
财信证券周周鑫 2 号集合资产管理计划

合同变更征询及生效公告

财信证券周周鑫 2 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）成立于 2021 年 5 月 21 日，经管理人与托管人协商一致，现拟对《财信证券周周鑫 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）的相关条款进行变更，相关条款的具体修改详见附件 1，本次合同变更未改变本集合计划的风险等级。

一、合同变更的程序

根据《资产管理合同》第二十五章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”的有关约定，我司已就本次合同变更事宜与托管人兴业银行股份有限公司达成一致。同时，管理人按照《资产管理合同》约定，对不同意见变更的投资者，管理人保障其退出集合计划的权利。投资者可于征询意见期，即 2023 年 3 月 7 日至 2023 年 3 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 2023 年 3 月 13 日）的交易时间内退出本集合计划。

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

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

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

二、合同变更的生效

本次合同变更的内容将于征询意见期限届满的次一工作日（即 2023 年 3 月

14日)生效，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

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

附件 1: 《资产管理合同》变更条款对照表

附件 2: 《征询意见函》样本

财信证券股份有限公司

2023 年 3 月 7 日

附件 1：《资产管理合同》变更条款对照表

（本附件仅列举关键变更条款，详情请参考《财信证券周周鑫 2 号集合资产管理计划资产管理合同（更新）》、《财信证券周周鑫 2 号集合资产管理计划说明书》、《财信证券周周鑫 2 号集合资产管理计划风险揭示书》。

《财信证券周周鑫 2 号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>《管理办法》：指 2018 年 10 月 22 日经中国证券监督管理委员会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》。</p> <p>《运作规定》：指 2018 年 10 月 22 日经中国证券监督管理委员会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》。</p>	<p>二、释义</p> <p>《管理办法》：指 2023 年 1 月 13 日经中国证券监督管理委员会发布并于 2023 年 3 月 1 日施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》。</p> <p>《运作规定》：指 2023 年 1 月 13 日经中国证券监督管理委员会发布并于 2023 年 3 月 1 日施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》。</p> <p>新增：</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</p>

	<p>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>《期货和衍生品法》：指2022年4月20日经第十三届全国人民代表大会常务委员会第三十四次会议通过的《中华人民共和国期货和衍生品法》。</p> <p>《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>投资者指定账户/指定账户：指投资者参与本资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户。</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>三、承诺与声明 (一) 管理人承诺</p> <p>新增：</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>三、承诺与声明 (三) 投资者声明</p> <p>新增：</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</p>

	<p>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 (二) 当事人权利义务 1、投资者的权利义务 (1) 投资者的权利 6) 法律法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。</p>	<p>四、当事人及权利义务 (二) 当事人权利义务 1、投资者的权利义务 (1) 投资者的权利 6) 《个人信息保护法》规定的个人信息处理活动中的权利，包括但不限于知情权、决定权、查阅、复制、请求转移、更正、补充、删除、撤回同意等，权利行使方式以管理人《个人信息处理规则》为准； 7) 法律法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。</p>
<p>四、当事人及权利义务 (二) 当事人权利义务 2、管理人的权利义务</p>	<p>四、当事人及权利义务 (二) 当事人权利义务 2、管理人的权利义务 新增：</p>

	<p>27) 保证向投资者支付的受托资金及收益(如有)返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户;</p> <p>28) 除必要的信息披露及监管要求外,管理人不得以托管人的名义进行营销宣传;</p>
<p>六、资产管理计划的募集</p> <p>(六) 募集账户</p> <p>本集合计划募集账户信息如下: 户名: 财信证券有限责任公司 账号: 4305 0179 4936 0966 6888 开户银行: 中国建设银行股份有限公司长沙车站北路支行</p>	<p>六、资产管理计划的募集</p> <p>(六) 募集账户</p> <p>本集合计划募集账户信息如下: 户名: 财信证券股份有限公司 账号: 4305 0179 4936 0966 6888 开户银行: 中国建设银行股份有限公司长沙车站北路支行</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>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>(二) 参与和退出的时间</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。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。</p>
<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p> <p>(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>2、 集合计划参与和退出的程序及确认</p> <p>(1) 参与的程序与确认</p> <p>④ 投资者参与申请确认成功后,其参与申请和参与资金不得撤销;当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销。</p>	<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p> <p>(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>2、 集合计划参与和退出的程序及确认</p> <p>(1) 参与的程序与确认</p> <p>④ 销售机构在T日的规定时间内受理投资者申请,管理人在收到投资者参与申请的T+1日内对该交易的有效性进行确认,投资者参与申请确认成功后,其参与申请和参与资金不得撤销;当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销,具体以管理人和销售机构业务办理规则为准。</p>
<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p> <p>(十二) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式</p> <p>1、 发生下列情形时,集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划投资者的参与申请:</p>	<p>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>1、 发生下列情形时,集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划投资者的参与申请:</p> <p>(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法</p>

