

## 关于华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划资产管理合同合并、变更的征询意见函 及临时开放期设置公告

尊敬的投资者：

为了保护投资者利益，方便投资者查阅合同文件，我司将对《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划资产管理合同》、《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划资产管理合同补充协议》及《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划托管协议》（合同编号：HXDJ-2020 第 5 号-XG001）中的部分条款进行修改进行合并，并对合并后的《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXDJ-2020 第 5 号）的“管理费、投资经理的基本信息、信息披露”等部分条款及事项进行变更和说明；《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划托管协议》（合同编号：HXDJ-2020 第 5 号-XG001）中的部分条款进行修改，《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划说明书》、《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划风险揭示书》作为主合同的组成部分同步作变更，并按照合同约定向全体委托人征询意见。

我司确认并承诺更新或修改的内容不违反法律法规和中国证监会的有关规定，不损害投资者利益。我司与托管人(宁波银行股份有限公司)协商确认，通过签署《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXDJ-2020 第 5-1 号）（以下简称《资管合同》）的方式对《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXDJ-2020 第 5 号）内容进行更新或修改；通过签署《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划托管协议》（合同编号：HXDJ-2020 第 5 号-XG001）（以下简称《托管协议》）的方式对《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划托管协议》（合同编号：HXDJ-2020 第 5 号）内容进行更新或修改；《资产管理合同》及《托管协议》变更或修改的重要条款如下所示：

《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划资产管理合同》变更的条款如下：	
变更前的条款	变更后的条款
《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXDJ-2020 第 5 号）	《华鑫证券东家 5 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXDJ-2020 第 5-1 号）
<b>第一节 前言</b>	
管理人对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。	管理人对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案。
<b>第四节 当事人的权利与义务</b>	
<b>三、管理人的权利和义务</b> （一）管理人的权利  5、按照法律法规和本合同及《说明书》的约定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合	<b>三、管理人的权利和义务</b> （一）管理人的权利  5、按照法律法规和本合同及《说明书》的约定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合



<p>理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的,应当及时采取措施制止,并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会。</p>	<p>同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的,应当及时采取措施制止,并报告中国证监会相关派出机构。</p>
<p><b>三、管理人的权利和义务</b></p> <p>(二) 管理人的义务</p> <p>28、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并及时向投资者和托管人报告。</p>	<p><b>三、管理人的权利和义务</b></p> <p>(二) 管理人的义务</p> <p>28、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会相关派出机构、投资者和托管人。</p>
<p><b>第六节、资产管理计划的募集</b></p>	
<p><b>五、投资范围和投资组合设计</b></p> <p>(二) 管理费率:</p> <p>本集合计划的管理费率为【0.7】%/年,管理费由集合计划财产承担。集合计划管理费每日计提,按自然季支付。经管理人与托管人双方核对无误后,由托管人根据管理人划款指令于次季度首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性划款给管理人。具体计算公式详见本合同第二十节。</p>	<p><b>五、投资范围和投资组合设计</b></p> <p>(二) 管理费率:</p> <p>本集合计划的管理费率为【0.5】%/年,管理费由集合计划财产承担。集合计划管理费每日计提,按自然季支付。经管理人与托管人双方核对无误后,由托管人根据管理人划款指令于次季度首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性划款给管理人。具体计算公式详见本合同第二十节。</p>
<p><b>第七节 集合计划的成立与备案</b></p>	
<p><b>一、集合计划成立的条件和日期</b></p> <p>集合计划的参与资金总额不低于1,000万元人民币且其投资者的人数为2人(含)以上且不超过200人,并募集金额缴足之日起10个工作日内,经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后,管理人通过管理人网站宣布本集合计划成立。</p> <p>管理人在本集合计划成立之日起5个工作</p>	<p><b>一、集合计划成立的条件和日期</b></p> <p>集合计划的参与资金总额不低于1,000万元人民币且其投资者的人数为2人(含)以上且不超过200人,并募集金额缴足之日起10个工作日内,经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后,管理人通过管理人网站宣布本集合计划成立。</p> <p>管理人在本集合计划成立之日起5个工作</p>

