

关于华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同变更的征询意见函

及临时开放期设置公告

尊敬的投资者：

由华鑫证券有限责任公司(以下简称“我司”)管理的“华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划”成立于 2019 年 8 月 1 日。为给投资者提供更专业的资产管理服务，我司拟对《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(合同编号：HXXG-2019 第 2 号)的“投资策略、投资范围、投资比例和投资限制、利益冲突及关联交易、投资经理、单位净值估值日、估值方法、资产管理计划的收益与分配、合同的补充、修改与变更、管理人关联方名单”等部分条款及事项进行变更和说明，《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划说明书》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《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(合同编号：HXXG1H-2020 第 1 号)(以下简称《资管合同》)的方式对《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(合同编号：HXXG-2019 第 2 号)内容进行更新或修改。

一、 主要变更事项的说明

(一) 华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同(合同编号：HXXG1H-2020 第 1 号)

本次合同变更主要内容如下，详细修订内容详见“第二章、华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同修订前后款对照表”：

- (1) 投资范围、投资比例和投资限制
- (2) 修改投资经理的信息；
- (3) 修改收益分配方式；
- (4) 修改合同变更事项；
- (5) 修改单位净值估值时间；
- (6) 估值方式；
- (7) 更新管理人关联方名单；

修改后的资产管理合同请参见华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同(合同编号：HXXG1H-2020 第 1 号)。

(二) 华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划说明书

《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划说明书》对相应资产管理合同同步变更。

二、 华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同修订前后款对照表

变更前的条款	变更后的条款
--------	--------

华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同 (编号: HXXG-2019 第 2 号)		华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同 (编号: HXXG1H-2020 第 1 号)									
第一节、前言											
为规范华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划的运作,明确《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”/“资产管理合同”/“电子合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司客户资产管理业务规范》(以下简称《业务规范》)、《私募投资基金监督管理暂行办法》(以下简称《私募管理暂行办法》)、《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》)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作管理规定》)等法律法规、中国证监会、中国证券业协会和中国证券投资基金业协会的有关规定,委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,当事人按照《管理办法》、《运作管理规定》、《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。 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。 证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任,也不代表证券投资基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。		为规范华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划的运作,明确《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”/“资产管理合同”/“电子合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司客户资产管理业务规范》(以下简称《业务规范》)、《私募投资基金监督管理暂行办法》(以下简称《私募管理暂行办法》)、《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》)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作管理规定》)等法律法规、中国证监会、中国证券业协会和中国证券投资基金业协会的有关规定,委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,当事人按照《管理办法》、《运作管理规定》、《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。 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。 证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任,也不代表证券投资基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。									
第二节 释 义											
<table><tr><td>家庭金融总资产</td><td>指全体家庭成员共同共有的全部金融资产,包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债。</td></tr><tr><td>资产管理产品</td><td>指《指导意见》规定的资产管理产品,包括但不限于人民币或外币形式的银行非保本理财产品,资金信</td></tr></table>		家庭金融总资产	指全体家庭成员共同共有的全部金融资产,包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债。	资产管理产品	指《指导意见》规定的资产管理产品,包括但不限于人民币或外币形式的银行非保本理财产品,资金信	<table><tr><td>家庭金融总资产</td><td>指全体家庭成员共同共有的全部金融资产,包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债。</td></tr><tr><td>资产管理产品</td><td>指《指导意见》规定的资产管理产品,包括但不限于人民币或外币形式的银行非保本理财产品,资金信</td></tr></table>		家庭金融总资产	指全体家庭成员共同共有的全部金融资产,包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债。	资产管理产品	指《指导意见》规定的资产管理产品,包括但不限于人民币或外币形式的银行非保本理财产品,资金信
家庭金融总资产	指全体家庭成员共同共有的全部金融资产,包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债。										
资产管理产品	指《指导意见》规定的资产管理产品,包括但不限于人民币或外币形式的银行非保本理财产品,资金信										
家庭金融总资产	指全体家庭成员共同共有的全部金融资产,包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债。										
资产管理产品	指《指导意见》规定的资产管理产品,包括但不限于人民币或外币形式的银行非保本理财产品,资金信										

	托，证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基金管理子公司、期货公司、期货公司子公司、保险资产管理机构、金融资产投资公司发行的资产管理产品等。		托，证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基金管理子公司、期货公司、期货公司子公司、保险资产管理机构、金融资产投资公司发行的资产管理产品等。
		投资指令	指划款指令

第三节 声明与承诺

委托人承诺：

1. 符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

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资产管理计划，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，投资于本计划将自行承担投资风险。

4. 委托人承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构报告涉嫌恐怖融资的可疑交易管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》等相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺出示真实有效的身份证明文件及相关账户信息，积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动，配合管理人开展非居民金融账户涉税信息尽职调查，提供因监管机构或国家有权机关调查所需客户账户相关信息。

委托人承诺：

1. 符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

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资产管理计划，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，投资于本计划将自行承担投资风险。

4. 委托人承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构报告涉嫌恐怖融资的可疑交易管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》等相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺出示真实有效的身份证明文件及相关账户信息，积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动，配合管理人开展非居民金融账户涉税信息尽职调查，提供因监管机构或国家有权机关调查所需客户账户相关信息。

5. 投资者投资本计划不构成多层嵌套情形，不存在以投资本计划规避投资范围、杠杆约束等监管要求等违规行为。

6. 投资者保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人对该资产管理计划财产行使投资管理权；保证有完全及合法的授权委托管理人和托管人进行资产管理计划财产的投资管理和托管业务，而且该等委托不会为任何其他第三方所质疑。

