信息前，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、集合计划的基本情况</p> <p>(四) 投资范围和投资比例</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</p>	<p>四、集合计划的基本情况</p> <p>(四) 投资范围和投资比例</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（包括但不限于政策性金融债、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</p>

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)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) 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;

(4) 金融衍生品类资产: 国债期货;

(5) 本集合计划可参与证券正回购业务。

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%; (穿透计算最终投向债权类资产的比例不低于 80%)

(2) 股权类资产、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) 本集合计划参与证券回购融入资金余额不超过集合计划资产净值的 100%。

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。

… …

委托人在此同意,集合计划存续期间内,为规避特定风险,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%。

债券等)、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(包括但不限于私募品种)、证券公司发行的短期公司债券、固定收益类公开募集证券投资基金、货币市场基金、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)等标准化债权类资产以及债券逆回购等形成的资产;

(2) 金融衍生品类资产: 国债期货;

(3) 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;

(4) 现金;

(5) 本集合计划可参与债券正回购业务。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的,资产管理人在履行合同变更程序后,可以将其纳入本计划的投资范围。

2、资产配置比例

(1) 现金及债权类资产: 占本集合计划资产总值的 80-100%;

(2) 股权类资产、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%。

(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,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。

… …

委托人在此同意,集合计划存续期间内,为规避特定风险,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

<p>五、集合计划的参与和退出</p> <p>(二) 集合计划的退出</p> <p>1、退出的办理时间</p> <p>委托人在开放日可以根据本合同约定的方式退出本集合计划。在满足集合计划合同约定自有资金退出条件的情形下,管理人可以自行安排自有资金的退出。</p> <p>本集合计划定期开放。首个固定开放日为自集合计划成立之日起满 6 个月后的第一个工作日,其后每个运作周期满 6 个月后的第一个工作日为固定开放日。例如,本集合计划于 2018 年 8 月 15 日成立,则固定开放日依次为 2019 年 2 月 15 日、2019 年 8 月 15 日……,以此类推。如遇非工作日,则顺延至下一个工作日。管理人有权根据实际情况调整具体开放期并公告。开放期内,委托人可以办理集合计划的退出业务。</p>	<p>比例。</p> <p>五、集合计划的参与和退出</p> <p>(二) 集合计划的退出</p> <p>1、退出的办理时间</p> <p>委托人在开放日可以根据本合同约定的方式退出本集合计划。在满足集合计划合同约定自有资金退出条件的情形下,管理人可以自行安排自有资金的退出。本集合计划定期开放。首个固定开放日为自集合计划成立之日起满 6 个月后的第一个工作日,其后每个运作周期满 6 个月后的第一个工作日为固定开放日。例如,本集合计划于 2018 年 8 月 15 日成立,则固定开放日依次为 2019 年 2 月 15 日、2019 年 8 月 15 日……,以此类推。如遇非工作日,则顺延至下一个工作日。管理人有权根据实际情况调整具体开放期并公告。开放期内,委托人可以办理集合计划的退出业务。</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。收到投资者的申请违约退出的书面文件后,管理人有权为投资者办理份额强制退出,也有权拒绝办理投资者的违约退出申请。违约退出费率参考本合同的退出费率,退出违约金(如有)应当全额归入本集合计划财产。</p>
<p>十二、集合计划的估值</p> <p>(七) 估值方法:</p> <p>在不违反现行法律法规的前提下,管理人按照公平、公允、保护投资者利益的原则选择合适的估值方法,并应就此与托管人达成一致。如国内证券投资会计原则及方法发生变化,由管理人与托管人另行协商确定估值方式。</p> <p>1、投资固定收益品种的估值方法</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</p>	<p>十二、集合计划的估值</p> <p>(七) 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</p>

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。

(3) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且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。

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

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；

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净价估值；

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），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。