<p>日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报送证券投资基金业协会备案，并抄送中国证监会相关派出机构。</p> <p>资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。</p> <p>本集合计划完成备案前，投资者的参与资金不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</p>	<p>内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料向证券投资基金业协会备案。</p> <p>资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。</p> <p>本集合计划完成备案前，投资者的参与资金不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</p>
<p><b>第十一节、资产管理计划的投资</b></p>	
<p><b>(二) 投资程序</b></p> <p><b>1、投资决策程序</b></p> <p>公司资产管理业务投资管理实行分级授权管理制度，每一层级的投资决策主体在各自的授权范围内行使相应的职权。具体投资决策程序如下：</p> <p>1) 管理人资产管理业务委员会审定年度投资策略报告。</p> <p>2) 资产管理投资决策小组根据资产管理业务委员会授权，不定期召开会议，审定资产管理业务阶段性投资策略报告。</p> <p>3) 资产管理业务相关投资负责人组织各投资经理实施具体投资计划，投资经理定期将所管理产品的投资决策执行和投资运作情况报告投资决策小组。</p> <p><b>2、投资交易程序</b></p> <p>管理人设置独立的交易岗，投资主办人下达的投资指令通过交易岗实施。交易岗接到投</p>	<p><b>(二) 投资程序</b></p> <p><b>1、投资决策程序</b></p> <p>公司资产管理业务投资管理实行分级授权管理制度，每一层级的投资决策主体在各自的授权范围内行使相应的职权。具体投资决策程序如下：</p> <p>资产管理业务相关投资负责人组织各投资经理实施具体投资计划，投资经理定期将所管理产品的投资决策执行和投资运作情况报告投资决策小组。</p> <p><b>2、投资交易程序</b></p> <p>(1) 投资方式：委托财产的具体管理与运用由管理人、投资顾问（如有）、托管行共同完成，并由各方根据资管计划文件和相关合同的规定履行各自的职责。管理人根据投资顾问的投资建议，通过管理人审查后，进行本资管计划的投资运作，管理人执行投资顾问提供的投资建议，所形成的损失由委托资产承担。</p>

<p>资主办人的投资指令后,根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查,确保投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。</p>	<p>(2) 具体的投资实施: 管理人根据本合同中关于委托财产运用范围和投资比例的规定自行进行投资。</p> <p>(3) 独立的执行: 管理人设置独立的集中交易室, 通过严格的交易制度和风险监控功能, 保证投资经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。</p>
<p><b>五、投资范围和投资组合设计</b></p> <p>5、本计划存续期间, 为规避特定风险并经全体投资者同意的, 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 个月低于计划总资产 80%, 管理人应详细列明上述相关特定风险。上述相关特定风险包括但不限于以下内容:</p> <p>(1) 市场风险, 指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动, 导致收益水平变化, 产生风险。(2) 流动性风险, 资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因, 不能迅速转变成现金, 或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的的风险。</p> <p>投资者在此同意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关系, 将遵循客户利益优先原则, 交易完成 5 个工作日内, 管理人应当书面通知托管人, 通过管理人的网站告知投资者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><b>五、投资范围和投资组合设计</b></p> <p>5、本计划存续期间, 为规避特定风险并经全体投资者同意的, 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 个月低于计划总资产 80%, 管理人应详细列明上述相关特定风险。上述相关特定风险包括但不限于以下内容:</p> <p>(1) 市场风险, 指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动, 导致收益水平变化, 产生风险。(2) 流动性风险, 资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因, 不能迅速转变成现金, 或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的的风险。</p> <p>投资者在此同意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关系, 将遵循客户利益优先原则, 交易完成 5 个工作日内, 管理人应当书面通知托管人, 通过管理人的网站告知投资者, 并向中国证监会相关派出机构报告, 投资于证券期货的关联交易还应当</p>

<p>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，并采取切实有效的措施，防范利益冲突，保护客户合法权益。管理人承诺不以本集合计划的资金，直接或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，或与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。</p>	<p>向证券期货交易所报告，并采取切实有效的措施，防范利益冲突，保护客户合法权益。管理人承诺不以本集合计划的资金，直接或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，或与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。</p>
<p style="text-align: center;"><b>七、投资决策与风险控制</b></p> <p>5、外部风险监督</p> <p>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、监管机构以及投资者的监督。</p> <p>1) 托管人的监督</p> <p>托管人监督管理人对集合计划的运作，发现管理人违反法律、法规和《集合资产管理合同》、托管协议的约定进行投资的，托管人有权对违反法律、法规和《集合资产管理合同》、托管协议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，并及时向投资者通报、向基金业协会及监管机构报告。托管人对本集合计划的清算估值进行复核、审查，按季编制集合计划托管报告，并报基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p>	<p style="text-align: center;"><b>七、投资决策与风险控制</b></p> <p>5、外部风险监督</p> <p>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、监管机构以及投资者的监督。</p> <p>1) 托管人的监督</p> <p>托管人监督管理人对集合计划的运作，发现管理人违反法律、法规和《集合资产管理合同》、托管协议的约定进行投资的，托管人有权对违反法律、法规和《集合资产管理合同》、托管协议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，并及时向投资者通报、向监管机构报告。托管人对本集合计划的清算估值进行复核、审查，按季编制集合计划托管报告。</p>
<p><b>第十四节</b></p>	<p><b>利益冲突及关联交易</b></p>
<p>投资者在此同意授权管理人可以将资产管理计划的资产从事重大关联交易，管理人应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和</p>	<p>投资者在此同意授权管理人可以将资产管理计划的资产从事重大关联交易，管理人应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约</p>