第四节 当事人的权利与义务

管理人 管理人名称：华鑫证券有限责任公司 法定代表人：俞洋 住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元 联系地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01（b）单元 联系人：王毓霆 联系电话：021-54967779 传真：0755-83025029	管理人 管理人名称：华鑫证券有限责任公司 法定代表人：俞洋 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 联系地址：上海市徐汇区肇嘉浜路 750 号华鑫证券 联系人：周文生 联系电话：021-54967791 传真：0755-83025029
二、委托人的权利和义务 （二）委托人的义务 1、委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并保证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。 2、按照本合同及《说明书》约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬、托管费、审计费、税费等合理费用。 3、按本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失。 4、接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承受能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件。 5、除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源。 6、委托人应向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作。委托人为法人或者依法成立的其他组织并用筹集的资金参与资产管理计划的，应当提供合法筹集资金的证明文件，以协助销售机构开展反洗钱工作。 7、认真阅读并签署风险揭示书。 8、在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任。 9、不得违规转让其所拥有的计划份额。 10、不得违反本合同约定干涉管理人的投资行为和托管人的托管行为。 11、不得从事任何有损集合计划及其他委托人、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动。 12、保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕	二、委托人的权利和义务 （二）委托人的义务 1、委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并保证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。 2、按照本合同及《说明书》约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬、托管费、审计费、税费等合理费用。 3、按本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失。 4、接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承受能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件。 5、除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源。 6、委托人应向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作。委托人为法人或者依法成立的其他组织并用筹集的资金参与资产管理计划的，应当提供合法筹集资金的证明文件，以协助销售机构开展反洗钱工作。 7、认真阅读并签署风险揭示书。 8、在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任。 9、不得违规转让其所拥有的计划份额。 10、不得违反本合同约定干涉管理人的投资行为和托管人的托管行为。 11、不得从事任何有损集合计划及其他委托人、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动。 12、保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕

交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动。 13、委托人应当采取有效措施妥善保管与电子签名合同有关的信息和资料,防止他人以委托人名义实施电子签名行为。 14、接受合格投资者认定程序,如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷,如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况,并对其真实性、准确性和完整性负责,签署合格投资者相关文件。 15、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《说明书》约定的其他义务。	交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动。 13、委托人应当采取有效措施妥善保管与电子签名合同有关的信息和资料,防止他人以委托人名义实施电子签名行为。 14、接受合格投资者认定程序,如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷,如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况,并对其真实性、准确性和完整性负责,签署合格投资者相关文件。 15、在本计划存续期间及时关注管理人的短信、电话、邮件、传真以及其公司网站公告。 16、理解并同意承担资产管理计划财产的投资、运作、托管面临包括但不限于本合同第二十四章“风险揭示”以及风险揭示书中列举的各类风险。 17、投资者以其管理的私募资产管理产品投资于本资产管理计划的,该产品的所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者且资产管理计划财产来源合法合规;如相关监管机构或自律组织要求管理人提供本计划向上穿透后的投资者信息资料表的,投资者应配合提供;投资者承诺投资本计划后不存在违反监管要求的产品嵌套,以及以投资本计划从事规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道业务等违法违规行为。 18、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《说明书》约定的其他义务。
三、管理人的权利和义务 (一) 管理人的权利 1、根据本合同及《说明书》的约定,独立管理和运用资产管理计划财产。 2、根据本合同及《说明书》的约定,及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬。 3、按照本合同及《说明书》的约定,停止办理集合计划的参与,暂停办理集合计划的退出事宜。 4、根据本合同及《说明书》的约定,终止本集合计划的运作。 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。 6、按照法律法规和本合同及《说明书》的约定,行使因资产管理计划财产投资所产生的权利。 7、自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务,并对其行为进行必要的监督和检查。	三、管理人的权利和义务 (一) 管理人的权利 1、根据本合同及《说明书》的约定,独立管理和运用资产管理计划财产。 2、根据本合同及《说明书》的约定,及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬。 3、按照本合同及《说明书》的约定,停止办理集合计划的参与,暂停办理集合计划的退出事宜。 4、根据本合同及《说明书》的约定,终止本集合计划的运作。 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。 6、按照法律法规和本合同及《说明书》的约定,行使因资产管理计划财产投资所产生的权利。 7、自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务,并对其行为进行必要的监督和检查。

8、以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利。 9、集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任。 10、有权获得投资顾问（如有）的投资建议服务，并对其提供的投资建议有审议、修改和最终的决策权。 11、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。 （二）管理人的义务 1、按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息。 2、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，配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划资产，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。 3、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。 4、办理资产管理计划的销售、登记备案或者注册手续。 5、对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金 6、制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险。 7、建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制。 8、除依据法律法规、本合同、《说明书》的约定及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产。 9、保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外。 10、公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。 11、除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资。 12、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。 13、按照资产管理合同约定，进行资产估值等会计核算并编制产品财务会计报告。 14、聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计 15、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。	8、以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利。 9、集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任。 10、有权获得投资顾问（如有）的投资建议服务，并对其提供的投资建议有审议、修改和最终的决策权。 11、管理人有权根据市场情况对本资产管理计划的总规模、单个投资者首次参与金额、追加参与金额及持有的本计划总金额限制进行调整，但应符合法律法规的规定。 12、有权对投资者进行尽职调查，要求投资者提供相关证明文件、资料，并在上述文件和资料发生变更时，及时提交变更后的相关文件与资料。 13、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。 （二）管理人的义务 1、按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息。 2、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，配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划资产，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。 3、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。 4、办理资产管理计划的销售、登记备案或者注册手续。 5、对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金 6、制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险。 7、建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制。 8、除依据法律法规、本合同、《说明书》的约定及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产。 9、保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外。 10、公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。 11、除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资。 12、按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时
--	--