<p>(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；</p> <p>(2) 存续期内，本集合计划投资者人数或规模接近或达到合同约定的最高规模上限（如有）；</p> <p>(3) 集合计划管理人、集合计划托管人或份额登记机构的技术保障或人员支持等不充分；</p> <p>(4) 发生集合资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况；</p> <p>(5) 其他可能对本集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有投资者利益的情形；</p> <p>(6) 证券交易所交易时间非正常停市、登记结算机构或银行结算系统无法正常运行等导致当日集合计划资产净值无法计算；</p> <p>(7) 管理人和销售机构知道投资者身份不真实、委托资金来源不合法或者对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；</p> <p>(8) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有投资者利益时；</p> <p>(9) 法律法规、中国证监会规定或本合同认定的其它可拒绝或暂停参与的情形。</p> <p>发生上述(1)-(6)、(9)项暂停或拒绝参与的情形时，管理人应通过管理人网站及时公告。投资者的参与申请被拒绝时，被拒绝的参与款项将无息退还给投资者，各方互不承担其他责任。</p>	<p>正常运作；</p> <p>(2) 集合计划管理人、集合计划托管人或份额登记机构的技术保障或人员支持等不充分；</p> <p>(3) 发生集合资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况；</p> <p>(4) 其他可能对本集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有投资者利益的情形；</p> <p>(5) 证券交易所交易时间非正常停市、登记结算机构或银行结算系统无法正常运行等导致当日集合计划资产净值无法计算；</p> <p>(6) 存续期内，本集合计划投资者人数或规模接近或达到合同约定的最高规模上限（如有）；</p> <p>(7) 管理人和销售机构知道投资者身份不真实、参与资金来源不合法或者对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；</p> <p>(8) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害现有投资者利益时；</p> <p>(9) 法律法规、中国证监会规定或本合同认定的其它可拒绝或暂停参与的情形。</p> <p>发生上述(1)-(5)、(9)项暂停或拒绝参与的情形时，管理人应通过管理人网站及时公告。投资者的参与申请被拒绝时，被拒绝的参与款项将无息退还给投资者，各方互不承担其他责任。</p>
---	--

<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p> <p>(十三) 集合计划份额的转让、非交易过户和冻结</p> <p>1、集合计划份额的转让</p> <p>集合计划存续期间，在具备可交易条件时，经投资者、管理人、托管人三方协商一致，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</p>	<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p> <p>(十三) 集合计划份额的转让、非交易过户和冻结</p> <p>1、集合计划份额的转让</p> <p>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</p>
--	---

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。

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。

八、资产管理计划的参与、退出与转让

(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

八、资产管理计划的参与、退出与转让

(十四)管理人自有资金参与集合计划

1、自有资金参与的条件：
投资者、托管人同意并授权管理人在募集期和存续期可以以自有资金参与本集合计划。管理人以自有资金参与本集合计划，应符合法律法规、监管规定和本合同的相关规定。