<p>合同约定，遵循投资者利益优先原则，交易完成5个工作日内，管理人应书面通知托管人，并书面告知投资者关联交易的投资标的等相关内容，并向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告，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。</p>	<p>定，遵循投资者利益优先原则，交易完成5个工作日内，管理人应书面通知托管人，并书面告知投资者关联交易的投资标的等相关内容，并向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。</p>
<p><b>第十五节、投资经理的指定与变更</b></p>	
<p style="text-align: center;">(二) 投资主办人简历</p> <p><b>杨镭</b></p> <p>投资经理，中国科学技术大学概率论与数理统计学学士、中山大学岭南学院管理学硕士，具有十年证券从业经验，曾先后就职于平安人寿保险、平安证券、华鑫证券等多家金融机构，长期从事量化研究、投资等相关工作，熟悉市场上各类投资品种，擅长CTA、股指期货等衍生品的量化建模与投资。</p> <p>取得基金从业资格，最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。</p>	<p style="text-align: center;">(二) 投资主办人简历</p> <p><b>赵睿</b></p> <p>投资经理，利物浦大学金融数学学士，伦敦卡斯商学院数理金融与交易硕士，曾先后任职于浙江温州鹿城农商银行和华融证券固定收益部门，历任银行自营、资管投资经理和券商资管投资主办人，长期从事一线固收交易与投资工作，具有资深固定收益投资经验。</p> <p>取得基金从业资格，最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。</p> <p><b>袁馨</b></p> <p>投资经理，宁波大学金融与保险学系学士、北京大学国家发展研究院金融学硕士，具有四年证券从业经验，曾先后就职于天风证券股份有限公司、东证融汇证券资产管理有限公司(原东北证券股份有限公司上海分公司)，历任自营交易、投资经理助理、投资主办人。</p> <p>取得基金从业资格，最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。</p>
<p><b>二、投资主办与变更</b></p> <p>集合计划存续期间，若负责集合资产管理业务的投资主办人员发生变更，管理人应当以</p>	<p><b>二、投资主办与变更</b></p> <p>集合计划存续期间，若负责集合资产管理业务的投资主办人员发生变更，管理人应当以管理</p>

<p>管理人网站公告方式及时向客户披露,并报中国证券投资基金业协会备案,同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p>	<p>人网站公告方式及时向客户披露,并向中国证券投资基金业协会备案。</p>
<p><b>第十八节 越权交易的界定</b></p>	
<p><b>二、越权交易的处理程序</b></p> <p>(一)管理人应向托管人主动报告越权交易,在限期内,托管人有权随时对通知事项进行复查,督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的,托管人有权报告管理人住所地中国证监会派出机构。</p> <p>(二)托管人发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同、以及托管协议约定的,应当要求其改正;未能改正的,应当拒绝执行,并有权及时报告管理人住所地中国证监会派出机构。</p> <p>(三)越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担,所发生的收益归本集合计划财产所有。</p>	<p><b>二、越权交易的处理程序</b></p> <p>(一)管理人应向托管人主动报告越权交易,在限期内,托管人有权随时对通知事项进行复查,督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的,托管人有权报告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。</p> <p>(二)托管人发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同、以及托管协议约定的,应当要求其改正;未能改正的,应当拒绝执行,并有权及时报告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。</p> <p>(三)越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担,所发生的收益归本集合计划财产所有。</p>
<p><b>第十九节 资产管理计划财产的估值和会计核算</b></p>	
<p>(二) 债券估值方法</p> <p>1、在证券交易所市场挂牌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,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。</p> <p>2、在证券交易所市场挂牌未实行净价交</p>	<p>(二) 固定收益品种的估值方法</p> <p>本节所指的固定收益品种,是指在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、商业银行金融债、可转换债券、中小企业私募债、证券公司短期债、资产支持证券(票据)、非公开定向债务融资工具、同业存单等债券品种。</p> <p>1、交易所市场交易品种估值处理</p>

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，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

3、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，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4、在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据中债估值为主，同时参考中证估值、CFETS估值和上清所估值等第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

5、在交易所挂牌转让的资产支持专项计划、资产支持证券（票据），按成本估值，每日计提收益。管理人应持续评估上述估值方法的适当性，并在情况发生变化时进行适当的调整。

6、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。

7、商业银行理财计划、信托计划、保险公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、证券公司资产管理计划等按照最近公布的份额净值估值；如未公布产品份额净值，管理人将按照成本价估值。

### （三）证券投资基金估值方法

1、持有的交易所基金，按估值日其所在

（1）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（3）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；

（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券（票据）和私募债券，鉴于目前尚不存在活跃市场而采用成本法估值。

（5）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估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

### 3、银行间市场交易品种估值处理

（1）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。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期

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，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，估值日证券投资基金管理人提供单位净值的，按证券投资基金管理人提供的估值日单位净值估值；估值日证券投资基金管理人未提供单位净值，且从最近净值提供日到估值日整体市场环境及投资标的未发生重大变化的，可参考最近可获取的单位净值确定公允价值。

3、私募投资基金，按估值日的份额净值估值，若估值日私募基金未公布份额净值，按最近公布的份额净值估值。

3、持有的货币市场基金，按基金公司公布的当日的每万份收益逐日计提收益；估值日无公布的，按最近交易日公布的每万份收益逐日计提收益估值。

(四) 银行定期存款或通知存款估值方法  
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计提利息。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。

#### (五) 交易所交易衍生品的估值方法

交易所交易的衍生品或具有衍生品性质的其他合约(如:股票期权、股指期货、国债期货、商品期货合约等)，按估值日交易所公布的当日结算价估值；估值日无交易，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，