16、办理与资产管理计划业务有关的信息披露事项。 17、根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，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。 18、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。 19、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。 20、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，接受投资者和托管人的监督。 21、不得以受托管理的资产管理计划份额进行质押融资，放大杠杆。 22、对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告 23、依法对托管人、销售机构的行为进行监督，如发现托管人、代理销售机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、代理销售协议的，应当予以制止。 24、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。 25、按照法律法规、中国证监会的有关规定和《集合资产管理合同》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。 26、按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、销售文件、委托人资料、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年 27、在集合计划到期或其他原因解散时，组织并参加资产管理计划财产清算小组，与托管人一起妥善处理有关保管、清理、估价、变现、分配和委托人资金的返还事宜。 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委托人和托管人报告。 29、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。 30、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。 31、法律、行政法规、中国证监会的有关规定、本合同及托管协议约定的其他义务。	向委托人分配收益。 13、按照资产管理合同约定，进行资产估值等会计核算并编制产品财务会计报告。 14、聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计 15、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。 16、办理与资产管理计划业务有关的信息披露事项。 17、根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，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。 18、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。 19、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。 20、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，接受投资者和托管人的监督。 21、不得以受托管理的资产管理计划份额进行质押融资，放大杠杆。 22、对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告 23、依法对托管人、销售机构的行为进行监督，如发现托管人、代理销售机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、代理销售协议的，应当予以制止。 24、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。 25、按照法律法规、中国证监会的有关规定和《集合资产管理合同》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。 26、按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、销售文件、委托人资料、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年 27、在集合计划到期或其他原因解散时，组织并参加资产管理计划财产清算小组，与托管人一起妥善处理有关保管、清理、估价、变现、分配和委托人资金的返还事宜。 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、委托人和托管人。 29、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。
--	--

	30、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。 31、法律、行政法规、中国证监会的有关规定、本合同及托管协议约定的其他义务。
第五节 资产管理计划的基本情况	
七、集合计划份额面值 本集合计划份额的面值为人民币 1.0000 元。本计划设定为均等份额，每份计划份额具有同等的合法权益。	七、集合计划份额的初始募集面值 本集合计划份额的初始募集面值为人民币 1.0000 元。本计划设定为均等份额，每份计划份额具有同等的合法权益。
第七节 集合计划的成立与备案	
一、集合计划成立的条件和日期 集合计划的参与资金总额不低于 1,000 万元人民币且其委托人的人数为 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。 管理人在本集合计划成立之日起 5 个工作日内，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。 本集合计划完成备案前，委托人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。	一、集合计划成立的条件和日期 集合计划的参与资金总额不低于 1,000 万元人民币且其委托人的人数为 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。 管理人在本集合计划成立之日起 5 个工作日内，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向证券投资基金业协会备案。 本集合计划完成备案前，委托人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。
第十一节 资产管理计划的投资	
三、投资策略 1、债券投资策略 本计划将在保持债券组合低波动性的前提下，综合运用多种策略参与市场所提供的投资机会，以期委托人为人获取稳健的收益。 （1）久期配置策略 本计划将在分析中长期经济变化趋势的基础上，预测未来一段时间内利率可能的走向，以此来决定组合久期的长短。预期利率下降时延长组合久期，以获得因债券价格上涨而带来的资本利得；预期利率上升时缩短组合久期，以降低或规避债券价格下跌所带来的风险。 （2）收益率曲线策略 在确定组合久期后，采用收益率曲线分析模型对不同期限债券的风险收益特征进行评估，并根据对收益率曲线形状变化进行预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，来决定本计划资产在长、中、短期债券间的配置比例。 （3）债券类属配置策略	三、投资策略 1、债券投资策略 本计划将在保持债券组合低波动性的前提下，综合运用多种策略参与市场所提供的投资机会，以期委托人为人获取稳健的收益。 （1）久期配置策略 本计划将在分析中长期经济变化趋势的基础上，预测未来一段时间内利率可能的走向，以此来决定组合久期的长短。预期利率下降时延长组合久期，以获得因债券价格上涨而带来的资本利得；预期利率上升时缩短组合久期，以降低或规避债券价格下跌所带来的风险。 （2）收益率曲线策略 在确定组合久期后，采用收益率曲线分析模型对不同期限债券的风险收益特征进行评估，并根据对收益率曲线形状变化进行预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，来决定本计划资产在长、中、短期债券间的配置比例。 （3）债券类属配置策略

根据国债、金融债、企业债等不同债券间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，借以取得较高收益。 (4) 骑乘策略 通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的债券，随着本计划持有债券时间的延长，债券的剩余期限将缩短，到期收益率将下降，从而获得资本利得收入。 (5) 信用债投资策略 本计划根据对宏观经济运行周期的研究，综合分析公司债、企业债、短期融资券等发行人所处行业的发展前景和状况、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素后，结合具体发行契约，获取利差的变动会带来趋势性的信用产品投资机会。 2、现金管理投资策略 本计划以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对现金管理类金融品种的组合操作，在保持本金的安全性与资产流动性的同时，追求稳定的当期收益。通过合理有效分配本计划的现金流，保持投资组合的流动性，满足本计划投资运作的要求。	根据国债、金融债、企业债等不同债券间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，借以取得较高收益。 (4) 骑乘策略 通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的债券，随着本计划持有债券时间的延长，债券的剩余期限将缩短，到期收益率将下降，从而获得资本利得收入。 (5) 信用债投资策略 本计划根据对宏观经济运行周期的研究，综合分析公司债、企业债、短期融资券等发行人所处行业的发展前景和状况、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素后，结合具体发行契约，获取利差的变动会带来趋势性的信用产品投资机会。 2、现金管理投资策略 本计划以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对现金管理类金融品种的组合操作，在保持本金的安全性与资产流动性的同时，追求稳定的当期收益。通过合理有效分配本计划的现金流，保持投资组合的流动性，满足本计划投资运作的要求。 3、证券化资产投资策略 筛选市场上的证券化资产，从主体资质、基础资产、交易结构这三个层次识别风险。主体资质看股东背景、管理团队、资产服务能力、信息系统和风控系统。基础资产是现金流的稳定性和可预测性。交易结构是账户设置、现金流分配顺序、信用触发机制、循环购买机制。获取稳健收益。
五、投资范围和投资组合设计 (一) 投资范围 固定收益类资产包括国债、央行票据、地方政府债、政策性金融债、政府支持机构债、非政策性金融债、公司债（含非公开发行的公司债）、企业债、项目收益债、可转换债、可分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、集合票据、次级债、证券公司次级债、中小企业私募债、混合资本债、资产支持证券、资产支持票据、非公开定向债务融资工具、永续中票、同业存单、大额可转让存单（CD）、债券型证券投资基金、债券逆回购、债券质押式回购等标准化债权类资产。以上债券的主体或债项评级在 AA（含）以上（短期融资券、超短期融资券除外），若无债项评级，主体评级或担保机构评级需为 AA（含）以上，且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考。 现金类资产包括现金、银行存款（含活期存款、定期存款、通知存款、协议存款、同业存款等）、货币市场基金等。	五、投资范围和投资组合设计 (一) 投资范围 固定收益类资产包括国债、中央银行债、商业银行金融债、证券公司短期债、央行票据、地方政府债、政策性金融债、政府支持机构债、非政策性金融债、公司债（含非公开发行的公司债）、企业债、项目收益债、可转换债、可分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、集合票据、次级债、证券公司次级债、中小企业私募债、混合资本债、资产支持证券、资产支持票据、非公开定向债务融资工具、永续中票、同业存单、大额可转让存单（CD）、债券型证券投资基金、债券逆回购、债券质押式回购等债权类资产。以上债券的主体或债项评级在 AA（含）以上（短期融资券、超短期融资券除外），若无债项评级，主体评级或担保机构评级需为 AA（含）以上，且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考。 现金类资产包括现金、银行存款（含活期存款、定期存款、通知存款、协议存款、同业存款等）、货币市场基