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。

(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，采用估值技术确定的公允价值进行估值。

3、存款的估值方法

持有的银行定期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，管理人及时进行账务调整。

4、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。

5、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，以最近一日的当日结算价计算。

6、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。

7、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。

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

<p>8、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。</p> <p>(九) 估值错误与遗漏的处理方式：</p> <p>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。</p> <p>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委托人和集合计划损失的，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委托人的直接损失；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，由此给计划或计划委托人造成的损失，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。</p> <p>3、特殊情形的处理：由于证券交易所或者注册登记机构发送错误数据，或其他不可抗力的原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能正确进行估值，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人不承担责任，但管理人和托管人应当采取积极措施减轻或消除由此造成的影响。估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。</p>	<p>以可靠计量公允价值的前提下，按成本价估值。</p> <p>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）。</p> <p>3、国债期货等标准化商品及金融衍生品类资产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。</p> <p>4、投资资产管理产品的估值方法</p> <p>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；</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
--	--

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

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真实公允反映集合计划相关资产价值的，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。

（九）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：当计划份额资产净值发生错误时，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。如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。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。

3、特殊情形的处理：由于不可抗力原因，或由于证券交易所、登记结算公司或证券经纪商发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但仍未能发现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，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但本管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十三、集合计划的费用

(一) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

1、托管费

本集合计划的年托管费率为 0.02%，每日托管费计算方法如下：

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

T 为每日托管费；

E 为前一日的集合计划资产净值（成立日按当日总份额计提）。

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

2、管理费

本集合计划的年管理费率为 0.5%，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）。

本集合委托资产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、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

十三、集合计划的费用

(一) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

1、托管费

本集合计划的年托管费率为 0.02%，每日托管费计算方法如下：

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

T 为每日托管费；

E 为前一日的集合计划资产净值（成立日按当日总份额计提）。

本集合计划托管费自计划成立之日起，每日计提，逐日累计，按自然季度支付。经管理人和托管人核对后，于每自然季首月的前 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。

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

2、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，按自然季度支付。经管理人和托管人核对后，于每自然季首月的前 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管理费。

委托人同意，管理人可与托管人协商一致调整管理费支付频率和支付时间，并

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、集合计划注册登记费用:集合计划注册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。注册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、会计师费和律师费、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。

在管理人官网公告。

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

4、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。

5、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。

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

与集合计划运营有关的其他费用,如果金额较小,或者无法对应到相应会计期间,可以一次进入集合计划费用;如果金额较大,并且可以对应到相应会计期间,应在该会计期间内按直线法摊销。

上述计划费用中第3至6项费用由管理

	<p>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。</p> <p>以上所列费用如需管理人以固有财产先行垫付的，管理人有权从本集合计划资产中优先受偿，投资者不以任何方式要求管理人向其返还或补偿该等费用。</p>
<p>十三、集合计划的费用</p> <p>(二) 业绩报酬</p> <p>1、业绩报酬的计提时间</p> <p>业绩报酬计提基准日为集合计划退出日、分红权益登记日或集合计划终止日。若业绩报酬计提基准日为集合计划退出日或分红权益登记日，则业绩报酬计提日为基准日当日；若业绩报酬计提基准日为集合计划终止日，则业绩报酬计提日以管理人清算方案为准。</p> <p>业绩报酬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。</p> <p>本集合计划仅在本集合计划单位净值符合本款第2点所述条件时收取业绩报酬。</p> <p>2、业绩报酬计提方法</p> <p>在业绩报酬计提日，集合计划委托人所持每笔份额在持有期的年化收益率大于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持有期间的年化收益率（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。</p> <p>持有期间的年化收益率R计算如下：</p> $R = \frac{A - B}{B'} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ <p>A为本业绩报酬计提基准日的累计单位净值；</p> <p>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，推广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）；</p> <p>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，推广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）；</p>	<p>十三、集合计划的费用</p> <p>(二) 业绩报酬</p> <p>1、业绩报酬的计提原则</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>2、业绩报酬计提方法</p> <p>当投资者申请退出本集合计划，或本集合计划分红、终止清算时，管理人根据以下条款计算并计提业绩报酬。</p> <p>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</p>

T 表示该笔份额在每个运作周期的持有期天数；

本集合计划每个运作周期的业绩报酬计提基准会有所不同，第 i 个运作周期业绩报酬计提基准 (r_i) 会在该运作周期开始的开放日前在管理人网站公布。其中，第 1 个运作周期的业绩报酬计提基准 (r_1) 会以推广期公告的形式在管理人网站公布。当 $R > r_i$ 时，管理人提取 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，管理人不提取业绩报酬。