所对应的价格进行估值。

(2) 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。

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、基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方机构为提供估值价格的，按成本估值。

6、商业银行理财计划、信托计划、保险公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、证券公司资产管理计划等按照最近公布的份额净值估值；如未公布产品份额净值，管理人将按照成本价估值。

#### 7、银行定期存款或通知存款估值方法

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计提利息。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。

#### 8、交易所交易衍生品的估值方法

交易所交易的衍生品或具有衍生品性质的其他合约(如:股票期权、股指期货、国债期货、商品期货合约等)，按估值日交易所公布的当日结算价估值；估值日无交易，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的结算价估值；如最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的，应采取相应的衍生品估值模型，确定公允价值。

9、逆回购以成本列示，按照预期收益率逐

<p>按最近交易日的结算价估值;如最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的,应采取相应的衍生品估值模型,确定公允价值。</p> <p>(六) 逆回购以成本列示,按照预期收益率逐日计提利息。</p> <p>(七) 债券计提每日利息,股票红利按税后计算投资收益。</p> <p>(八) 如有新增事项或变更事项,按国家最新规定估值。</p> <p>(九) 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,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。</p> <p>(十) 当市场发生极端的流动性不足或者证券被停牌,合同终止无法变现的资产处理由合同各方根据相关法律法规,视具体情况就资产变现、估值等事宜协商解决。</p> <p>(十一) 如管理人或托管人发现计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。</p> <p>(十二) 根据有关法律法规,资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任。</p>	<p>日计提利息。</p> <p>10、持有的货币市场基金,每日按基金公司公布的当日的每万份收益逐日计提收益;估值日无公布的,按最近交易日公布的每万份收益逐日计提收益估值。</p> <p>11、如有新增事项或变更事项,按国家最新规定估值。</p> <p>12、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,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。</p> <p>13、当市场发生极端的流动性不足或者证券被停牌,合同终止无法变现的资产处理由合同各方根据相关法律法规,视具体情况就资产变现、估值等事宜协商解决。</p> <p>14、如管理人或托管人发现计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。</p> <p>15、根据有关法律法规,资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任。</p>
<p><b>第二十章、集合计划的费用与税收</b></p>	
<p>一、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式</p>	<p>一、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式</p>

<p>(一) 管理人的管理费</p> <p>集合计划管理费按照集合计划资产净值的【0.7%】年费率计算, 计算方法如下:</p> $H = E \times 0.7\% / 365$ <p>H 为每日应支付的管理费</p> <p>E 为前一日集合计划资产净值</p> <p>本计划成立之日起, 资产管理费每日计提, 按【季】支付, 经管理人与托管人双方核对无误后, 由托管人根据管理人划款指令于【次季度】首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性划款给管理人, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延, 若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。</p> <p>资产管理人指定收取管理费的银行账户为:</p> <p>账户名称: 华鑫证券有限责任公司          账号: 0764152322000913          开户行: 上海浦东发展银行徐汇支行</p>	<p>(一) 管理人的管理费</p> <p>集合计划管理费按照集合计划资产净值的【0.5%】年费率计算, 计算方法如下:</p> $H = E \times 0.5\% / 365$ <p>H 为每日应支付的管理费</p> <p>E 为前一日集合计划资产净值</p> <p>本计划成立之日起, 资产管理费每日计提, 按【季】支付, 经管理人与托管人双方核对无误后, 由托管人根据管理人划款指令于【次季度】首日起5个工作日内从集合计划资产中一次性划款给管理人, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延, 若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。</p> <p>资产管理人指定收取管理费的银行账户为:</p> <p>账户名称: 华鑫证券有限责任公司          账号: 0764152322000913          开户行: 上海浦东发展银行徐汇支行</p>
<p><b>第二十一节 资产管理计划的收益与分配</b></p>	
<p><b>五、收益分配的执行</b></p> <p>资产管理计划托管人根据资产管理计划管理人的收益分配方案和提供的红利金额的数据, 在收益分配日进行处理。</p> <p>本集合计划的收益分配方式是红利再投资方式或现金分红方式。</p> <p>分红资金按分红权益登记日的份额净值转成相应的集合计划单位。</p>	<p><b>五、收益分配的执行</b></p> <p>资产管理计划托管人根据资产管理计划管理人的收益分配方案和提供的红利金额的数据, 在收益分配日进行处理。</p> <p>本集合计划的收益分配方式是红利再投资方式或现金分红方式。</p> <p>投资者若未进行选择, 则默认分红方式为: 红利再投资</p> <p>采取现金分红方式的, 在该收益分配日之日起2个工作日内, 将现金红利划转到投资者的交易账户; 采取红利再投资方式的, 分红资金按分红权益登记日的份额净值转成相应的集合计划</p>