以上投资范围中，由于投资主体（本集合计划）暂未获得相关资质或资格而无法投资的投资品种，在投资主体获得相关资质或资格后，可进行投资。法律法规或监管机构以后允许集合资产管理业务投资的其他品种，管理人和托管人协商一致后按本合同约定对合同进行变更或补充，并向委托人充分揭示相应风险且履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序后，可以将其纳入投资范围。 （二）本计划的投资比例和投资限制 1、本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例如下所列： 现金类资产市值占集合计划总资产的 0-100%。 固定收益类资产市值占集合计划总资产的 80-100%。 债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的 0-100%。 2、投资限制（占集合计划资产总值） （1）本计划不得投向未经具有证券投资基金托管资格的机构托管的私募基金； （2）本计划不得投资未在中国基金业协会备案的合伙企业份额； （3）本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过 200%。计算单个资产管理计划的总资产按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。 （4）本计划投资于固定收益类资产投资比例为资产管理计划财产总值的【80~100%】 （5）本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；资产管理人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。 （6）本计划不得投资于资产支持证券次级，仅限投资在交易所和银行间和机构间私募产品报价与服务系统（报价系统）挂牌交易的资产支持证券。投资标的遵循法律法规对产品嵌套的要求。 （7）法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。 3、投资禁止行为 本计划财产禁止从事下列行为： ①不得承销证券； ②不得将计划资产用于对外担保等用途； ③不得将计划资产用于可能承担无限责任的投资； ④不得从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动； ⑤法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他活动。 托管人对管理人投资行为监督的具体内容和标准按照本合同附件投资监督事项表（附件五）执行，若本合同	金等。 以上投资范围中，由于投资主体（本集合计划）暂未获得相关资质或资格而无法投资的投资品种，在投资主体获得相关资质或资格后，可进行投资。法律法规或监管机构以后允许集合资产管理业务投资的其他品种，管理人和托管人协商一致后按本合同约定对合同进行变更或补充，并向委托人充分揭示相应风险且履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序后，可以将其纳入投资范围。 （二）本计划的投资比例和投资限制 1、本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例如下所列： 现金类资产市值占集合计划总资产的 0-100%。 固定收益类资产市值占集合计划总资产的 80-100%。 债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的 0-100%。 2、投资限制（占集合计划资产总值） （1）本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过 200% （2）本计划投资于固定收益类资产投资比例为资产管理计划财产总值的【80~100%】 （3）本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；资产管理人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）本计划不得投资于资产支持证券次级，仅限投资在交易所和银行间和机构间私募产品报价与服务系统（报价系统）挂牌交易的资产支持证券。投资标的遵循法律法规对产品嵌套的要求。 （5）法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。 3、投资比例超限的处理方式及流程 因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本集合计划投资不符合法律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，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产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。 4、投资禁止行为 本计划财产禁止从事下列行为： ①不得承销证券； ②不得将计划资产用于对外担保等用途； ③不得将计划资产用于可能承担无限责任的投资；
---	--

第十一章第四点、第五点的内容与投资监督事项表（附件五）不一致的，以投资监督事项表（附件五）为准。

4、在本集合计划成立之日起六个月内，可不受上述比例限制，但应当符合本集合计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本计划投资比例超标的，管理人应自可交易之日起的 15 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。

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，投资于对应类别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。】

委托人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委托人中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告，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。

在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告（如需），并通过本集合计划季报、年报等定期报告形式向委托人披露。

托管人仅依据法律法规或合同明确约定的投资范围、投资限制、投资禁止行为、管理人书面提供的关联方名单（若有）等内容进行投资监督，对投资策略及其他合规性问题不承担任何形式的责任。

④不得利用本计划资产为委托人之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送；

⑤不得从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

⑥不得从事本合同、法律法规、行政法规等有关规定及国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

托管人对管理人投资行为监督的具体内容和标准按照本合同附件投资监督事项表（附件五）执行，若本合同第十一章第四点、第五点的内容与投资监督事项表（附件五）不一致的，以投资监督事项表（附件五）为准。

5、在本集合计划成立之日起六个月内，可不受上述投资比例限制，但应当符合本集合计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本计划投资比例超标的，管理人应自可交易之日起的 15 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。

6、【本计划存续期间，为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于对应类别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：

（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、应付可能出现的委托人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风险。

委托人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委托人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，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。

