

东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划 集合资产管理合同变更公告

尊敬的委托人：

东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划于 2018 年 4 月 26 日正式设立并运作。根据监管最新要求和集合计划运作过程中的实际业务发展情况，东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划集合资产管理合同中的部分条款需要进行调整，以适应监管要求、保护客户利益和业务发展的需要。因此，东证融汇证券资产管理有限公司经与托管人南京银行股份有限公司协商，拟对《东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划集合资产管理合同》、《东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划说明书》和《东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划风险揭示书》中的相关条款进行变更。变更方案如下：

一、合同变更主要内容

（一）《东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划集合资产管理合同》修改对照明细表

序号	位置	原条款	现条款
1	一、前言	为规范东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作，明确《东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划集合资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国合同法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(以下简称《细则》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》(以下简称《暂行规定》)、《证券公司客户资产管理业务规范》(以下简称《规范》)、《证券期货投资者适	为规范东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作，明确《东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划集合资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国合同法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(以下简称《细则》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》(以下简称《暂行规定》)、《证券公司客户资产管理业务规范》(以下简称《规范》)、《证券期货投资者适

	<p>资产管理计划的基本情况 (二) 类型:</p>		
7	<p>四、集合资产管理计划的基本情况 (四) 投资范围和投资比例</p>	<p>2、资产配置比例 (1) 投资于国债、金融债、企业债、公司债、到期日在1年以上(不含1年)的地方政府债、可转债、可交换债、到期日在1年以上(不含1年)的央行票据、短期融资券(含超短融)、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券优先级、同业存单、债券型基金、混合型及股票型分级基金的优先级份额等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会认可的其他投资品种。占集合计划资产总值的比例为0-100%; (2) 投资于现金、银行存款(包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款)、货币市场基金、到期日在1年内(含1年)的政府债券、到期日在1年内(含1年)的央行票据等高流动性短期金融产品等现金类资产占集合计划资产总值的比例为0-100%; (3) 国债期货当日保证金余额占比不超过资产管理计划资产净值的4%; 本集合计划可以参与证券回购,但融入资金余额不得超过集合计划资产净值的40%。 委托人在此同意并授权管理人可以将本集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券或者从事其他重大关联交易的交易。交易完成5个工作日内,管理人应书面通知托管人,通过管理人的网站告知委托人,并向证券交易所报告。本集合计划管理人将在集合计划成立之日起6个月内使集合计划的投资组合比例符合以上约定。如因一级市场申购发生投资比例超标,应自申购证券可交易之日起10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证券公司之</p>	<p>2、资产配置比例 (1) 投资于国债、金融债、企业债、公司债、到期日在1年以上(不含1年)的地方政府债、可转债、可交换债、到期日在1年以上(不含1年)的央行票据、短期融资券(含超短融)、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券优先级、同业存单、债券型基金、混合型及股票型分级基金的优先级份额等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会认可的其他投资品种。占集合计划资产总值的比例为0-100%; (2) 投资于现金、银行存款(包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款)、货币市场基金、债券逆回购、到期日在1年内(含1年)的政府债券、到期日在1年内(含1年)的央行票据等高流动性短期金融产品等现金类资产占集合计划资产总值的比例为0-100%; (3) 国债期货当日保证金余额占比不超过资产管理计划资产净值的4%; (4) 投资于银行存款、债券、货币基金、同业存单等债权类资产占集合计划资产总值的比例为80%-100%,托管人对该投资比例不予监控; 本集合计划可以参与证券回购,但融入资金余额不得超过集合计划资产净值的40%。 委托人在此同意并授权管理人可以将本集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或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,根据法律法规要求履行相应程序后进行交易,并按照法律法规要求在交易完成后书面通知托管人,通过管理人的网站告知委托人,并向证券交易所及有关监管部门报告。 本集合计划管理人将在集合计划成立之日起6个月内使集合计划的投资组合比例符合以上约定。如因一级市场申购发生投资比例超标,应自申购证券可交易之日起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证券公司之外的因素,造成集合计划投资比例超标,管理人应在超标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。 法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的,资</p>