	<p>单位。</p> <p>分红资金按分红权益登记日的份额净值转成相应的集合计划单位。</p>
<p><b>第二十二节 信息披露与报告</b></p>	
<p><b>一、定期报告</b></p> <p>(二)集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告。</p> <p>管理人、托管人在每季度分别提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度截止日后1个月内通过管理人网站向投资者披露，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。集合计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的，管理人、托管人可以不编制当期的季度报告。</p>	<p><b>一、定期报告</b></p> <p>(二)集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告。</p> <p>管理人、托管人在每季度分别提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度截止日后1个月内通过管理人网站向投资者披露。集合计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的，管理人、托管人可以不编制当期的季度报告。</p>
<p>(三)集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人、托管人在每年度分别提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后4个月内通过管理人网站通告，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。集合计划成立不足3个月时，管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。</p>	<p>(三)集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人、托管人在每年度分别提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后4个月内通过管理人网站披露。集合计划成立不足3个月时，管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。</p>
<p>(四) 年度审计报告</p>	<p>(四) 年度审计报告</p>

<p>管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合资产管理计划的运营情况进行年度审计,并在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给托管人,通过管理人网站向投资者披露,并报中国证券投资基金业协会备案,同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p>	<p>管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合资产管理计划的运营情况进行年度审计,并在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给托管人,通过管理人网站向投资者披露,并报管理人住所地中国证监会派出机构。</p>
<p><b>二、临时报告</b></p> <p>集合计划存续期间,发生对集合计划持续运营、客户利益、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个工作日内以管理人网站公告方式及时向投资者披露(其中第七条重大违法违规发生之日起两个工作日内),并报中国证券投资基金业协会备案,同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。临时报告的情形包括但不限于:</p> <p>(一)集合计划运作过程中,负责集合资产管理业务的投资主办人员发生变更,或出现其他可能对集合计划的持续运作、投资者利益、资产净值产生重大影响的事项。</p> <p>(二)发生巨额退出并延期支付。</p> <p>(三)集合计划终止和清算。</p> <p>(四)合同的补充、修改与变更。</p> <p>(五)与集合计划有关的重大诉讼、仲裁、财产纠纷事项。</p> <p>(六)集合计划投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券。</p> <p>(七)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。</p>	<p><b>二、临时报告</b></p> <p>集合计划存续期间,发生对集合计划持续运营、客户利益、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个工作日内以管理人网站公告方式及时向投资者披露(其中第七条重大违法违规发生之日起两个工作日内),除以下第二项报送中国证券投资基金业协会备案以外,其他事项报送管理人住所地中国证监会派出机构。临时报告的情形包括但不限于:</p> <p>(一)集合计划运作过程中,负责集合资产管理业务的投资主办人员发生变更,或出现其他可能对集合计划的持续运作、投资者利益、资产净值产生重大影响的事项。</p> <p>(二)发生巨额退出并延期支付。</p> <p>(三)集合计划终止和清算。</p> <p>(四)合同的补充、修改与变更。</p> <p>(五)与集合计划有关的重大诉讼、仲裁、财产纠纷事项。</p> <p>(六)集合计划投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券。</p> <p>(七)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。</p> <p>(八)管理人、托管人因解散、破产、撤销</p>

<p>(八) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责。</p> <p>(九) 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资产管理计划，应向投资者充分披露。</p> <p>(十) 管理人因私募资产管理业务被中国证监会及相关派出机构、其他金融监督管理机构采取行政监管措施或行政处罚，或被中国证券业协会、中国期货业协会、交易场所和登记结算机构采取自律管理措施或纪律处分的，应在收到相关措施或处理决定后二个工作日内向证券投资基金业协会报告。</p> <p>(十一) 其他管理人认为的重大事项。</p>	<p>等原因不能履行相应职责。</p> <p>(九) 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资产管理计划，应向投资者充分披露。</p> <p>(十) 管理人因私募资产管理业务被中国证监会及相关派出机构、其他金融监督管理机构采取行政监管措施或行政处罚，或被中国证券业协会、中国期货业协会、交易场所和登记结算机构采取自律管理措施或纪律处分的，应在收到相关措施或处理决定后二个工作日内向中国证监会及相关派出机构报告。</p> <p>(十一) 其他管理人认为的重大事项。</p>
<b>第二十四节、资产管理合同的变更、终止与清算</b>	
<p><b>一、合同的补充、修改与变更</b></p> <p>(七) 本合同发生变更的，管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。</p>	<p><b>一、合同的补充、修改与变更</b></p> <p>(七) 本合同发生变更的，管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案。</p>
<p><b>二、有下列情形之一的，集合计划应当终止：</b></p> <p>管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第(十一)项约定的情形除外。</p>	<p><b>二、有下列情形之一的，集合计划应当终止：</b></p> <p>管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，前述第(十一)项约定的情形除外。</p>
<p><b>三、集合计划的清算</b></p> <p>(四) 清算结束后 15 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果或</p>	<p><b>三、集合计划的清算</b></p> <p>(四) 清算结束后 15 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果或书面</p>

书面通知投资者清算结果。管理人应当在清算结束后 15 日内将清算结果报监管机构备案。

(五) 若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券,管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案,该方案应经托管人认可,并通过管理人网站进行披露。并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

通知投资者清算结果。管理人应当在清算结束后 5 日内将清算结果报证券投资基金业协会。

(五) 若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券,管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案,该方案应经托管人认可,并通过管理人网站进行披露。并应当及时向证券投资基金业协会报告。