在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规

	及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告（如需），并通过本集合计划季报、年报等定期报告形式向委托人披露。 托管人仅依据法律法规或合同明确约定的投资范围、投资限制、投资禁止行为、管理人书面提供的关联方名单（若有）等内容进行投资监督。 7、管理人应当建立健全反洗钱内部控制制度，设立反洗钱专门机构或者指定内设机构负责反洗钱工作，并按照反洗钱法律法规的要求和本条的有关规定，勤勉尽责，建立健全客户身份识别制度、客户身份资料和交易记录保存制度、大额交易和可疑交易报告制度及客户风险等级划分制度，严格履行反洗钱义务。 管理人不得为身份不明的客户提供服务或者与其进行交易，不得为客户开立假名账户、匿名账户、身份资料虚假账户，不得开立对应关系虚假或对应关系不清晰的账户。 管理人应根据相关法律法规要求建立并不时更新反洗钱客户风险等级划分制度，对产品委托人风险等级进行划分，在持续关注的基础上，适时调整产品委托人风险等级并据其设定不同的审核标准，并根据产品委托人的风险等级，定期审核本机构保存的产品委托人基本信息。 管理人、托管人应互相协助配合对可疑交易和大额交易进行调查，并及时提供因监管机构或国家有权机关调查所需的产品委托人资料信息。
七、投资决策与风险控制 （二）投资程序 1、投资决策程序 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： 1)管理人资产管理业务委员会审定年度市场投资策略。 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市场投资策略。 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。 2、投资交易程序 （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、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。	七、投资决策与风险控制 （二）投资程序 1、投资决策程序 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： 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。 2、投资交易程序 （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。 （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。 （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，保证投资主办人的

(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。 (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，保证投资主办人的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。 (四) 风险控制 5、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、监管机构以及委托人的监督。 1) 托管人的监督 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，并及时向委托人通报、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。	投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。 (三) 风险控制 5、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、监管机构以及委托人的监督。 1) 托管人的监督 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，并及时向委托人通报、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。
第十四节 利益冲突及关联交易	
本资产管理计划的资产可以投资于管理人、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交易。 委托人在此同意授权管理人可以将资产管理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，管理人应当遵循投资者利益优先原则，交易完成5个自然日内，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，并根据法律、行政法规规定，向监管机构报告。除前款规定外，管理人不得将本资产管理计划资产，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、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。 委托人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定，遵循投资者利益优先原则，交易完成5个自然日内，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。	(一) 关联交易及利益冲突情形 投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人可以以计划资产从事关联交易，包括但不限于将计划资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行或承销期内承销的证券或进行其他关联交易，管理人无需就前述具体关联交易再行分别取得投资者的授权。管理人应根据法律、行政法规、中国证监会的规定事后及时通知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会、证券期货交易所（如需）报告。投资者已明确知悉并愿意承担因上述关联交易可能导致的管理人/管理人关联方双重管理及收费等事项及风险。以上投资行为应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待计划财产。 本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：本计划可租用管理人关联方提供的证券交易单元；管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。 此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本

	计划的投资运作。 (二) 关联交易及利益冲突的应对及处理 资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的,管理人应当坚持投资者利益优先原则,从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形,防范利益输送等违法违规行为。在发生损害投资者利益的利益冲突时,管理人应当视具体利益冲突情形和重要程度选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露,具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对投资者利益的影响等。管理人承诺谨慎勤勉地管理资产管理计划财产、公平对待各投资组合。 管理人运用本计划财产从事关联交易的,应当符合产品的投资目标、投资策略和委托人利益优先原则,按照商业原则,以不优于市场一般交易条件进行,管理人负责关联交易价格的公允性,法律法规要求应当披露的,应向委托人充分披露信息。
第十五节 投资经理的指定与变更	
一、投资主办的指定 (一) 委托资产投资主办人由管理人负责指定。 (二) 集合资产管理业务的投资主办人不得兼任其它资产管理业务或自营业务的投资主办人。 投资主办人简历 杨镭 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,具有八年证券从业经验,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。 袁馨 投资经理,南京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。 以上投资主办均取得基金从业资格,最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。 二、投资主办与变更 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。	一、投资经理的指定 (一) 委托资产投资经理由管理人负责指定。 (二) 集合资产管理业务的投资经理不得兼任其它资产管理业务或自营业务的投资主办人。 投资经理简历 赵睿 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 袁馨 南京大学金融学学士、北京大学金融学硕士,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。 以上投资经理均取得基金从业资格,最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。 二、投资主办与变更 集合计划存续期间,若负责集合资产管理业务的投资经理发生变更,管理人应当以管理人网站公告方式及时向投资者披露,并向中国证券投资基金业协会备案。
第十八节 越权交易的界定	
二、越权交易的处理程序 (一) 管理人应向托管人主动报告越权交易,在限期内,	二、越权交易的处理程序 (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。 (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。 (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。	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。 (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。 (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。
第十九节 资产管理计划财产的估值和会计核算	
三、单位净值 集合计划单位份额净值指估值日集合计划资产净值除以集合计划的份额总数所得的数值。集合计划单位净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。集合计划资产净值由资产管理人 T 日负责计算，T+1 日上午 12 点之前资产托管人复核完成。	三、单位净值 集合计划单位份额净值指估值日集合计划资产净值除以集合计划的份额总数所得的数值。集合计划单位净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。集合计划资产净值由资产管理人 Q 日内（Q 为估值日）负责计算，Q 日内资产托管人复核完成（在本集合计划开放期间，由资产管理人 Q 日负责计算，资产托管人 Q 日复核完成）。
七、估值方法 (一) 股票估值方法 1、上市流通股票的估值 上市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，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，调整最近交易日的收盘价，确定公允价值进行估值。 2、未上市股票的估值 (1) 首次发行未上市的股票，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，按成本价估值。 (2) 送股、转增股、配股和公开增发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股票的市价进行估值。 (3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的市价进行估值。 (4) 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 本计划投资非公开发行股票按以下方法估值： i. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价低于非公开发行股票的首次取得成本时，采用在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价作为估值日该非公	七、估值方法 (一) 固定收益品种的估值方法 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、商业银行金融债、证券公司短期债、央行票据、地方政府债、政策性金融债，政府支持机构债、非政策性金融债、公司债（含非公开发行的公司债）、企业债、项目收益债、可转换债、可分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、集合票据、次级债、证券公司次级债、中小企业私募债、混合资本债、资产支持证券、资产支持票据、非公开定向债务融资工具、永续中票、同业存单、大额可转让存单（CD）、债券型证券投资基金、债券逆回购、债券质押式回购等债权类资产。 1、交易所市场交易品种估值处理 (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）