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

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，推广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；

已提取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。

若业绩报酬计提基准日为本集合计划的分红权益登记日，则由管理人按上述方法计算应计提的业绩报酬金额，然后在分红时从分红金额中扣除业绩报酬；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本集合计划的退出日，则由管理人按上述方法计算应计提的业绩报酬金额，在委托人退出时扣除。

3、业绩报酬的提取程序

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

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 表示该笔份额在本次业绩报酬核算期内的持有期天数；

管理人按照如下标准和方法计算每个业绩报酬核算期间的管理人业绩报酬：

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

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

P_{i1} 和 P_{i2} 不得超过 60%。

其中：

H 为该笔份额在本次业绩报酬核算期间

<p>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。</p>	<p>应计提的业绩报酬 $M = \text{该笔份额数} \times \text{该笔份额上一个业绩报酬核算日的单位净值}$（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； 业绩报酬计提基准的调整周期不得短于两次开放期的间隔时间。 已计提的业绩报酬无回拨机制。业绩报酬的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入集合计划资产。 3、业绩报酬的提取程序 业绩报酬在集合计划业绩报酬计提日计提，因涉及份额登记数据，由管理人负责计算并以管理人的计算结果为准。 由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据划付指令从集合计划资产中将计提的业绩报酬一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</p>
--	--

<p>十四、集合计划的收益分配</p> <p>（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。</p> <p>（二）收益分配原则</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、同一类份额享有同等分配权； 2、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配； 3、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； 4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担； 5、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条件和时间进行调整，并在管理人网站上公告。 <p>（三）收益分配对象 分红权益登记日所有持有当期集合计</p>	<p>十四、集合计划的收益分配</p> <p>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。</p> <p>（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。</p> <p>（二）收益分配原则</p> <ol style="list-style-type: none"> 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委托人。
---	--

划份额的委托人。

(四) 收益分配时间

1、分红权益登记日即收益分配基准日，为集合计划每个固定开放期的第一个工作日。收益分配款项将于分红除权除息日起 T+2 个工作日内划出托管账户。

2、在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，本集合计划将于每个固定开放期的第一个工作日进行收益分配，分配比例为收益的 100%。

管理人有权调整收益分配时间和频率，并在管理人网站上公告。

(六) 收益分配方式

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。

(七) 收益分配方案的确定与披露

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，由管理人向委托人披露。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。

4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；

在符合上述原则和具备收益分配条件的前提下，本集合计划原则上每个固定开放期进行收益分配。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。

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，并在管理人网站上公告。

(四) 收益分配的执行方式

本集合计划的分红方式原则上为现金分红，现金分红保留到小数点后两位，由小数点保留所产生的尾差由集合计划承担。

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。

委托人和托管人同意，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。

十五、投资理念与投资策略

3、期货投资策略

(1) 本集合计划投资于国债期货的目的有套期保值、投机、套利。

(2) 期货保证金的流动性应急处理机制

① 应急触发条件

管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人没有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自己减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。

② 保证金补充机制

管理人收到追保及强平通知，确认是否

十五、投资理念与投资策略

3、期货投资策略

(1) 本集合计划投资于期货的目的有套期保值、投机、套利。

本集合计划参与国债期货的主要目的是套期保值和套利，在控制风险的前提下也会进行少量的投机交易，以期更好地提高产品收益。管理人将根据不同的市场行情动态管理国债期货合约数量，力争在控制风险的前提下萃取收益。