**附件二 管理人关联方名单**

华鑫证券有限责任公司关联方信息表		华鑫证券有限责任公司主要关联关系信息表 (更新于 2020 年 3 月)	
序号*	名称	持有本公司 5%以上股份的股东情况	
		序号*	名称 营业执照号/统一社会信用代码(机构)/注册号(境外机构)/身份证号(个人)/护照号(外籍个人)
1	上海华鑫股份有限公司	1	上海华鑫股份有限公司 9131000013220382XX
2	上海金欣联合发展有限公司	本公司的控股股东情况	
3	上海金陵投资有限公司	序号*	名称 营业执照号/统一社会信用代码(机构)/注册号(境外机构)/身份证号(个人)/护照号(外籍个人)
4	上海择励实业有限公司	1	上海华鑫股份有限公司 9131000013220382XX
5	上海普林电路板有限公司	2	
6	上海普林电子有限公司	本公司的控股股东控制的其他子公司情况	
7	上海鑫敦实业有限公司	序号*	名称 营业执照号/统一社会信用代码(机构)/注册号(境外机构)
8	力敦行房地产经纪有限公司	1	上海金欣联合发展有限公司 91310101132352737T
9	华鑫期货有限公司	2	上海金陵投资有限公司 91310115132310625R
10	华鑫证券投资有限公司	3	上海择励实业有限公司 91310230057678883Q
11	华鑫宽众投资有限公司	4	上海普林电路板有限 310104000015714
12	摩根士丹利华鑫证券有限责 任公司		
13	摩根士丹利华鑫基金管理有 限公司		
14	上海仪电(集团)有限公司		
15	上海洪华投资发展有限公司		
16	华鑫置业(集团)有限公司		
17	上海华鑫置业集团工程咨询 有限公司		

18	上海华鑫物业管理顾问有限公司	公司	
19	上海华萃置业有限公司	5 上海普林电子有限公司	310000400435444
20	上海华田置业有限公司	6 上海鑫敦实业有限公司	9131023008009785XR
21	上海华维投资管理有限公司	7 上海力敦行房地产经纪有限公司	91310115787820407L
22	上海华鑫资产管理有限公司	8 华鑫思佰益融资租赁(上海)有限公司	91310000MA1FL02T7J
23	上海广业陕新投资管理有限公司	9 上海鑫之众投资管理有限公司	91310000MA1FL3EG5U
24	上海怡朋物业管理有限公司	10 上海全创信息科技有限公司	91310104MA1FRJB1XP
25	上海华祈资产管理有限公司	11 烟台山基金小镇(烟台)运营管理有限公司	91370602MA3QWYREXU
26	上海云赛创鑫企业管理有限公司	12 天津东疆基金管理有限公司	91120118MA06EA4NX9
27	上海电动工具研究所(集团)有限公司	<b>本公司的控股子公司及本公司能够实施重大影响的其他公司情况</b>	
28	上海电工技术交流中心	序号	名称
29	上海宝庆通用电工有限公司		营业执照号/统一社会信用代码(机构)/注册号(境外机构)
30	上海电气器具检验测试所	1	华鑫期货有限公司
31	上海松宝科技发展有限公司	2	华鑫证券投资有限公司
32	中认尚动(上海)检测技术有限公司	3	华鑫宽众投资有限公司
33	上海电动所工具研究所集团嘉善有限公司	4	摩根士丹利华鑫证券有限责任公司(49%)
34	上海怡汇投资管理有限公司	5	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司
35	云赛信息(集团)有限公司		91310000132110746J
36	上海广甸物业发展有限公司		913100000841449245
37	上海华欧投资管理有限公司		91310000351133569C
38	上海云仪电子贸易有限公司		913100007178847982
39	上海仪夏电子有限公司		91440300746637454W
40	上海仪电智能电子有限公司		
41	华仪电子有限公司(香港)		
42	上海飞乐音响股份有限公司		
43	上海联威电子有限公司		
44	云智视像科技(上海)有限公司		

45	上海仪电汽车电子系统有限公司
46	日本信息系统株式会社
47	南非SVA电子公司
48	上海仪电分析仪器有限公司
49	云赛智联股份有限公司
50	上海亿人通信终端有限公司
51	上海仪电电子印刷科技有限公司
52	上海仪电显示材料有限公司
53	苏州飞乐电子元件股份有限公司
54	香港文康电子有限公司
55	上海圣澜实业有限公司
56	深圳金陵通讯技术有限公司
57	上海仪电物联技术股份有限公司
58	上海华冠电子设备有限责任公司
59	上海仪电数字技术有限公司
60	上海仪电楼宇科技有限公司
61	上海颐东网络信息有限公司
62	上海融天投资顾问有限公司
63	仪电思佰益融资租赁(上海)有限公司
64	上海华鑫智城科技有限公司
65	上海择鑫置业有限公司
66	苏州工业园区青剑湖置业有限公司
67	上海奥仑实业有限公司
68	上海华勍企业发展有限公司
69	上海金陵置业有限公司
70	上海始安房产管理有限公司
71	上海仪电资产经营管理(集