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

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

5、自有资金的退出
投资者、托管人同意并授权管理人自有资金在存续期可以退出本集合计划。管理人以自有资金退出本集合计划，应符

<p>同等关于自有资金退出规定的情况下，可以与其他投资者同样办理退出业务；</p> <p>②因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规规定比例。</p> <p>③法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。</p> <p>(2) 管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于6个月，参与、退出时应当提前5个工作日通过管理人指定网站告知投资者和托管人；但因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律法规及本合同规定比例的，应当及时调整达标，具体安排以管理人公告为准。</p>	<p>合法律法规、监管规定和本合同的相关规定。</p> <p>(1) 管理人自有资金的退出，符合以下任一条件即可：</p> <p>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；</p> <p>②因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规规定比例。</p> <p>③法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。</p> <p>(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全体投资者和托管人；但因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律法规及本合同规定比例的，应当及时调整达标，具体安排以管理人公告为准。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资</p> <p>(二) 投资范围及比例</p> <p>本集合计划投资范围及比例符合《运作规定》组合投资的要求，具体如下：</p> <p>1、投资范围</p> <p>(1) 债权类资产：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、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、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、短期融资券及超短期融资券、非公开定向债务融资工具等银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具、次级债、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）、资产支持票据，以及固定收益类公开募集证券投资基金、货币市场基金和经人民银行等金</p>	<p>十一、资产管理计划的投资</p> <p>(二) 投资范围及比例</p> <p>本集合计划投资范围及比例符合《运作规定》组合投资的要求，具体如下：</p> <p>1、投资范围</p> <p>(1) 债权类资产：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、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、债券逆回购、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等银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具、次级债、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）、资产支持票据，以及固定收益类公开募集证券投资基金、货币市场基金和经人民银行等金融监督管理部门认定的其他标准化债权类资产；</p>

<p>融监督管理部门认定的其他标准化债权类资产；</p> <p>(2) 现金；</p> <p>(3) 本集合计划可参与债券正回购业务。</p> <p>本集合计划的投资范围包含债券回购（含正回购、逆回购），债券回购为提升组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。</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：占本集合计划总资产的 100%；</p> <p>(2) 如投资于资产管理产品的，应穿透核查，确保最终投资标的均为标准化资产，本集合计划穿透后的最终投资比例符合固定收益类产品的要求。本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本集合计划所投资资产的金额或比例。</p> <p>(三) 投资比例超限的处理方式及流程如因管理人之外的因素造成本集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内将投资比例降至许可范围内。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p>	<p>(2) 现金；</p> <p>(3) 本集合计划可参与债券正回购业务。</p> <p>本集合计划的投资范围包含债券回购（含正回购、逆回购），债券回购为提升组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。</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：占本集合计划总资产的 100%；</p> <p>(2) 如投资于资产管理产品的，应穿透核查，确保最终投资标的均为标准化资产，本集合计划穿透后的最终投资比例符合固定收益类产品的要求。本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本集合计划所投资资产的金额或比例。</p> <p>(三) 投资比例超限的处理方式及流程如因管理人之外的因素造成本集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内将投资比例降至许可范围内确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p>
<p>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>为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>(1) 本集合计划参与债券等证券发行申购时，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 170%，计算总资产时应当按照穿透</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>为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>(1) 本集合计划参与债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过集合计划的总资产，所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>(2) 本集合计划总资产/净资产不得超过 170%，计算总资产时应当按照穿透原</p>

原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

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

(4) 本集合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。

(5) 本集合计划参与债券正回购资金余额不超过本集合计划上一日净资产的 70%, 参与债券逆回购资金余额不超过上一日净资产的 100%。

(6) 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%。

(7) 信用债主体或债项或担保人评级应为 AA (含) 及以上。

(8) 投资于同一发行主体的债券不得超过本集合计划净资产的 25%。

(9) 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。

(10) 本集合计划如投资于资产支持证券,其基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权。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。若法律法规有变化,管理人为满足法律法规变化之必要对上述投资限制进行调整的,应提前告知托管人,并在管理人网站公告告知投资者。对于变更后的投资限制超出托管人投资监督能力的,管理人应与托管人协商一致。

则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

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

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

(5) 本集合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。

(6) 本集合计划参与债券正回购资金余额不超过本集合计划上一日净资产的 70%, 参与债券逆回购资金余额不超过上一日净资产的 100%。

(7) 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%。

(8) 信用债主体或债项或担保人评级应为 AA (含) 及以上。

(9) 投资于同一发行主体的信用债不得超过本集合计划净资产的 25%。

(10) 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。

(11) 本集合计划如投资于资产支持证券或资产支持票据,其基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权。

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,管理人应当在不符事项发生之日起,在具备交易条件的 20 个交易日内调整至符合要求。