(2) 期货保证金的流动性应急处理机制

1) 应急触发条件

管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人未有足够的现金资产及

<p>追加保证金或减仓。如管理人经过内部决策选择减仓，则在减仓操作完成后，及时通知托管人；如选择追加保证金，管理人应立即向托管人发送指令，托管人在有足够执行时间的前提下最迟应当在下一交易日下午两点前追加保证金到位。</p> <p>③ 损失责任承担等</p> <p>管理人所持有某种期货合约的持仓总量超出交易规则的相应限制时，可能会被交易所强行平仓并罚没盈利。因管理人操作失误的原因造成的保证金管理风险，由管理人承担。</p> <p>(3) 期货投资责任承担</p> <p>管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本集合合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定，因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿损失。对于其他相关方的原因给委托人造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但可代表集合计划委托人的利益向过错方追偿。委托人同意并确认：有关国债期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议(如有)为准。</p>	<p>时追加保证金到位或预计难以按要自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。</p> <p>2) 保证金补充机制</p> <p>如出现保证金不足的情况时，管理人将首先运用集合计划资产从市场上拆借资金；如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现集合计划资产，变现时应重点考虑变现资产的流动性，以最大限度的降低损失。</p> <p>3) 损失责任承担等</p> <p>管理人不承担委托资产的变现损失及未及时追加保证金的损失(包括穿仓损失)。对于其他相关方的原因给委托人造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划委托人的利益向过错方追偿。</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委托人造成的损失，由过错方承担赔偿责任，但管理人可代表集合计划委托人的利益向过错方追偿。</p>
<p>十六、投资决策与风险控制</p> <p>(二) 集合计划的投资程序</p> <p>1、投资研究：通过对投资品种进行严格的筛选后，然后将精选的备选品种报投资决策小组审议通过，由投资主办人对产品进行跟踪研究。</p> <p>2、投资决策：投资决策流程为“董事会-总裁办公会议-投资决策小组-投资经理”四级决策体制。董事会是公司资产管理业务投资决策的最高决策机构，授权总裁办公会议审议资产管理业务</p>	<p>十六、投资决策与风险控制</p> <p>(二) 集合计划的决策程序</p> <p>1、投资研究：通过对投资品种进行严格的筛选后，将精选的备选品种报投资决策小组审议通过，由投资经理对产品进行跟踪研究。</p> <p>2、投资决策：投资决策流程为“董事会-总裁办公会议-资产管理业务投资决策小组(以下简称投资决策小组)-投资经理”四级决策体制。</p>

<p>投资决策小组成员的任免及业务的实施。公司总裁办公会议负责确定公司资产管理业务的发展战略和总体目标；对公司资产管理业务相关的重大事项进行决策；根据相关监管指标和风控指标等，在董事会授权范围内，确定自有资金参与额度及风险限额等风控指标；审议资产管理业务投资决策小组成员的任免及业务的实施；审议投资决策小组投资情况汇报。投资决策小组负责资管产品的日常投资决策，主要职责是确定投资理念、投资原则和投资决策的流程、确定风险控制和绩效评估的原则和办法、审议投资报告和投资方案、确定资产配置、确定产品投资主办人、确定投资授权范围、向公司总裁办公会议汇报投资情况及执行公司总裁办公会议下达的风控指标。投资经理的主要职责是投资组合方案的策划和制订，并根据经投资决策小组审定的投资方案组织实施投资。</p> <p>3、投资实施：投资主办人在投资决策小组审定的投资方案的基础上，深度分析或结合实地调研情况，甄别、确定计划资产的具体投资品种，构建证券投资组合，提出具体的类别资产配置策略和投资计划，制定投资指令，在授权范围内对投资进行调整，对于超出授权范围的投资计划，提交投资决策小组审议。</p> <p>4、投资交易：管理人设置独立的交易室，交易员根据投资主办人下达的投资指令，执行相应的投资交易，反馈执行情况。</p> <p>5、风险评估：风控专员对投资组合进行风险评估，并提出风险控制意见。</p> <p>6、评估和调整决策程序：集合计划管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。</p>	<p>3、投资实施：投资经理在投资决策小组审定的投资方案的基础上，深度分析或结合实地调研情况，甄别、确定计划资产的具体投资品种，构建证券投资组合，提出具体的类别资产配置策略和投资计划，制定投资指令，在授权范围内对投资进行调整。</p> <p>4、投资交易：管理人设置独立的交易室，交易员根据投资经理下达的投资指令，执行相应的投资交易，反馈执行情况。</p> <p>5、风险评估：风控相关人员对投资事项进行风险评估。</p> <p>6、评估和调整决策程序：集合计划管理人有权根据环境的变化和实际的需要调整决策的程序。</p>
<p>十六、投资决策与风险控制 (三) 风险控制 1、内部风险工作 (1) 风险控制原则 ① 全面性原则：内部风险控制覆盖了资产管理业务的所有相关部门和岗位，</p>	<p>十六、投资决策与风险控制 删除 (三) 风险控制</p>