开发行股票的价值；

ii. 在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价高于非公开发行股票的首次取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的首次取得成本；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价；D1 为非公开发行股票锁定期所含的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

（二）债券估值方法

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。

2、在证券交易所市场挂牌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，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，采用适当估值技术确定其公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。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、私募基金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）权证估值方法

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、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。

逆回购以成本列示，按照预期收益率逐日计提利息。

8、持有的货币市场基金，每日按基金公司公布的前一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。

（二）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

1、从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；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，调整最近交易日报价，确定公允价值。 2、首次发行未上市的权证，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、因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按收盘价高于配股价的差额估值；如果收盘价低于配股价，则估值增值额为零。 （四）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，调整最近交易日报价，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、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。 （五）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。 （六）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、贵金属现货延期交收合约等），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。 （七）逆回购以成本列示，按照预期收益率逐日计提利息。 （八）债券计提每日利息，股票红利按税后计算投资收	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。 （三）债券计提每日利息，股票红利按税后计算投资收益。 （四）如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。 （五）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。 （六）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。 （七）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委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。 （八）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。
--	---

益。 (九)如有新增事项或变更事项,按国家最新规定估值。 (十)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。 (十一) 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。 (十二)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委托人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。 (十三)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。	
八、估值程序 集合计划的日常估值由管理人进行,托管人复核。用于公开披露的集合计划单位净值由管理人以邮件或双方认可的方式发给托管人,托管人复核后以邮件或双方认可的方式回复管理人当管理人与托管人的估值结果不一致时,各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致,应以管理人的估值结果为准,由此给委托人和集合计划财产造成的损失,托管人不承担任何责任。报告期末估值复核与集合资产管理计划会计账目的核对同时进行。 由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力等原因造成估值错误的,管理人和托管人免于承担责任。	八、估值程序 集合计划的日常估值由管理人进行,托管人复核。用于公开披露的集合计划单位净值由管理人以邮件或双方认可的方式发给托管人,托管人复核后以邮件或双方认可的方式回复管理人当管理人与托管人的估值结果不一致时,各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致,应以管理人的估值结果为准。 由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力等原因造成估值错误的,管理人和托管人免于承担责任。
第二十一节 资产管理计划的收益与分配	
三、收益分配原则 (一) 每份集合计划份额享有同等分配权。 (二) 如果投资当期出现净亏损,则不进行收益分配。 (三) 收益分配后份额净值不低于本计划初始面值,即收益分配基准日的集合计划份额净值减去每份集合计划的份额收益分配金额后不能低于本计划初始面值1.0000。 (四) 在符合有关集合计划分红条件的前提下,本集合计划每年收益分配次数由管理人决定,本计划收益分配方式为红利转投。 (五) 对于在开放期申请退出并确认的客户,本集合计划在该期产品到期的最后一个工作日将退出份额的收益分配给客户,对于在开放期末申请退出的客户,本集	三、收益分配原则 (一) 每份集合计划份额享有同等分配权。 (二) 如果投资当期出现净亏损,则不进行收益分配。 (三) 收益分配后份额净值不低于本计划初始面值,即收益分配基准日的集合计划份额净值减去每份集合计划的份额收益分配金额后不能低于本计划初始面值1.0000。 (四) 本集合计划存续期内收益分配比例、分配次数、分配时间和分配金额由管理人确定。。 (五) 本集合计划的收益分配日具体以管理人收益分配方案为准。 (六) 若集合计划可分配收益大于零,则管理人将剩余全部可分配收益进行红利转投。但若集合计划可分配收

合计划在该期产品到期的最后一个工作日进行红利转投。 (六) 若集合计划可分配收益大于零, 则管理人将剩余全部可分配收益进行红利转投。但若集合计划可分配收益小于零, 则管理人不对集合计划进行收益分配。 (七) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人承担。 (八) 法律、法规或监管机关另有规定的, 从其规定。	益小于零, 则管理人不对集合计划进行收益分配。 (七) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人承担。 (八) 法律、法规或监管机关另有规定的, 从其规定。
四、收益分配方案的确定与披露 各方一致同意本集合计划收益分配方案由管理人拟定, 由托管人核实后确定, 管理人至少在 R-1 个工作日 (R 为权益登记日) 之前将收益分配方案向委托人公告。	四、收益分配方案的确定与披露 (一) 管理人计算集合计划的可分配收益。 (二) 管理人确定分配红利的金额、时间。管理人考虑集合计划的投资策略、现金流量和客户需求, 在满足本部分规定的条件下确定收益分配的具体金额和具体时间。 (三) 管理人制定收益分配方案。收益分配方案包括集合计划可以分配的金额、分配的登记日、红利转再投资的确认日等。各方一致同意本集合计划收益分配方案由管理人拟定, 由托管人核实后确定。托管人仅在划款时按照管理人提供的公式复核金额是否正确, 不对 TA 信息、登记日、红利再投资等信息进行核实。 (四) 管理人通知委托人。管理人将收益分配方案在官网上向委托人公告。 (五) 实施分配方案。 五、收益分配的执行 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, 在收益分配日根据资产管理计划管理人的划款指令进行处理。 本集合计划的收益分配方式为委托人可选择红利再投资方式或现金分红方式。 委托人若未进行选择, 则默认分红方式为: 红利再投资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, 将现金红利划转到委托人的交易账户; 采取红利再投资方式的, 分红资金按分红除权除息日的份额净值转成相应的集合计划单位。
第二十二节 信息披露与报告	
一、定期报告 (二) 集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告。 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。	一、定期报告 (二) 集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告。 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。资产管理季度报告和托管季度报告应于每季度截止日后 1 个月内通过管理人网站披露。集合计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月的, 管理