		<p>外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。</p> <p>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。</p>	<p>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。</p>
8	<p>四、集合资产管理计划的基本情况</p> <p>(八) 本集合计划的风险收益特征及适合推广对象</p>	<p>2、适合推广对象</p> <p>本集合计划的适合推广对象为管理人和推广机构现有客户中具有匹配的风险承受能力，且认同集合计划投资理念的合格投资者，包括个人投资者和机构投资者(法律法规禁止投资集合资产管理计划的除外)。</p> <p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力且符合下列条件之一的单位和个人：</p> <p>(1) 个人或者家庭金融资产合计不低于 100 万元人民币；</p> <p>(2) 公司、企业等机构净资产不低于 1000 万元人民币。</p> <p>依法设立并受监管的各类集合投资产品视为单一合格投资者，若本计划投资者为投资产品的，不得通过拆分转让资产管理计划份额或其收益权、为投资者直接或间接提供短期借贷等方式，变相突破合格投资者标准。</p>	<p>2、适合推广对象</p> <p>本集合计划的适合推广对象为管理人和推广机构现有客户中具有匹配的风险承受能力，且认同集合计划投资理念的合格投资者，包括个人投资者和机构投资者(法律法规禁止投资集合资产管理计划的除外)。</p> <p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织：</p> <p>(1) 具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一的自然人：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元。</p> <p>(2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。</p> <p>(3) 金融管理部门视为合格投资者的其他情形。</p> <p>依法设立并受监管的各类集合投资产品视为单一合格投资者，若本计划投资者为投资产品的，不得通过拆分转让资产管理计划份额或其收益权、为投资者直接或间接提供短期借贷等方式，变相突破合格投资者标准。</p>
9	<p>四、集合资产管理计划的基本情况</p> <p>(九) 本集合计划的推广</p>	<p>1、推广机构</p> <p>东证融汇及与管理人签订代理推广协议的其他银行和证券公司等。</p>	<p>1、推广机构</p> <p>东证融汇及与管理人签订代理推广协议的其他银行和证券公司等（管理人有权以管理人网站公告方式增加或变更推广机构）。</p>
10	<p>四、集合资产管理计划的基本情况</p>	<p>2、推广方式</p> <p>管理人应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式推广文件，置备于推广机构营业场所。推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品</p>	<p>2、推广方式</p> <p>管理人应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式推广文件，置备于推广机构营业场所。推广机构应当坚持“了解产品”和“了解客户”的经营理念，了解客户的投资需求和风险偏好，加强投资者适当性管理，详细</p>

	(九) 本集合计划的推广	特点并充分揭示风险,推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划,引导客户审慎做出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式,或者采取虚假宣传、夸大收益和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。	介绍产品特点并充分揭示风险,推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划,引导客户审慎做出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式,或者采取虚假宣传、夸大收益和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。
11	四、集合资产管理计划的基本情况 (十) 本集合计划的各项费用	5、业绩报酬: 管理人提取集合计划年化收益率超过业绩报酬计提基准以上部分的 90%作为业绩报酬。	5、业绩报酬: 管理人提取集合计划年化收益率超过业绩报酬计提基准以上部分的 80%作为业绩报酬。
12	五、集合计划的参与和退出 (一) 集合计划的参与 1、参与的办理时间	(2) 存续期参与 在存续期内,本集合计划开放期分为参与开放期和退出开放期。本集合计划设置若干个封闭运作期,每个封闭运作期内(不含该封闭运作期的最后一天),本集合计划封闭运作,不接受委托人参与和退出申请。每个封闭运作期的最后一个工作日为开放日,接受委托人参与和退出申请。具体运作期届时以管理人公告为准。管理人可以在参与开放日接受委托人的参与申请。管理人也可以根据产品情况安排临时开放期办理参与、退出业务。临时开放期安排以届时管理人公告为准。	(2) 存续期参与 在存续期内,本集合计划开放期分为参与开放期和退出开放期。本集合计划设置若干个封闭运作期,每个封闭运作期内(不含该封闭运作期的最后一天),本集合计划原则上封闭运作,不接受委托人参与和退出申请。每个封闭运作期的最后一个工作日为开放日,接受委托人参与和退出申请。具体运作期届时以管理人公告为准。管理人在参与开放日接受委托人的参与申请。管理人也可以根据产品情况安排临时开放期办理参与、退出业务。临时开放期安排以届时管理人公告为准。
13	五、集合计划的参与和退出 (二) 集合计划的退出	1、退出的办理时间 在存续期内,本集合计划开放期分为参与开放期和退出开放期。本集合计划设置若干个封闭运作期,每个封闭运作期内(不含该封闭运作期的最后一天),本集合计划封闭运作,不接受委托人参与和退出申请。每个封闭运作期的最后一个工作日为开放日,接受委托人参与和退出申请。具体运作期届时以管理人公告为准。管理人在退出开放日接受委托人的退出申请。管理人也可以根据产品情况安排临时开放期办理参与、退出业务。临时开放期安排以届时管理人公告为准。	1、退出的办理时间 在存续期内,本集合计划开放期分为参与开放期和退出开放期。本集合计划设置若干个封闭运作期,每个封闭运作期内(不含该封闭运作期的最后一天),本集合计划原则上封闭运作,不接受委托人参与和退出申请。每个封闭运作期的最后一个工作日为开放日,接受委托人参与和退出申请。具体运作期届时以管理人公告为准。管理人在退出开放日接受委托人的退出申请。管理人也可以根据产品情况安排临时开放期办理参与、退出业务。临时开放期安排以届时管理人公告为准。
14	十、集合计划账	托管人按照规定开立资产管理计划财产的托管专户和证券账户,由管理人根据投	托管人按照规定开立资产管理计划财产的托管专户和证券账户,由管理人根据投资需要按照规定开立基金账资产委