	团)有限公司	
72	上海国盛集团资产有限公司	
73	上海仪电电子股份有限公司	

**附件四、预留印鉴授权书**

<p>华鑫证券有限责任公司（作为管理人）、宁波银行股份有限公司（作为托管人）已签署编号为HXDJ-2020第5号的《华鑫证券东家5号集合资产管理计划资产管理合同》。以下为管理人的预留印鉴，该印鉴用于集合资产管理业务运作过程中用于业务往来确认所盖印章的预留印鉴。</p>	<p>华鑫证券有限责任公司（作为管理人）、宁波银行股份有限公司（作为托管人）已签署编号为HXDJ-2020第5-1号的《华鑫证券东家5号集合资产管理计划资产管理合同》。以下为管理人的预留印鉴，该印鉴用于集合资产管理业务运作过程中用于业务往来确认所盖印章的预留印鉴。</p>
--	--

**《华鑫证券东家5号集合资产管理计划托管协议》变更的条款如下：**

<p>华鑫证券东家5号集合资产管理计划托管协议 协议编号：HXDJ-2020第5号</p>	<p>华鑫证券东家5号集合资产管理计划托管协议 协议编号：HXDJ-2020第5号-XG001</p>
---	---

**一、托管协议当事人**

<p>(一) 管理人 名称：华鑫证券有限责任公司 住所：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房 法定代表人：俞洋 成立时间：2001年3月6日 批准设立机关：中国证监会 批准设立文号：证监机构字[2001]34号 注册资本：32.7亿元 经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券自营(不含债券自营)；证券资产管理；证券投资基金代销；为</p>	<p>(一) 管理人 名称：华鑫证券有限责任公司 住所：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋20C-1房 法定代表人：俞洋 成立时间：2001年3月6日 批准设立机关：中国证监会 批准设立文号：证监机构字[2001]34号 注册资本：32.7亿元 经营范围：证券经纪；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券自营(不含债券自营)；证券资产管理；证券投资基金代销；为期货公司提</p>
--	---

<p>期货公司提供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品。</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>营业期限：持续经营</p> <p>联系人：胡文倩</p> <p>联系电话：021-54967605</p>	<p>供中间介绍业务；融资融券业务；代销金融产品。</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>营业期限：持续经营</p> <p>联系人：郑帅</p> <p>联系电话：0755-83025331</p>
<p><b>四、托管人与管理人之间的业务监督、核查</b></p>	
<p>(一) 托管人对管理人的业务监督、核查</p> <p>1、托管人根据《管理办法》、《运作管理规定》、《规范》、《资产管理合同》及本协议的规定，应自《资产管理合同》生效日起，对本集合计划的投资范围、集合计划资产的投资比例、集合计划资产核算、资产净值的计算、集合计划管理费和托管费的计提和支付，集合计划收益分配及集合计划资产清算等事项进行监督和核查。管理人应当在本集合计划成立之日起4个月内使集合计划的资产配置比例符合要求。</p> <p>管理人应向托管人提供履行托管职责所必需的相关材料，并保证向托管人提供的材料的真实性、准确性、合法合规性和完整性，由于管理人提供材料不实给托管人或集合计划财产造成的损失，由管理人承担赔偿责任。</p>	<p>(一) 托管人对管理人的业务监督、核查</p> <p>1、托管人根据《管理办法》、《运作管理规定》、《规范》、《资产管理合同》及本协议的规定，应自《资产管理合同》生效日起，对本集合计划的投资范围、集合计划资产的投资比例、集合计划资产的投资限制、集合计划资产核算、资产净值的计算、集合计划管理费和托管费的计提和支付，集合计划收益分配及集合计划资产清算等事项进行监督和核查。管理人应当在本集合计划成立之日起4个月内使集合计划的资产配置比例符合要求。</p> <p>管理人应向托管人提供履行托管职责所必需的相关材料，并保证向托管人提供的材料的真实性、准确性、合法合规性和完整性，由于管理人提供材料不实给托管人或集合计划财产造成的损失，由管理人承担赔偿责任。</p>
<p>(一) 托管人对管理人的业务监督、核查</p> <p>2、托管人发现上述事项中管理人的行为违反《管理办法》、《运作管理规定》、</p>	<p>(一) 托管人对管理人的业务监督、核查</p> <p>2、托管人发现上述事项中管理人的行为违反《管理办法》、《运作管理规定》、《规范》、《资产管理合同》及本协议的相关规</p>