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。 报告内容需披露信息： 1、管理人履职报告； 2、托管人履职报告； 3、资产管理计划投资表现； 4、资产管理计划投资组合报告； 5、资产管理计划运用杠杆情况； 6、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式； 7、资产管理计划投资收益分配情况； 8、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项； 9、中国证监会规定的其他事项。 （三）集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告 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。 报告内容需披露信息： 1、管理人履职报告； 2、托管人履职报告； 3、资产管理计划投资表现； 4、资产管理计划投资组合报告； 5、资产管理计划运用杠杆情况； 6、资产管理计划财务会计报告； 7、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式； 8、资产管理计划投资收益分配情况； 9、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项； 10、中国证监会规定的其他事项。 （四）年度审计报告 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，通过管理人网站向委托人披露，并报中国证券投资基金业协会备	人、托管人可以不编制当期的季度报告。 报告内容需披露信息： 1、管理人履职报告； 2、托管人履职报告； 3、资产管理计划投资表现； 4、资产管理计划投资组合报告； 5、资产管理计划运用杠杆情况； 6、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式； 7、资产管理计划投资收益分配情况； 8、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项； 9、中国证监会规定的其他事项。 （三）集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告 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。资产管理季度报告和托管季度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。 报告内容需披露信息： 1、管理人履职报告； 2、托管人履职报告； 3、资产管理计划投资表现； 4、资产管理计划投资组合报告； 5、资产管理计划运用杠杆情况； 6、资产管理计划财务会计报告； 7、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式； 8、资产管理计划投资收益分配情况； 9、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项； 10、中国证监会规定的其他事项。 （四）年度审计报告 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，通过管理人网站向委托人披露，并报管理人住所地中国证监会派出机构。
---	---

案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。	
二、临时报告 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，管理人应当以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。临时报告的情形包括但不限于： （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产生重大影响的事项。 （二）暂停受理或者重新开始受理参与或者退出时。 （三）发生巨额退出并延期支付。 （四）集合计划终止和清算。 （五）管理人以自有资金参与和退出。 （六）合同的补充、修改与变更。 （七）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项。 （八）负责本集合计划的销售机构发生变更。 （九）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。 （十）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。 （十一）管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责。 （十二）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。 （十三）其他管理人认为的重大事项。	二、临时报告 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，管理人应当以管理人网站公告方式及时向客户披露，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： （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产生重大影响的事项。 （二）暂停受理或者重新开始受理参与或者退出时。 （三）发生巨额退出并延期支付。 （四）集合计划终止和清算。 （五）管理人以自有资金参与和退出。 （六）合同的补充、修改与变更。 （七）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项。 （八）负责本集合计划的销售机构发生变更。 （九）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。 （十）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。 （十一）管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责。 （十二）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。 （十三）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。 （十四）其他管理人认为的重大事项。
第二十四节 资产管理合同的变更、终止与清算	
一、合同的补充、修改与变更 （一）本合同生效后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订进行变更并在管理人网站公告。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说明书与新的法律法规或有关政策不一致的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	一、合同的补充、修改与变更 （一）资产管理合同的变更 1、各方书面一致同意，以下事项可由管理人自行决定变更： （1）调低管理人的报酬标准； （2）调低参与费、退出费的费率； （3）投资经理的变更； （4）对本资产管理计划的认购、参与、退出、资产管理计划份额转让的业务规则（包括但不限于总规模、单

人网站公告满5个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议,可在本集合计划最近一个临时开放期预约申请退出本集合计划,未在上述期间预约申请退出本集合计划的,视为同意,管理人不再另行通知。

(二)除上述(一)所述情形外需要变更合同的,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个工作日内以邮件或者管理人网站公告方式(由管理人决定)向委托人发送合同变更征询意见函(或通知)。委托人应在征询意见函(或通知)指定的日期内(不得多于5个工作日)按指定形式回复意见。委托人不同意变更的,应在征询意见函(或通知)指定的日期内即临时开放期内提出退出本集合计划的申请;委托人未在指定日期内即临时开放期内回复意见或未在指定日期内提出退出本集合计划申请的,视为委托人同意合同变更。如委托人同意变更,则变更事项自征询意见函(或通知)指定的日期届满的最后一工作日开始生效,对合同各方均具有法律效力。

(三)全体委托人、管理人和托管人协商一致并签署补充协议后,也可对本合同内容进行变更。

(四)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。

(五)委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式,约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失,或排除委托人自行承担投资风险和损失。

(六)本合同对应的托管协议是指《华鑫鑫国1号集合资产管理计划托管协议》(以实际签署为准)。本计划托管人为宁波银行股份有限公司,托管人根据本合同和《托管协议》的约定履行托管职责。

个投资者首次认购、参与金额及持有的本资产管理计划总金额限制等)进行调整;

(5)调整本计划的风险等级;

(6)法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

2、各方书面一致同意,以下事项可由管理人和托管人协商后变更:

(1)调低托管人的报酬标准;

(2)因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券投资基金业协会自律管理规则、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,或相关监管机构或自律组织对本集合计划备案补正意见的要求涉及到合同修改的,管理人经与托管人协商,可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改,或根据相关监管机构或自律组织备案补正意见的要求对本合同及说明书进行修改,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公告满5个工作日后生效;

(3)法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

3、除前文第1项、第2项所述之外的其余事项如需发生变更的,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投资者发送合同变更征询意见函。投资者不同意变更的,应在征询意见函发出后的最近一个开放期或管理人设置的合同变更临时开放期内(以下统称“指定开放期”)提出退出本集合计划的申请;投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的,视为投资者同意合同变更。投资者不同意变更的,管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排:

投资者不同意变更的,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逾期未退出本集合计划的投资者,管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理(退出价格为退出当日的计划份额净值)。