	户与资产 (一)集合计划账户的开户	资需要按照规定开立基金账资产委托人和管理人应当在开户过程中给予必要的配合,并提供所需资料。托管专户名称为:“东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划”,预留印鉴中包含一枚托管人指定人员名章,托管专户由托管人根据本合同规定进行保管和使用。证券账户名称应当是“东证融汇—南京银行—东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划”(账户名称以实际开立账户名称为准)。委托财产的一切货币收支活动均通过该资金账户进行,包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款,均需通过该托管专户进行。托管专户利率为 0.72%,利息归托管的资产管理计划所有。	托人和管理人应当在开户过程中给予必要的配合,并提供所需资料。托管专户名称为:“东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划”,预留印鉴中包含一枚托管人指定人员名章,托管专户由托管人根据本合同规定进行保管和使用。证券账户名称应当是“东证融汇—南京银行—东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划”(账户名称以实际开立账户名称为准)。委托财产的一切货币收支活动均通过该资金账户进行,包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款,均需通过该托管专户进行。托管专户利率为 0.72%/年,利息归托管的资产管理计划所有。
15	十、集合计划账户与资产	(三)集合计划资产的管理与处分 集合计划资产由托管人托管,并独立于管理人及托管人的自有资产及其管理、托管的其他资产。管理人或托管人的债权人无权对集合计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除依照《管理办法》、《细则》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定处分外,集合计划资产不得被处分。	(三)集合计划资产的管理与处分 集合计划资产由托管人托管,并独立于管理人及托管人的自有资产及其管理、托管的其他资产。管理人或托管人的债权人无权对集合计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除依照《管理办法》、《细则》、《指导意见》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定处分外,集合计划资产不得被处分。
16	十二、集合计划的估值 (七)估值方法: 2、证券投资基金估值方法	(4)在任何情况下,资产管理人如采用本项第(1)一(3)项规定的方法对委托财产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果资产管理人认为按本项第(1)一(4)项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的,资产管理人可根据具体情况,并与资产托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。	(4)在任何情况下,资产管理人如采用本项第(1)一(3)项规定的方法对委托财产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果资产管理人认为按本项第(1)一(3)项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的,资产管理人可根据具体情况,并与资产托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。
17	十二、集合计划的估值 (七)估值方法:		新增: 5.其他未列示的投资品种的估值方法,由管理人和托管人根据现行有效的法律法规、监管要求或市场通行的估值方法确定。
18	十二、集合计划的估值 (七)估值方法:		新增: 8、在任何情况下,管理人如采用上述规定的方法对计划资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但如果管理人认为按上述规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的,管理人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形成的资产估值,管理人可根据具体情况与托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

19	十三、集合计划的费用、业绩报酬 (三) 管理人业绩报酬	2、业绩报酬的计提方法： 若委托人该笔份额参与期间的年化收益率(R)高于该笔委托资产对应的业绩报酬计提基准(K)，则按超额收益的90%计提比例计算业绩报酬。 管理人在每个参与开放期前通过指定官网公布本集合计划的业绩报酬计提基准。 此时业绩报酬计算公式： $E = (R - K) \times 90\% \times (F / 365) \times P_2 \times M$	2、业绩报酬的计提方法： 若委托人该笔份额参与期间的年化收益率(R)高于该笔委托资产对应的业绩报酬计提基准(K)，则按超额收益的80%计提比例计算业绩报酬。 管理人在每个参与开放期前通过指定官网公布本集合计划的业绩报酬计提基准。 此时业绩报酬计算公式： $E = (R - K) \times 80\% \times (F / 365) \times P_2 \times M$
20	十三、集合计划的费用、业绩报酬 (三) 管理人业绩报酬 如果今后市场中有其他代表性更强的业绩报酬计提基准，或者有更科学客观的权重比例适用于本集合计划时，本集合计划管理人可以依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩报酬计提基准进行相应调整。 如果今后市场中有其他代表性更强的业绩报酬计提基准，或者有更科学客观的权重比例适用于本集合计划时，本集合计划管理人可以依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，根据实际情况以公告形式对业绩报酬计提基准进行相应调整。
21	十五、投资理念与投资策略 (三) 投资策略	3.基金投资策略 本计划对各类证券投资基金进行精选，积极主动选取具有核心竞争优势的证券投资基金。通过充分跟踪并实地调研，全方位考察基金投资团队的投资理念、投资策略、风险控制等特征。对选出的基金投资风格和投资组合变动情况进行跟踪，及时发现其投资风格和组合变化情况进而进行相应的调整。	3.基金投资策略 本计划对各类证券投资基金进行精选，积极主动选取具有核心竞争优势的证券投资基金。
22	十六、投资决策与风险控制 (一) 集合计划的决策依据	1.《管理办法》、《实施细则》、《管理规范》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件。	1.《管理办法》、《实施细则》、《指导意见》、《管理规范》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件。
23	十六、投资决策与风险控制 (三) 风险控制 3.风险管理的具		新增：5) 资金前端控制 证券交易所、中国结算在每个交易日实施资金前端控制。 管理人(作为“交易参与者”)向托管人(作为“结算参与者”)提供资金前端控制最高额度相关信息，由结算参与者向中国结算申报。中国结算接收结算参与者的申报信息，依据最高额度计算标准对最高额度进行有效性校验后发送证券交易所。管理人应当在最高额度以内向交易所申报资金前端控制自设额度。证券交易所根据管理人申报的符合