并渗透到决策、执行、监督、反馈等各项业务过程和业务环节。

② 全员性原则：员工是风险控制的基础及第一人，风险控制涵盖了与资产管理业务相关全体员工，不断提高员工对风险的识别和防范能力，树立全员风险意识。

③ 独立性原则：管理人设立风险控制委员会及风险管理部，资产管理部内部设立风控专员，上述各风险控制机构和人员具有并保持独立性和权威性，负责对公司资产管理业务及资产管理部内部风险控制制度的执行进行监察稽核和检查。

④ 适时有效原则：在保证所有风险控制措施切实有效的基础上，资产管理业务内部控制制度的制定具有前瞻性，并且随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境和国家法律法规、市场变化等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。

⑤ 信息隔离墙原则：公司客户委托资产、自有资产和其他资产的运作严格分离，资产管理业务投资、决策、执行、清算等部门和岗位适当隔离。

⑥ 定性和定量相结合原则：依据风险控制与管理的复杂性，在实施资产管理业务的风险控制时，建立与完善风险识别与度量的指标体系、模型。用定性与定量相结合的方法提高风险控制方法与手段的科学性、先进性。

（2）风险控制组织结构

管理人建立了“董事会及其风险控制委员会、监事会-公司经理层-风险管理部—资产管理部”的四级风险管理组织架构。

① 董事会及其风险控制委员会、监事会

董事会是公司风险管理的最高决策机构，对公司全面风险管理的有效性承担最终责任。董事会下设风险控制委员会按照公司章程和议事规则的相关规定，为董事会审议的风险管理相关事项提供评估意见和建议，在董事会授权范围

内履行和协助董事会履行职责。监事会承担全面风险管理的监督责任,负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

②公司经理层

公司经理层对公司风险管理的有效性承担主要责任。公司任命一名高级管理人员作为首席风险官负责组织落实公司全面风险管理的具体工作,首席风险官由董事会聘任和解聘。公司保障首席风险官的独立性,对首席风险官履职提供充分保障。

③风险管理部

公司风险管理部门在首席风险官领导下推动全面风险管理工作,监测、评估、报告公司整体风险水平,并为业务决策提供,风险管理建议,协助、指导和检查各部门、分支机构的风险管理工作,是公司风险管理政策及基本制度的具体执行部门。负责对公司集合资产管理业务开展独立的日常风险监控工作,实时监控、识别和分析,提出风险预警报告。对风险控制制度的建立和落实情况进行检查,检查本集合计划的内部操作风险,并对集合资产管理业务的风险控制制度的合理性、有效性进行分析,提出改进意见。

④资产管理部

资产管理部主要负责集合资产管理业务投资风险的控制,通过建立完善的风险预警系统,运用量化指标实现投资的全过程监控,确保投资决策在执行过程中的风险得到有效控制,并定期向公司风险管理部汇报。

(3) 风险控制管理制度

为加强风险管理,管理人制订了一系列涉及风险管理的制度:《财富证券有限责任公司全面风险管理办法》、《财富证券有限责任公司合规管理办法》、《财富证券有限责任公司风险监控平台管理办法》、《财富证券有限责任公司风险控制指标管理办法》、《财富证券有限责任公司反洗钱和反恐怖融资内部控制制度》、《财富证券有限责任公司

资产管理业务风险管理制度》、《财富证券有限责任公司资产管理业务信息隔离墙管理制度》、《财富证券有限责任公司资产管理业务利益冲突防范制度》、《资产管理业务风险控制操作手册》等。

(4) 风险控制的流程与措施

①管理人风险管理部和资产管理部风控专员通过实时监控系统,全方位监控资产管理业务的风险,并将有关情况通报资产管理部及公司经营管理层面。资产管理部对风险管理部的监控报告和处理建议及时予以反馈。

②根据法律法规和监管要求,通过管理人风险管理部的集中监控系统,在监控系统中设置相应的风险监控值,通过系统的预警触发装置,自动显示资产管理业务风险的动态变化,提高动态监控效率。

③提高资产管理业务运作的透明度,资产管理交易系统、公司风险监控平台设置必要的开放功能或数据接口,以便监管部门及时了解和检查公司资产管理业务情况。

④建立健全资产管理业务风险监控缺陷的纠正与处理机制,由管理人风险管理部根据资产管理业务风险监控的检查情况和评估结果,提出整改意见和纠正措施,并对落实情况进行跟踪检查。