<p>《规范》、《资产管理合同》及本协议的相关规定时，应及时以书面形式通知管理人限期纠正，并及时报告管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证券业协会。管理人收到通知后应及时核实并在下一工作日前以书面形式给托管人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正或者造成集合计划资产损失的，托管人应及时报告管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证券业协会。</p>	<p>定时，应及时以书面形式通知管理人限期纠正，并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构。管理人收到通知后应及时核实并在下一工作日前以书面形式给托管人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正或者造成集合计划资产损失的，托管人应及时报告管理人住所地中国证监会派出机构。</p>
<p>(二)管理人对托管人的业务监督、核查</p> <p>1、根据《管理办法》、《运作管理规定》、《规范》、《资产管理合同》及本协议有关规定，管理人对托管人是否及时执行管理人合法合规的划款指令；妥善保管集合计划的全部托管资产；托管人是否按约定执行管理人的分配指令；是否对集合计划资产实行分账管理；是否擅自动用集合计划资产等行为进行监督和核查。</p> <p>2、管理人发现托管人的行为违反《管理办法》、《运作管理规定》、《规范》、《资产管理合同》及本协议有关规定，</p>	<p>(二) 管理人对托管人的业务监督、核查</p> <p>1、根据《管理办法》、《运作管理规定》、《规范》、《资产管理合同》及本协议有关规定，管理人对托管人是否及时执行管理人合法合规的划款指令；妥善保管集合计划的全部托管资产；托管人是否按约定执行管理人的分配指令；是否对集合计划资产实行分账管理；是否擅自动用集合计划资产等行为进行监督和核查。</p> <p>2、管理人发现托管人的行为违反《管理办法》、《运作管理规定》、《规范》、《资产管理合同》及本协议有关规定，应及时以书面形式通知托管人限期纠正，并及时</p>

应及时以书面形式通知托管人限期纠正，并及时报告管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证券业协会。托管人收到通知后应及时核对并在下一工作日前以书面形式给管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，管理人有权随时对通知事项进行复查。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，管理人应报并及时报告管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证券业协会。

(三) 托管人与管理人在业务监督、核查中的配合与协助

管理人和托管人有义务相互配合和协助对方依照本协议对集合计划业务执行监督、核查。管理人或托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告管理人住所地中国证监会派出机构并及时报告管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证券业协会。

报告管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券业协会。托管人收到通知后应及时核对并在下一工作日前以书面形式给管理人发出回函，说明违规原因及纠正期限，并保证在规定期限内及时改正。在限期内，管理人有权随时对通知事项进行复查。托管人对管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，管理人应报并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构。

(三) 托管人与管理人在业务监督、核查中的配合与协助

管理人和托管人有义务相互配合和协助对方依照本协议对集合计划业务执行监督、核查。管理人或托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告管理人住所地中国证监会派出机构并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构。

五、集合计划资产保管

(四) 集合计划证券账户的开立和管理  
集合计划账户、专用交易单元应由

(四) 集合计划证券账户的开立和管理  
集合计划账户、专用交易单元应由集

<p>集合计划管理人当报证券交易所、证券登记结算机构以及证券公司住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证券业协会备案。</p>	<p>合计划管理人当报证券交易所、证券登记结算机构以及中国证券业协会备案。</p>
<p><b>九、资产估值、净值计算与会计核算</b></p>	
<p>(六) 集合计划财务报表与报告的编制和复核</p> <p>3、报表的编制与复核时间安排</p> <p>管理人、托管人在每季度分别提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度截止日后1个月内通过管理人网站向投资者披露，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。集合计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的，管理人、托管人可以不编制当期的季度报告。</p> <p>管理人、托管人在每年度分别提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后4个月内通过管理人网站通告披露，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。集合计划成立不足3个月时，管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。</p>	<p>(六) 集合计划财务报表与报告的编制和复核</p> <p>3、报表的编制与复核时间安排</p> <p>管理人、托管人在每季度分别提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度截止日后1个月内通过管理人网站向投资者披露，并报中国证券投资基金业协会备案。集合计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的，管理人、托管人可以不编制当期的季度报告。</p> <p>管理人、托管人在每年度分别提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后4个月内通过管理人网站通告，并报中国证券投资基金业协会备案。集合计划成立不足3个月时，管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。</p> <p>季度报告和年度报告由资产管理人报中国证券投资基金业协会备案。</p>

<p>季度报告和年度报告由资产管理人报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p>	
<p><b>第十九节 其他事项</b></p>	
<p>除本协议有明确定义外，本协议的用语定义适用《资产管理合同》相同用语的约定。本协议未尽事宜，当事人依据《资产管理合同》、有关法律、法规等规定协商办理。本协议规定与《资产管理合同》不一致的，以本协议为准。</p>	<p>除本协议有明确定义外，本协议的用语定义适用《资产管理合同》相同用语的约定。本协议未尽事宜，当事人依据《资产管理合同》、有关法律、法规等规定协商办理。本协议规定与《资产管理合同》不一致的，以《资产管理合同》为准。</p>

管理人通过网站公告本函件向各投资者征询意见。

我司将设置临时开放期合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利，临时开放期为2020年12月21日，共1个工作日。

投资者应在临时开放期内以邮件形式发送至我司邮箱：zcg1b@cfsc.com.cn，回复意见。

投资者不同意变更的，可在临时开放期内提出退出本集合计划的申请，投资者在临时开放期内提出的退出申请将于最近一次开放期首日进行确认；投资者未在临时开放期内回复意见或未在临时开放期内提出退出本集合计划申请的，视为投资者同意合同变更。如投资者同意变更，则变更事项自征询意见函（或通知）在临时开放期届满的最后一工作日，对合同各方均具有法律效力。

## 二、合同变更的效力及生效时间

本征询公告构成变更后合同的组成部分，变更后的合同及托管协议将于2020年12月22日（含）正式生效。

如有疑问，请拨打客服热线：95323。

特此公告。