	<p>体措施</p> <p>(2) 风险控制措施</p>		<p>要求的自设额度，对其相关交易单元实施资金前端控制。管理人、托管人可以对其资金前端控制的最高额度与自设额度等信息进行调整。</p> <p>管理人、托管人应当按照证券交易所、中国结算的要求，及时申报有关信息，确保申报信息真实、完整、有效，切实履行资金前端控制各项职责。</p> <p>证券交易所、中国结算依据业务规则的有关规定，根据管理人、托管人申报的额度信息实施资金前端控制，如交易参与人、结算参与人故意或重大过失造成本计划损失的，由管理人、托管人根据各自过错承担相应的损失。</p>
24	<p>十七、投资限制及禁止行为</p> <p>(一) 投资限制</p>	<p>为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>1、不得投资于主体评级（如有）和债项评级（如有）均在 AA(不含)以下的债券（注：依据的评级机构不包括中债资信）；</p> <p>2、不得投资于交易所或银行间市场之外的资产支持证券；</p> <p>3、投资的国债期货仅限于套期保值。</p> <p>4、投资范围不得超出本合同的约定；</p> <p>5、集合计划参与证券回购融入资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>6、证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。</p> <p>如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。</p>	<p>为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>1、不得投资于主体评级（如有）和债项评级（如有）均在 AA(不含)以下的债券（注：依据的评级机构不包括中债资信，本条不适用于无主体评级或/且无债项评级的债券）；</p> <p>2、不得投资于交易所或银行间市场之外的资产支持证券；</p> <p>3、投资的国债期货仅限于套期保值；</p> <p>4、投资范围不得超出本合同的约定；</p> <p>5、集合计划参与证券回购融入资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>6、不得从事证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。</p> <p>如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。</p>
25	<p>十八、集合计划的信息披露</p> <p>(二) 定期报告</p>		<p>新增：6、其他报告</p> <p>管理人、托管人应当根据法律法规和中国人民银行、中国证监会、证券投资基金业协会等有关监管部门的要求履行其他报告义务。</p>
26	<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>2. 委托人的义务</p>	<p>(1) 委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；自然人不得用筹集的他人资金参与集合计划，法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或其他推广机构提供合法筹集资金的证明文件；委托人承诺在参与集合资产管理计划之前，已经是管理人或者其他推广机构的客户；</p>	<p>(1) 委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划，不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；自然人不得用筹集的他人资金参与集合计划，法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或其他推广机构提供合法筹集资金的证明文件；委托人承诺在参与集合资产管理计划之前，已经是管理人或者其他推广机构的客户；</p>