⑤定期对风险控制过程中业务人员的工作效果进行评价和总结,以进一步完善内部控制措施。

⑥对资产管理业务不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易进行监控,并定期向中国证券投资基金业协会报告并抄送公司所在地中国证监会派出机构。

(5) 投资期货的风险控制

①公司已经建立了完备的业务运作系统支持系统,包括估值、交易、清算等,从系统上保证期货投资的持续、稳定运行。

为避免期货交易的损失金额超过委托资产的风险承受能力,针对市场风险具

有以下措施：一是交易限额规定，包括合约价值限额的设立等；二是风险衡量及监控，包括对期货合约规模、保证金变化、亏损等进行动态预测与监管；三是制定止损处理机制，例如一旦期货头寸亏损超过确定的目标，必须强制平仓，避免出现严重的风险事件。

保证金管理有以下措施：为避免期货交易因保证金不足而引发的强制平仓所造成的损失，定期制定和调整委托资产参与期货交易可使用的保证金额度和保证金比率预警水平；若因突发事件导致市场剧烈波动，指数快速向已建立的期货敞口不利方向运行，在保证金比率达到预警水平或收到期货公司保证金追加通知后，应启动保证金流动性应急处理机制。

②建立有效的内部稽核制度，识别内部控制中的弱点和系统中的不足，提供改进的建议。

③经常重新评估，审定风险管理政策、流程。

2、外部风险监督

本集合计划在实行严格的内部风险控制的同时，也接受管理人以外的合作机构、监管机构的监督。

（1）托管人的监督

托管人监督管理人对本集合计划的投资运作，发现管理人违反法律、法规和本合同的约定进行投资的，托管人有权对违反法律、法规和本合同约定的投资和资金清算指令不予执行，或采取有效措施防止损失扩大，并及时向委托人通报、向监管机构报告。

（2）上级监管机构的监管

中国证监会及其派出机构、中国证券投资基金业协会等监管机构将对本集合计划募集、交易、投资运作以及相关的业务活动和财务会计资料进行定期或不定期的现场检查、稽核，并要求管理人和托管人就集合计划运作中遇到重大问题作专项报告。

3、管理人关于风险控制的说明

本管理人承诺以上关于风险控制的披

<p>露真实准确。 本管理人承诺不断完善风险控制制度。 本管理人承诺及时配合外部风险监管工作。</p>	
<p>十七章、投资限制及禁止行为 (一) 投资限制 为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为： 1、本集合计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。 2、本集合计划总资产/净资产不得超过200%，计算总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。 3、本集合资产管理计划投资于同一资产的资金，按照穿透原则不得超过本集合计划资产净值的25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。 4、本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过集合计划资产净值的20%。 5、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。 6、投资于国债期货的合约价值不超过本集合计划资产总值的20%。 中国证监会另有规定的除外。 如因一级市场申购发生投资比例超限，应自申购证券可出售、可转让或者恢复交易之日起15个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素，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个交易日内将投资比例降至许可范围内。 如因证券期货市场波动、资产管理计划</p>	<p>十七章、投资限制及禁止行为 (一) 投资限制 为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为： 1、本集合计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。 2、本集合计划总资产/净资产不得超过200%，计算总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。 3、本集合资产管理计划投资于同一资产的资金，按照穿透原则不得超过本集合计划资产净值的25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。 4、本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过集合计划资产净值的20%。 5、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。 6、投资于国债期货的合约价值不超过本集合计划资产总值的20%。 7、本集合计划不得投资于资产支持证券和资产支持票据的劣后级，投资于资产支持证券和资产支持票据优先级的公开债项评级应为AA级（含）以上（如无债项评级，则以主体评级为准）。 8、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。 中国证监会另有规定的除外。 如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的</p>

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。

因素,造成集合计划投资不符合限制内容的,管理人应在不符合事项发生之日起在具备交易条件的 15 个交易日内将投资比例降至许可范围内。

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。

二十一章、集合计划终止和清算

(一)有下列情形之一的,集合计划应当终止:

- 1、资产管理计划存续期届满且不展期;
- 2、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,且在六个月内没有新的管理人承接;
- 3、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,且在六个月内没有新的托管人承接;
- 4、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的;
- 5、集合资产管理计划存续期间,持续五个工作日投资者少于二人;
- 6、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委托人后本集合计划可提前终止;
- 7、本计划资产投资品种的交易对手在管理、运用、处分相关财产的过程中,发生违约、担保人违约或投资品种所涉其他法律关系的当事人违约,管理人认为有必要提前终止的;
- 8、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;
- 9、若因政策变动或者相关监管机构认为本集合计划约定内容不适当而导致备案不通过或者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;

二十一章、集合计划终止和清算

(一)有下列情形之一的,集合计划应当终止:

- 1、资产管理计划存续期届满且不展期;
- 2、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,且在六个月内没有新的管理人承接;
- 3、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,且在六个月内没有新的托管人承接;
- 4、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的;
- 5、集合资产管理计划存续期间,持续五个工作日投资者少于二人;
- 6、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委托人后本集合计划可提前终止;
- 7、本计划资产投资品种的交易对手在管理、运用、处分相关财产的过程中,发生违约、担保人违约或投资品种所涉其他法律关系的当事人违约,管理人认为有必要提前终止的;
- 8、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;
- 9、若因政策变动或者相关监管机构认为本集合计划约定内容不适当而导致备案不通过或者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>10、本集合计划单位净值小于 0.9000 时；</p> <p>11、发生资产管理合同约定的或法律、行政法规及中国证监会规定的其他应当终止的情形。</p> <p>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，并抄报管理人住所地中国证监会派出机构。</p>	<p>10、本集合计划单位净值小于 0.9000 时；</p> <p>11、本集合计划总份额低于 3000 万时，管理人有权（但并非必须）终止本集合计划；</p> <p>12、发生资产管理合同约定的或法律、行政法规及中国证监会规定的其他应当终止的情形。</p> <p>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，并抄报管理人住所地中国证监会派出机构。</p>
<p>二十二、当事人的权利和义务</p> <p>（一）委托人的权利和义务</p> <p>1、委托人的权利</p> <p>（1）取得集合计划收益；</p> <p>（2）通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；</p> <p>（3）按照本合同及《计划说明书》的约定，参与和退出集合计划；</p> <p>（4）按持有份额的数量和种类根据本合同的约定取得集合计划清算后的剩余资产；</p> <p>（5）因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；</p> <p>（6）法律、行政法规、中国证监会的有关规定以及合同约定的其他权利。</p>	<p>二十二、当事人的权利和义务</p> <p>（一）委托人的权利和义务</p> <p>1、委托人的权利</p> <p>（1）取得集合计划收益；</p> <p>（2）通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；</p> <p>（3）按照本合同及《计划说明书》的约定，参与和退出集合计划；</p> <p>（4）按持有份额的数量和种类根据本合同的约定取得集合计划清算后的剩余资产；</p> <p>（5）因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；</p> <p>（6）《个人信息保护法》规定的个人信息处理活动中的权利，包括但不限于知情权、决定权、查阅、复制、请求转移、更正、补充、删除、撤回同意等，权利行使方式以管理人《个人信息处理规则》为准；</p> <p>（7）法律、行政法规、中国证监会的有关规定以及合同约定的其他权利。</p>
<p>十八、集合计划的信息披露</p> <p>（三）通知与送达</p> <p>3、委托人将随时保持电话等联络方式的畅通，随时查看管理人发出的传真、电子邮件、短信及公告信息，如因委托人怠于履行查看义务或提供的联络方式发生变动且未及时变更的，由此产生的责任和风险由委托人自行承担。</p> <p>管理人应当根据监管要求将向投资者提供的信息披露文件，及时报送管理人</p>	<p>十八、集合计划的信息披露</p> <p>（三）通知与送达</p> <p>3、委托人将随时保持电话等联络方式的畅通，随时查看管理人发出的传真、电子邮件、短信及公告信息，如因委托人怠于履行查看义务或提供的联络方式发生变动且未及时变更的，由此产生的责任和风险由委托人自行承担。</p> <p>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</p>