管理人可根据新颁布或新修改的法律法

	<p>规或监管机关要求，对上述投资限制及调整时间进行修改，应提前告知托管人，并在管理人网站公告告知投资者。对于变更后的投资限制超出托管人投资监督能力的，管理人应与托管人协商一致。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资 (七) 投资限制及禁止行为 2、禁止行为</p>	<p>十一、资产管理计划的投资 (七) 投资限制及禁止行为 2、禁止行为 新增： (24) 利用本集合计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资； (25) 为管理人或他人违规持有金融机构股权提供便利； (26) 本集合计划不得通过投资其他资产管理产品变相扩大投资范围或者规避监管要求； (27) 本集合计划不得开展明股实债投资；</p>
<p>十四、利益冲突及关联交易 (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）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</p>	<p>十四、利益冲突及关联交易 (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）发行或者承销期内承销的证券，或者从事其他关联交易。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相关派出机构报告，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（如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定）。 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</p>

资产管理计划资产,直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式,为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元,并且事先取得投资者同意的除外。

销的证券外,管理人不得将其管理的资产管理计划资产,直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式,为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元,并且事先取得投资者同意的除外。

十九、资产管理计划的费用与税收

(三) 托管人对管理人投资运作的监督
托管人根据法律、法规、本合同约定或相关规定对管理人的下列投资行为行使监督权。托管人对管理人的投资监督和检查自本计划成立之日起开始:

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、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、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、短期融资券及超短期融资券、非公开定向债务融资工具等银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具、次级债、资产支持证券、资产支持票据,以及固定收益类公开募集证券投资基金(指债券型公募基金)、货币市场基金和经人民银行等金融监督管理部门认定的其他标准化债权类资产;

(2) 现金;

(3) 本集合计划可参与债券正回购业务。

2. 资产配置比例

现金及债权类资产: 占本集合计划总资产的 100%;

3. 投资限制

(1) 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集合计

十九、资产管理计划的费用与税收

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

(四) 越权交易的例外

非因管理人主动投资行为导致的下列情形不构成本章所述越权交易:

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

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

2、法律法规另有规定的从其规定。

因越权交易例外的原因而对受托资产造成的损失由受托资产承担,管理人不对此而对受托资产的损失承担赔偿责任。

(五) 托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。

(六) 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。

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 170%。

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

(4) 本集合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。

(5) 本集合计划参与债券正回购资金余额不超过本集合计划上一日净资产的 70%，参与债券逆回购资金余额不超过上一日净资产的 100%。

(6) 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%。

(7) 信用债主体或债项或担保人评级应为 AA（含）及以上。

(8) 投资于同一发行主体的债券不得超过本集合计划净资产的 25%。

(9) 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。

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 个工作日内调整至符合要求。

若法律法规有变化，管理人为满足法律法规变化之必要对上述投资限制进行调整的，应提前告知托管人，并在管理人网站公告告知投资者。对于变更后的投资限制超出托管人投资监督能力的，管理人应与托管人协商一致。

(四) 越权交易的例外

非因管理人主动投资行为导致的下列情形不构成本章所述越权交易：

1、如因管理人之外的因素造成本集合

<p>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。</p> <p>如因管理人之外的因素造成本集合计划投资不符合限制内容的，管理人应当在不符事项发生之日起，在具备交易条件的15个交易日内调整至符合要求。</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>(五) 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。</p> <p>(六) 托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。</p> <p>(七) 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>二十、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:应符合本合同及法律、行政法规的规定，如未做明确规定的，参照行业通行做法处理。</p> <p>(1) 投资债权类资产的估值方法</p> <p>①同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p> <p>②在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构或行业协会有关规</p>	<p>二十、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: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、交易所市场挂牌转让的资产支持证券等，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；</p>

定,或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。

③在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值;如果估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考监管机构或行业协会有关规定,或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。

④对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,则应采用估值技术确定其公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本价估值。对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。

⑤在对银行间市场的固定收益品种估值时,应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。

⑥对在银行间市场上市交易的资产支持证券,应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。对未在银行间市场上市交易且第三方估值机构未提供价格的,采用估值技术确定的公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券品种,鉴于目前尚不存在活跃市场而应采用估值技术确定其公允价值。如管理人认为成本能够近似体现公允