27	<p>二十二、当事人的权利和义务</p> <p>(二) 管理人的权利和义务</p> <p>2、管理人的义务</p> <p>(1) 在集合计划投资管理活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，以专业技能管理集合计划的资产，为委托人的最大利益服务，依法保护委托人的财产权益；</p> <p>(2) 进行资产估值等会计核算；</p> <p>(3) 根据中国证监会有关规定、本合同、《说明书》和托管协议的约定，接受托管人的监督；</p> <p>(4) 依法对托管人、代理推广机构的行为进行监督，如发现托管人、代理推广机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、代理推广协议的，应当予以制止；</p> <p>(5) 按规定出具资产管理报告，保证委托人能够了解有关集合计划资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息；</p> <p>(6) 按照本合同及《说明书》约定向委托人分配集合计划的收益；</p> <p>(7) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项；</p> <p>(8) 妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、客户资料、交易记录、会计账册等文件、资料和数据；</p> <p>(9) 在集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；</p> <p>(10) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产或因其他原因不能继续履行管理人职责时，及时向委托人和托管人报告；</p> <p>(11) 因管理人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；</p> <p>(12) 因托管人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，代委托人向托管人追偿；</p> <p>(13) 其他义务法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同、说明书、《托管协议》约定的其他义务。</p>	<p>2、管理人的义务</p> <p>(1) 在集合计划投资管理活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，以专业技能管理集合计划的资产，为委托人的最大利益服务，依法保护委托人的财产权益；</p> <p>(2) 依法募集资金，自行或委托符合监管要求办理产品份额的发售和登记事宜；</p> <p>(3) 办理资产管理计划登记备案或者注册手续；</p> <p>(4) 对所管理的不同产品受托财产分别管理、分别记账，进行投资；</p> <p>(5) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向委托人分配收益；</p> <p>(6) 依法计算并披露产品净值或者投资收益情况，确定参与、退出价格；</p> <p>(7) 办理与资产管理计划业务有关的信息披露事项；</p> <p>(8) 以管理人名义，代表委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；</p> <p>(9) 在兑付受托资金及收益时，应当保证受托资金及收益返回委托人的原账户、同名账户或者合同约定的受益人账户；</p> <p>(10) 进行资产估值等会计核算并编制产品财务会计报告；</p> <p>(11) 根据中国证监会有关规定、本合同、《说明书》和托管协议的约定，接受托管人的监督；</p> <p>(12) 依法对托管人、代理推广机构的行为进行监督，如发现托管人、代理推广机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、代理推广协议的，应当予以制止；</p> <p>(13) 按规定出具资产管理报告，保证委托人能够了解有关集合计划资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息；</p> <p>(14) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项；</p> <p>(15) 妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、客户资料、交易记录、会计账册等文件、资料和数据；</p> <p>(16) 在集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；</p> <p>(17) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产或因其他原因不能继续履行管理人职责时，及时向委托人和托管人报告；</p> <p>(18) 因管理人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；</p> <p>(19) 因托管人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，代委托人向托管人追偿；</p> <p>(20) 其他义务法律、行政法规、监管部门有关规定和本合同、说明书、《托管协议》约定的其他义务。</p>
----	--	---

28	二十二、 当事人的权利和义务 (三) 托管人的权利与义务	2、托管人的义务 …… (15) 法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同、说明书及《托管协议》约定的其他义务。	2、托管人的义务 …… (15) 法律、行政法规、监管部门有关规定和本合同、说明书及《托管协议》约定的其他义务。
29	二十三、 违约责任与争议处理	(二) 争议的处理 因履行本合同发生的争议,由协议签订各方协商解决,协商不成的,任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会解决。	(二) 争议的处理 因履行本合同发生的争议,由协议签订各方协商解决,协商不成的,任何一方均有权将争议提交管理人所在地法院以诉讼方式解决。
30	二十四、 风险揭示 (一) 市场风险		新增: 6、汇率风险 汇率风险是指因境外证券投资所产生的以非本币计价的各类资产受汇率波动影响而引起本币估值下的集合计划资产波动,使集合计划资产面临的风险。
31	二十四、 风险揭示		新增: (六) 证券交易所资金前端风险控制相关风险。 证券交易所资金前端风险控制相关风险。根据《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所资金前端风险控制业务规则》等有关规定,证券交易所、中国结算对管理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,并通过证券交易所对本计划实施资金前端控制。本计划可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易,可能造成损失。
32	二十四、 风险揭示 (七) 本集合计划特有 风险		新增: 1、本集合计划属于固定收益类产品,投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于 80%,如果债券市场出现整体下跌,债券价格波动剧烈,本集合计划的净值表现将受到影响。 2、本集合计划成立后每个封闭期内,集合计划原则上封闭运作,委托人将面临在封闭期间内无法退出集合计划的风险。
33	二十四、 风险揭示 (七) 本集合计划特有 风险	8、本集合计划的业绩报酬计提基准(年化)仅作为业绩报酬计算的基准,供投资者参考,并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。本集合计划份额可能出现净值损失,投资风险由委托人自行承担。	10、本集合计划的业绩报酬计提基准(年化)仅作为业绩报酬计算的基准,供投资者参考,并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺,最终收益率以客户实际收到的收益为准。本集合计划份额可能出现净值损失,投资风险由委托人自行承担。

	风险		
34	二十六、合同的补充、修改与变更	<p>(二) 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 个工作日内以书面或者管理人网站公告方式(由管理人确定)向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的, 应在征询意见发出后的 10 个工作日或最近一个开放期内提出退出本集合计划的申请; 委托人未在前述时间回复意见的, 视为委托人同意本合同变更。意见答复不同意变更且逾期未退出的, 管理人有权在期限届满后将相关份额强制退出计划。自合同变更生效之日起, 公告内容即成为本合同组成部分。</p>	<p>(二) 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 个工作日内以书面或者管理人网站公告方式(由管理人确定)向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的, 应在征询意见发出后的 5 个工作日或最近一个开放期内提出退出本集合计划的申请; 委托人未在前述时间回复意见的, 视为委托人同意本合同变更。意见答复不同意变更且逾期未退出的, 管理人有权在期限届满后将相关份额强制退出计划。自合同变更生效之日起, 公告内容即成为本合同组成部分。</p>