<p>住所地中国证监会派出机构、中国证券投资基金业协会。</p>	<p>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>
	<p>二十四、风险揭示</p> <p>(十) 其他风险</p> <p>增加:</p> <p>9、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委托人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。对于委托人而言，需在谨慎考虑后再向管理人提供敏感个人信息。</p> <p>10、集合计划提前终止的风险</p> <p>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。提请委托人特别注意，如果本集合计划存续期间总份额低于规模下限，管理人有权提前终止本集合计划。届时，委托人（特别是新参与的委托人）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</p>

<p>二十六、合同的补充、修改与变更</p> <p>1、本合同签署后，以下情况可由管理人和托管人协商一致后对本合同作出修改：</p> <p>（1）因法律、法规、规章、中国证监会的规定、注册登记机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，而应当对本合同进行的修改；</p> <p>（2）本合同的修改对委托人利益无实质性不利影响或修改不涉及本计划当事人权利义务关系；</p> <p>（3）管理人与托管人之间指令、清算交收规则的变更；</p> <p>（4）按照法律法规或本合同规定，资产管理人有权变更本合同的其他情形。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及计划说明书按照上述内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站（www.cfzq.com）公告满5个工作日后生效，无需另行征得委托人同意。</p> <p>本集合计划成立后，相关材料需要报相关监管机构或自律组织等备案。管理人按照监管机构或自律组织等的要求补正备案材料涉及到本合同修改的，委托人特此授权管理人经与托管人协商一致后，由管理人公告补正后的合同，补正的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效。</p> <p>2、由于管理人变更、托管人变更或其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以管理人指定网站公告或邮寄等方式向委托人发送合同变更征询意见函。委托人需于征询意见函发出后的十个工作日内（不含第十个工作日）回复同意或不同意的意见。委托人不同意变更的，应在征询意见函发出后的十个工作日内（不含第十个工作日）提出不同意的意见或退出本集合计划；委托人未在前</p>	<p>险。</p> <p>二十六、合同的补充、修改与变更</p> <p>1、委托人同意，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）本合同的修改对委托人利益无实质性不利影响或修改不涉及本计划委托人权利义务关系；</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。委托人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，无需另行征得委托人同意。委托人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>2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以管理人指定网站公告或书面等方式向委托人发送合同变更征询意见函。</p> <p>①委托人不同意变更的，应在征询意见函规定期间内退出本集合计划。</p> <p>②委托人未在规定的期间内回复意见也未退出集合计划的，则委托人已以行为表明其同意公告中载明的全部变更事项。</p> <p>③对于明确答复不同意合同变更但在规定期限内仍未退出本集合计划的委托人，管理人将有权在规定期限届满后将相关份额做强制退出处理（以实际退出</p>
--	---

述时间回复意见也未退出集合计划的，视为委托人同意合同变更。在征询意见函发送后的第九个工作日终（以下简称“合同变更登记日”）持有三分之二以上集合计划份额的委托人已表决同意和视为同意合同变更的，合同变更方可通过。管理人于征询意见函发送后的第十个工作日（以下简称“合同变更确认日”）在管理人网站公告合同变更是否通过。若合同变更通过、且部分委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

委托人不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；对于明确答复不同意合同变更但在合同变更确认日仍未退出本集合计划的委托人，管理人将统一在合同变更确认日次一工作日做强制退出处理（退出金额以实际退出日前一工作日集合单位净值为基础进行计算）。

委托人同意，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并在合同变更登记日持有三分之二以上集合计划份额的委托人已表决同意和视为同意合同变更后变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

经上述合同变更程序通过后，合同变更于合同变更确认日次一工作日起生效，公告内容即成为本合同组成部分。管理人应在合同变更生效日起5个工作日内报中国证券投资基金业协会备案，并抄报管理人住所地中国证监会派出机构。

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委托人自行承担。

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

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

3、管理人应在合同变更之日起5个工作日内报中国证券投资基金业协会备案。

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

附件 2:《征询意见函》样本

财信证券股份有限公司:

本委托人确认,已充分阅读并理解《财富证券财富 6 个月定期开放(001 期)集合资产管理计划合同变更征询公告》及其附件的相关内容,承诺自行承担投资风险和损失。

本委托人 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: _____

委托人(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@hncasing.com