C、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。

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。

价值,管理人应持续评估上述做法的适当性,并在情况发生改变时做出适当调整。

⑦对在交易所市场挂牌转让的私募债券,鉴于目前尚不存在活跃市场而应采用估值技术确定其公允价值。如管理人认为成本能够近似体现公允价值,管理人应持续评估上述做法的适当性,并在情况发生改变时做出适当调整。

⑧同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值;选定的第三方估值机构未提供估值价格的,按成本估值。

⑨持有的银行存款或通知存款以本金列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化,管理人应及时通知托管人,双方及时进行账务调整。

⑩持有的债券逆回购(正回购)以本金列示,按约定利率逐日确认利息收入(利息支出)。

(2) 投资资产管理产品的估值方法

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

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

③持有的货币市场基金,按基金管理人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

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) 投资资产管理产品的估值方法

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

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

③持有的货币市场基金,按基金管理人公布的估值日前一交易日的每万份收益计算。

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

(3) 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。

(4) 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。

<p>值的，按成本价估值。</p> <p>(3) 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。</p> <p>(4) 如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。</p> <p>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。</p>	
<p>二十一、资产管理计划的费用与税收</p> <p>(一) 本集合计划的各项费用</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、认购/参与费：0； 2、退出费：0； 3、管理费：0.5%/年； 4、托管费：0.02%/年； 5、业绩报酬； 6、证券交易费用； 7、集合计划份额登记费用； 8、法律行为相关费用； 9、其他费用。 <p>(二) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、管理费</p> <p>本集合计划的年管理费率为0.5%，每日管理费计算方法如下： $T = E \times 0.5\% \div 365$； 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）。</p> <p>本集合计划管理费自计划成立之日起，每日计提，逐日累计，按自然季度支付。经管理人和托管人核对后，于每自然季末月的20日后5个工作日内由托管人根据管理人划款指令从本集合计划资产中支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。若集合计划现金形式资产不足以支付的，则顺延至下一个工作日支付，以此类推。本计划终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付管理人尚未收取的管理费。</p> <p>2、托管费</p> <p>本集合计划的年托管费率为0.02%，每</p>	<p>二十一、资产管理计划的费用与税收</p> <p>(一) 本集合计划的各项费用</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、认购/参与费：0； 2、退出费：0； 3、固定管理费：0.5%/年； 4、托管费：0.02%/年； 5、业绩报酬； 6、证券交易费用； 7、集合计划份额登记费用； 8、法律行为相关费用； 9、其他费用。 <p>(二) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、固定管理费</p> <p>本集合计划的年固定管理费率为0.5%，每日固定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）。</p> <p>本集合计划固定管理费自计划成立之日起，每日计提，逐日累计，按自然季度支付。经管理人和托管人核对后，于每自然季度首月的前5个工作日内由托管人根据管理人指令或授权文件从本集合计划资产中支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。若集合计划现金形式资产不足以支付的，则顺延至下一个工作日支付，以此类推。本计划终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付管理人尚未收取的固定管理费。投资者同意，管理人可与托管人协商一致调整固定管理费支付频率和支付时</p>

日托管费计算方法如下：

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

T 为每日托管费；

E 为前一日的集合计划资产净值（成立日按当日总份额计提）。

本集合计划托管费自计划成立之日起，每日计提，逐日累计，按自然季度支付。经管理人和托管人核对后，于每自然季末月的 20 日后 5 个工作日内由托管人根据管理人划款指令从本集合计划资产中支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。若集合计划现金形式资产不足以支付的，则顺延至下一个工作日支付，以此类推。本计划终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付托管人尚未收取的托管费。

3、业绩报酬

（1）业绩报酬的计提原则

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

2) 按投资者每笔认购/参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

3) 本集合计划仅在符合本款第 2 点所述条件时收取业绩报酬。

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

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

（2）业绩报酬计提方法

本集合计划分段计提业绩报酬，当投资者申请退出本集合计划，或本集合计划分红、终止清算时，管理人对投资者所持每笔份额的期间年化收益率超过业

间，并在管理人官网公告。

2、托管费

本集合计划的年托管费率为 0.02%，每日托管费计算方法如下：

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

T 为每日托管费；

E 为前一日的集合计划资产净值（成立日按当日总份额计提）。

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

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

3、业绩报酬

（1）业绩报酬的计提原则

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

2) 按投资者每笔认购/参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

3) 本集合计划仅在符合本款第（2）点所述条件时收取业绩报酬。

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

5) 从分红资金中提取业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次。

（2）业绩报酬计提方法

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
$R \leq S_1$	0%	$H=0$
$S_1 < R \leq S_2$	30%	$H = M \times (R - S_1) \times \frac{T}{365} \times 30\%$
$R > S_2$	50%	$H = M \times (R - S_2) \times \frac{T}{365} \times 50\% + M \times (S_2 - S_1) \times \frac{T}{365} \times 30\%$