(二)《东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划说明书》

修改对照明细表

序号	位置	原条款	现条款
1	类型	集合资产管理计划	固定收益类集合资产管理计划
2	相关费率	<p>1、参与费：免收</p> <p>2、退出费：免收</p> <p>3、管理费：本集合计划的年管理费率为 0.3%。</p> <p>4、托管费：本集合计划的年托管费率为 0.03%。</p> <p>5、业绩报酬： 管理人提取集合计划年化收益率超过业绩报酬计提基准以上部分的 90% 作为业绩报酬。</p> <p>6、其他费用： 其他费用及具体计算方法详见本合同第十三部分“集合计划的费用、业绩报酬”。</p>	<p>1、参与费：免收</p> <p>2、退出费：免收</p> <p>3、管理费：本集合计划的年管理费率为 0.3%。</p> <p>4、托管费：本集合计划的年托管费率为 0.03%。</p> <p>5、业绩报酬： 管理人提取集合计划年化收益率超过业绩报酬计提基准以上部分的 80% 作为业绩报酬。</p> <p>6、其他费用： 其他费用及具体计算方法详见本合同第十三部分“集合计划的费用、业绩报酬”。</p>
3	投资范围	<p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 投资于国债、金融债、企业债、公司债、到期日在 1 年以上(不含 1 年)的地方政府债、可转债、可交换债、到期日在 1 年以上(不含 1 年)的央行票据、短期融资券(含超短融)、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券优先级、同业存单、债券型基金、混合型及股票型分级基金的优先级份额等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国</p>	<p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 投资于国债、金融债、企业债、公司债、到期日在 1 年以上(不含 1 年)的地方政府债、可转债、可交换债、到期日在 1 年以上(不含 1 年)的央行票据、短期融资券(含超短融)、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券优先级、同业存单、债券型基金、混合型及股票型分级基金的优先级份额等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会</p>

		<p>证监会认可的其他投资品种。占集合计划资产总值的比例为 0-100%；</p> <p>(2) 投资于现金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金、到期日在 1 年内(含 1 年)的政府债券、到期日在 1 年内(含 1 年)的央行票据等高流动性短期金融产品等现金类资产占集合计划资产总值的比例为 0-100%；</p> <p>(3) 国债期货当日保证金余额占比不超过资产管理计划资产净值的 4%；</p> <p>本集合计划可以参与证券回购,但融入资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以将本集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券或者从事其他重大关联交易的交易。交易完成 5 个工作日内, 管理人应书面通知托管人, 通过管理人的网站告知委托人, 并向证券交易所报告。</p> <p>本集合计划管理人将在集合计划成立之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合以上约定。如因一级市场申购发生投资比例超标, 应自申购证券可交易之日起 10 个工作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证券公司之外的因素, 造成集合计划投资比例超标, 管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个工作日内将投资比例降至许可范围内。</p> <p>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。</p>	<p>证监会认可的其他投资品种。占集合计划资产总值的比例为 0-100%；</p> <p>(2) 投资于现金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金、债券逆回购、到期日在 1 年内(含 1 年)的政府债券、到期日在 1 年内(含 1 年)的央行票据等高流动性短期金融产品等现金类资产占集合计划资产总值的比例为 0-100%；</p> <p>(3) 国债期货当日保证金余额占比不超过资产管理计划资产净值的 4%；</p> <p>(4) 投资于银行存款、债券、货币基金、同业存单等债权类资产占集合计划资产总值的比例为 80%-100%，托管人对该投资比例不予监控；本集合计划可以参与证券回购, 但融入资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以将本集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或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, 根据法律法规要求履行相应程序后进行交易, 并按照法律法规要求在交易完成后书面通知托管人, 通过管理人的网站告知委托人, 并向证券交易所及有关监管部门报告。</p> <p>本集合计划管理人将在集合计划成立之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合以上约定。如因一级市场申购发生投资比例超标, 应自申购证券可交易之日起 15 个工作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证券公司之外的因素, 造成集合计划投资比例超标, 管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 15 个工作日内将投资比例降至许可范围内。</p> <p>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。</p>
4	适合推广对象	<p>本集合计划的适合推广对象为管理人和推广机构现有客户中具有匹配的风险承受能力, 且认同集合计划投资理念的合格投资者, 包括个人投资者和机构投资者(法律法规禁止投资集合资产管理计划的除外)。</p> <p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力且符合</p>	<p>本集合计划的适合推广对象为管理人和推广机构现有客户中具有匹配的风险承受能力, 且认同集合计划投资理念的合格投资者, 包括个人投资者和机构投资者(法律法规禁止投资集合资产管理计划的除外)。</p> <p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力, 投资于单</p>

		<p>下列条件之一的单位和个人：</p> <p>1、个人或者家庭金融资产合计不低于 100 万元人民币；</p> <p>2、公司、企业等机构净资产不低于 1000 万元人民币。</p> <p>依法设立并受监管的各类集合投资产品视为单一合格投资者，若本计划投资者为投资产品的，不得通过拆分转让资产管理计划份额或其收益权、为投资者直接或间接提供短期借贷等方式，变相突破合格投资者标准。</p>	<p>只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织：</p> <p>1.具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元。</p> <p>2.最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。</p> <p>3.金融管理部门视为合格投资者的其他情形。依法设立并受监管的各类集合投资产品视为单一合格投资者，若本计划投资者为投资产品的，不得通过拆分转让资产管理计划份额或其收益权、为投资者直接或间接提供短期借贷等方式，变相突破合格投资者标准。</p>
5	代理推广机构	东证融汇及与管理人签订代理推广协议的其他银行和证券公司等。	东证融汇及与管理人签订代理推广协议的其他银行和证券公司等（管理人有权以管理人网站公告方式增加或变更推广机构）。
6	集合计划的参与办理时间	<p>2、存续期参与</p> <p>在存续期内，本集合计划开放期分为参与开放期和退出开放期。本集合计划设置若干个封闭运作期，每个封闭运作期内（不含该封闭运作期的最后一天），本集合计划封闭运作，不接受委托人参与和退出申请。每个封闭运作期的最后一个工作日为开放日，接受委托人参与和退出申请。具体运作期届时以管理人公告为准。管理人在参与开放日接受委托人的参与申请。管理人也可以根据产品情况安排临时开放期办理参与、退出业务。临时开放期安排以届时管理人公告为准。</p> <p>管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束。开放期的具体日期以管理人公告为准。若出现其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。</p>	<p>2、存续期参与</p> <p>在存续期内，本集合计划开放期分为参与开放期和退出开放期。本集合计划设置若干个封闭运作期，每个封闭运作期内（不含该封闭运作期的最后一天），本集合计划原则上封闭运作，不接受委托人参与和退出申请。每个封闭运作期的最后一个工作日为开放日，接受委托人参与和退出申请。具体运作期届时以管理人公告为准。管理人在参与开放日接受委托人的参与申请。管理人也可以根据产品情况安排临时开放期办理参与、退出业务。临时开放期安排以届时管理人公告为准。</p> <p>管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束。开放期的具体日期以管理人公告为准。若出现其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。</p>
7	集合计划的退出办理时间	<p>在存续期内，本集合计划开放期分为参与开放期和退出开放期。本集合计划设置若干个封闭运作期，每个封闭运作期内（不含该封闭运作期的最后一天），本集合计划封闭运作，不接受委托人参与和退出申请。每个封闭运作期的最后一个工作日为开放日，接受委托人参与和退出申请。具体运作期届时以管理人公告为准。管理人在退出开放日接受委托人的退出申请。管理人也可以根据产品情况安排临时开放期办理参与、退出业务。临时开放期安排以届</p>	<p>在存续期内，本集合计划开放期分为参与开放期和退出开放期。本集合计划设置若干个封闭运作期，每个封闭运作期内（不含该封闭运作期的最后一天），本集合计划原则上封闭运作，不接受委托人参与和退出申请。每个封闭运作期的最后一个工作日为开放日，接受委托人参与和退出申请。具体运作期届时以管理人公告为准。管理人在退出开放日接受委托人的退出申请。管理人也可以根据产品情况安排临时开放期办理参与、退出业务。临时开放期安排以</p>

		时管理人公告为准。	届时管理人公告为准。
8	业绩报酬 2. 业绩报酬 计提办法	<p>.....</p> <p>若委托人该笔份额参与期间的年化收益率（R）高于该笔委托资产对应的业绩报酬计提基准（K），则按超额收益的 90% 计提比例计算业绩报酬。</p> <p>管理人在每个参与开放期前通过指定官网公布本集合计划的业绩报酬计提基准。</p> <p>此时业绩报酬计算公式： $E = (R - K) \times 90\% \times (F / 365) \times P_2 \times M$</p>	<p>.....</p> <p>若委托人该笔份额参与期间的年化收益率（R）高于该笔委托资产对应的业绩报酬计提基准（K），则按超额收益的 80% 计提比例计算业绩报酬。</p> <p>管理人在每个参与开放期前通过指定官网公布本集合计划的业绩报酬计提基准。</p> <p>此时业绩报酬计算公式： $E = (R - K) \times 80\% \times (F / 365) \times P_2 \times M$</p>
9	业绩报酬	<p>.....</p> <p>如果今后市场中有其他代表性更强的业绩报酬计提基准，或者有更科学客观的权重比例适用于本集合计划时，本集合计划管理人可以依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩报酬计提基准进行相应调整。</p>	<p>.....</p> <p>如果今后市场中有其他代表性更强的业绩报酬计提基准，或者有更科学客观的权重比例适用于本集合计划时，本集合计划管理人可以依据维护集合计划份额持有人合法权益的原则，根据实际情况以公告形式对业绩报酬计提基准进行相应调整。</p>