本集合计划成立日至首个开放日为第 1 个运作周期，其业绩报酬计提基准 S_1 为 3.7%、 S_2 为 4.2%，首个开放日至下一次周一开放日（如当日不开放，则为当日的下一个开放日）为第 2 个运作周期，以此类推，第 i 个运作周期业绩报酬计提基准会在该运作周期开始的开放日前在管理人网站公布。

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

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

每笔集合计划份额业绩报酬核算期内持有期间的年化收益率 R 计算如下：

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

A 为该笔份额在本次业绩报酬核算日的累计单位净值；

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

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

T 表示该笔份额在每个业绩报酬核算期内的持有期天数；

管理人按照如下标准和方法计算每个业绩报酬核算期间的管理人业绩报酬：

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

<p>其中： H为该笔份额在本次业绩报酬计提日应计提的业绩报酬； M=该笔份额数×该笔份额上一个业绩报酬计提基准日的单位净值（若上一个业绩报酬计提基准日不存在，初始募集期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与申请日）； T表示该笔份额在本次业绩报酬计提期间的持有期天数； 已计提的业绩报酬无回拨机制。业绩报酬的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此带来的收益和损失归入集合计划资产。</p> <p>（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>	<table border="1"> <tr> <td>$R > S_{i2}$</td> <td>P_{i2}</td> <td>$H = M \times (R - S_{i2}) \times \frac{T}{365} \times P_{i2} + M \times \frac{T}{365} \times (S_{i2} - S_{i1}) \times P_{i1}$</td> </tr> </table>	$R > S_{i2}$	P_{i2}	$H = M \times (R - S_{i2}) \times \frac{T}{365} \times P_{i2} + M \times \frac{T}{365} \times (S_{i2} - S_{i1}) \times P_{i1}$
$R > S_{i2}$	P_{i2}	$H = M \times (R - S_{i2}) \times \frac{T}{365} \times P_{i2} + M \times \frac{T}{365} \times (S_{i2} - S_{i1}) \times P_{i1}$		
<p>二十二、资产管理计划的收益分配 （二）收益分配原则 1、每份集合计划份额享有同等收益分</p>	<p>本集合计划成立日至首个开放日为第1个运作周期，其业绩报酬计提基准S_1为3.7%、S_2为4.2%，首个开放日至下一次周一开放日（如当日不开放，则为当日的下一个开放日）为第2个运作周期，以此类推，本集合计划第<i>i</i>个运作周期业绩报酬计提基准S_{i1}、S_{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%。</p> <p>其中： H为该笔份额在本次业绩报酬核算期间应计提的业绩报酬 M=该笔份额数×该笔份额上一个业绩报酬核算日的单位净值（若上一个业绩报酬核算日不存在，初始募集期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与申请日）； T表示该笔份额在每个业绩报酬核算期内的持有期天数； 已计提的业绩报酬无回拨机制。业绩报酬的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此带来的收益和损失归入集合计划资产。 业绩报酬计提基准的调整周期不得短于两次开放期的间隔时间。</p> <p>（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>二十二、资产管理计划的收益分配 （二）收益分配原则 1、每份集合计划份额享有同等收益分配</p>			