（三）《东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划风险揭示

书》修改对照明细表

序号	位置	原条款	现条款
1	一、了解集合资产管理计划，区分风险收益特征	委托人在此同意并授权管理人可以将本集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券或者从事其他重大关联交易的交易。交易完成 5 个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所报告。	委托人在此同意并授权管理人可以将本集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或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，根据法律法规要求履行相应程序后进行交易，并按照法律法规要求在交易完成后书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所及有关监管部门报告。
2	二、了解集合资产管理计划风险 (一) 市场风险		新增：6、汇率风险 汇率风险是指因境外证券投资所产生的以非本币计价的各类资产受汇率波动影响而引起本币估值下的集合计划资产波动，使集合计划资产面临的风险。
3	二、了解集合资产管理计		新增：(六) 证券交易所资金前端风险控制相关风险。

	划风险		根据《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》等有关规定，证券交易所、中国结算对管理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，并通过证券交易所对本计划实施资金前端控制。本计划可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易，可能造成损失。
4	二、了解集合资产管理计划风险 (七)本集合计划特有风险		新增：1、本集合计划属于固定收益类产品，投资于银行存款、债券、货币基金、同业存单等债权类资产的比例不低于 80%，如果债券市场出现整体下跌，债券价格波动剧烈，本集合计划的净值表现将受到影响。 2、本集合计划成立后每个封闭期内，集合计划原则上封闭运作，委托人将面临在封闭期间内无法退出集合计划的风险。
5	二、了解集合资产管理计划风险 (七)本集合计划特有风险	8、本集合计划的业绩报酬计提基准（年化）仅作为业绩报酬计算的基准，供投资者参考，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。本集合计划份额可能出现净值损失，投资风险由委托人自行承担。	10、本集合计划的业绩报酬计提基准（年化）仅作为业绩报酬计算的基准，供投资者参考，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺，最终收益率以客户实际收到的收益为准。本集合计划份额可能出现净值损失，投资风险由委托人自行承担。
6	特别提示	以上《东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划风险揭示书》本人/机构已经完全阅读并充分理解其全部内容，同时，本人确认东证融汇证券资产管理有限公司或/及其授权人员已经就集合计划相关业务规则、计划说明书、集合资产管理合同对我进行了全面细致的讲解，本人/机构已经理解并愿意自行承担参与集合资产管理计划的风险和损失。	以上《东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划风险揭示书》本人/机构已经完全阅读并充分理解其全部内容，同时，本人/机构确认东证融汇证券资产管理有限公司或/及其授权人员已经就集合计划相关业务规则、计划说明书、集合资产管理合同对我进行了全面细致的讲解，本人/机构已经理解并愿意自行承担参与集合资产管理计划的风险和损失。

二、合同变更流程

管理人在公司网站公告东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划集合资产管理合同变更事宜，并按《东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划集合资产管理合同》的约定，在公告后 5 个工作日内以书面或者管理人网站公告方式（由管理人确

定)向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的,应在征询意见发出后的最近一个开放期即 2018 年 7 月 23 日提出退出本集合计划的申请;委托人未在征询意见发出后的 10 个工作日即 2018 年 7 月 23 日前回复意见的,视为委托人同意本合同变更。意见答复不同意变更且逾期未退出的,管理人有权在期限届满后将相关份额强制退出计划。

三、合同变更的效力

合同变更于2018年7月24日生效。如果在2018年7月24日后,同意变更的委托人人数达到集合计划的存续条件(委托人不少于2人),本集合计划将继续运作。否则,本集合计划进入终止程序。

本公告及《东证融汇汇享23号集合资产管理计划集合资产管理合同变更征询意见函》构成变更后合同的组成部分。委托人、管理人和托管人无需就本次合同变更另行签字。合同变更后,委托人、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。感谢委托人一贯的支持。

东证融汇证券资产管理有限公司客户服务电话:
021-20361067

附件:

1、东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划集合资产管理合同(第一次修订)

2、东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划说明书（第一次修订）

3、东证融汇汇享 23 号集合资产管理计划风险揭示书（第一次修订）

东证融汇证券资产管理有限公司

2018 年 7 月 9 日