<p>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）；</p> <p>2、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>3、收益分配对象为分红权益登记日所有持有集合计划份额的投资者。</p> <p>4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担；</p> <p>在符合上述原则和具备收益分配条件的前提下，本集合计划原则上每年进行一次收益分配。收益分配基准、收益分配比例、分配时间、次数由管理人根据计划运作情况决定，并在管理人网站上公告。</p> <p>法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在法律法规和监管机构允许的范围内，管理人、托管人协商一致，可以对上述收益分配原则进行调整，并在管理人网站上公告。</p> <p>（三）收益分配方案的确定与通知 本集合计划收益分配方案由管理人拟定，托管人复核后确定，并在管理人网站公告。</p> <p>（四）收益分配的执行方式 本集合计划的分红方式为现金分红，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。</p>	<p>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）；</p> <p>2、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>3、收益分配对象为分红权益登记日所有持有集合计划份额的投资者。</p> <p>4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担；</p> <p>在符合上述原则和具备收益分配条件的前提下，本集合计划收益分配基准、收益分配比例、分配时间、次数由管理人根据计划运作情况决定，并在管理人网站上公告。</p> <p>法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在法律法规和监管机构允许的范围内，管理人、托管人协商一致，可以对上述收益分配原则进行调整，并在管理人网站上公告。</p> <p>（三）收益分配方案的确定与通知 本集合计划收益分配方案由管理人拟定，托管人复核后确定，并在管理人网站公告。</p> <p>（四）收益分配的执行方式 本集合计划的分红方式原则上为现金分红，现金分红保留到小数点后两位，由小数点保留所产生的尾差由集合计划承担。管理人就支付的红利款项向托管人发送划款指令，托管人按照管理人的指令及时进行划付。</p> <p>投资者和托管人同意，管理人有权选择采用现金分红或者红利再投资方式进行分红，如本集合计划增加采用红利再投资方式，由管理人在管理人网站公告即可，无需履行合同变更程序。</p>
<p>二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>（一）集合计划合同变更的条件和程序</p> <p>1、投资者同意，本合同签署后以下情况可由管理人和托管人协商一致后对本合同作出修改：</p> <p>（1）因法律法规或中国证监会、中国</p>	<p>二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>（一）集合计划合同变更的条件和程序</p> <p>1、投资者同意，本合同签署后以下情况可由管理人和托管人协商一致后对本合同作出修改：</p> <p>（1）因法律法规或中国证监会、中国证</p>

<p>证券投资基金业协会的相关规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订必须变更资产管理合同的，包括但不限于资产管理计划备案过程中，被要求补正备案材料，涉及到本合同修改的；</p> <p>(2) 本合同的修改对投资者利益无实质性不利影响或修改不涉及本计划投资者权利义务关系，包括但不限于管理人与托管人之间指令、清算交收规则的变更；</p> <p>(3) 按照法律法规或本合同规定，资产管理人有权变更本合同的其他情形。投资者特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及计划说明书按照上述内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站(newzg.cfzq.com)公告后生效，无需另行征得投资者同意。投资者对更新或修改的内容有异议，可按照本合同的规定申请退出本集合计划，未申请退出本集合计划的，视为同意，管理人不再另行通知。</p>	<p>证券投资基金业协会的相关规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订必须变更资产管理合同的，包括但不限于资产管理计划备案过程中，被要求补正备案材料，涉及到本合同修改的；</p> <p>(2) 本合同的修改对投资者利益无实质性不利影响或修改不涉及本计划投资者权利义务关系；</p> <p>(3) 按照法律法规或本合同规定，资产管理人有权变更本合同的其他情形。投资者特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及计划说明书按照上述内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站(zg.stock.hnchasing.com)公告后生效，无需另行征得投资者同意。</p>
<p>二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>(三) 集合计划/合同的终止</p>	<p>二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>(三) 集合计划/合同的终止</p> <p>增加： 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。</p>
<p>管理人网站 newzg.cfzq.com</p>	<p>管理人网站 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《财信证券周周鑫 2 号集合资产管理计划合同变更征询及生效公告》及其附件的相关内容，承诺自行承担投资风险和损失。

本投资者 同意 不同意 （请打勾）此次合同变更。

投资者

个人填写：

姓名：_____证件类型：_____证件号码：_____

住所：_____

联系电话：_____

传真：_____电子信箱：_____

通讯地址：_____

联系人：_____

机构填写：

机构名称：_____法定代表人：_____

住所：_____

联系电话：_____

传真：_____电子信箱：_____

通讯地址：_____

联系人：_____

投资者（签字/盖章）：_____

签署日期： 年 月 日

《征询意见函》请本人签字/盖章后扫描发送至 cxzg@hncasing.com