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。

合同变更于指定开放期结束后的第一个工作日起生效,公告内容即成为本合同组成部分。

资产管理计划改变投向和比例的,应当事先取得投资者和托管人同意,并履行合同变更程序。

特别约定:在本集合计划投资者人数少于3名(含3名)的情况下,经全体投资者、管理人、托管人同意,也可通过签署补充协议的方式进行合同变更,采用该等方式

	变更合同的，可不受上述合同变更程序限制。 （二）风险收益特征 本计划风险等级为【R2】，具有【中低风险】风险和收益的特征。 如果相关法律法规规则要求或因实际情况需要等，需调高或降低本计划风险等级的，管理人可以调整产品风险等级，并及时以公司网站公告等方式告知投资者，无需进行合同变更。
二、有下列情形之一的，集合计划应当终止 （十二）法律、法规规定或中国证监会规定及本合同约定的其他情况。	二、有下列情形之一的，集合计划应当终止 （十二）法律、法规规定或中国证监会规定及本合同约定的其他情况。 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。
二、集合计划的清算 （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通知委托人清算结果。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。	三、集合计划的清算 （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通知委托人清算结果。管理人应当在清算结束后 15 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	
序号*	名称
1	上海华鑫股份有限公司
2	上海金欣联合发展有限公司
3	上海金陵投资有限公司
4	上海择励实业有限公司
5	上海普林电路板有限公司
6	上海普林电子有限公司
7	上海鑫敦实业有限公司
8	力敦行房地产经纪有限公司
9	华鑫期货有限公司
10	华鑫证券投资有限公司
11	华鑫宽众投资有限公司
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

华鑫证券有限责任公司主要关联关系信息表		
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	9131000013220382XX
本公司的控股股东情况		
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	9131000013220382XX
本公司的控股股东控制的其他子公司情况		
序号	名称	营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册

17	上海华鑫置业集团工程咨询有限公司	*		号 (境外机构)
18	上海华鑫物业管理顾问有限公司	1	上海金欣联合发展有限公司	91310101132352737T
19	上海华萃置业有限公司	2	上海金陵投资有限公司	91310115132310625R
20	上海华田置业有限公司	3	上海择励实业有限公司	91310230057678883Q
21	上海华维投资管理有限公司	4	上海普林电路板有限公司	310104000015714
22	上海华鑫资产管理有限公司	5	上海普林电子有限公司	310000400435444
23	上海广业陕新投资管理有限公司	6	上海鑫敦实业有限公司	9131023008009785XR
24	上海怡朋物业管理有限公司	7	上海力敦行房地产经纪有限公司	91310115787820407L
25	上海华析资产管理有限公司	8	华鑫思佰益融资租赁 (上海) 有限公司	91310000MA1FL02T7J
26	上海云赛创鑫企业管理有限公司	9	上海鑫之众投资管理有限公司	91310000MA1FL3EG5U
27	上海电动工具研究所 (集团) 有限公司	10	上海全创信息科技有限公司	91310104MA1FRJB1XP
28	上海电工技术交流中心	11	烟台山基金小镇 (烟台) 运营管理有限公司	91370602MA3QWYREXU
29	上海宝庆通用电工有限公司	12	天津东疆基金管理有限公司	91120118MA06EA4NX9
30	上海电气器具检验检测所	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		
31	上海松宝科技发展有限公司	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)
32	中认尚动 (上海) 检测技术有限公司	*		
33	上海电动所工具研究所集团嘉善有限公司	1	华鑫期货有限公司	91310000132110746J
34	上海怡汇投资管理有限公司	2	华鑫证券投资有限公司	913100000841449245
35	云赛信息 (集团) 有限公司	3	华鑫宽众投资有限公司	91310000351133569C
36	上海广甸物业发展有限公司	4	摩根士丹利华鑫证券有限责任公司 (49%)	913100007178847982
37	上海华欧投资管理有限公司	5	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	91440300746637454W
38	上海云仪电子贸易有限公司			
39	上海仪夏电子有限公司			
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	上海圣阑实业有限公司			
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	上海华勃企业发展有限公司
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

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 HXXG-2019 第 2 号的《华鑫鑫国 1 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。

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 HXXG1H-2020 第 1 号的《华鑫鑫国 1 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。

附件五:投资监督事项表

一、投资范围

固定收益类资产包括国债、央行票据、地方政府债、政策性金融债、政府支持机构债、非政策性金融债、公司债(含非公开发行的公司债)、企业债、项目收益债、可转换债、可分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、集合票据、次级债、证券公司次级债、中小企业私募债、混合资本债、资产支持证券、资产支持票据、非公开定向债务融资工具、永续中票、同业存单、大额可转让存单(CD)、债券型证券投资基金、债券逆回购、债券质押式回购等标准化债权类资产

以上债券的主体或债项评级在 AA(含)以上(短期融资券、超短期融资券除外),若无债项评级,主体评级或担保机构评级需为 AA(含)以上,且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考。

现金类资产包括现金、银行存款(含活期存款、定期存款、通知存款、协议存款、同业存款等)、货币市场基金等。

一、投资范围

固定收益类资产包括国债、中央银行债、商业银行金融债、证券公司短期债央行票据、地方政府债、政策性金融债、政府支持机构债、非政策性金融债、公司债(含非公开发行的公司债)、企业债、项目收益债、可转换债、可分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、集合票据、次级债、证券公司次级债、中小企业私募债、混合资本债、资产支持证券、资产支持票据、非公开定向债务融资工具、永续中票、同业存单、大额可转让存单(CD)、债券型证券投资基金、债券逆回购、债券质押式回购等债权类资产

以上债券的主体或债项评级在 AA(含)以上(短期融资券、超短期融资券除外),若无债项评级,主体评级或担保机构评级需为 AA(含)以上,且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考。

现金类资产包括现金、银行存款(含活期存款、定期存款、通知存款、协议存款、同业存款等)、

以上投资范围中，由于投资主体（本集合计划）暂未获得相关资质或资格而无法投资的投资品种，在投资主体获得相关资质或资格后，可进行投资。 法律法规或监管机构以后允许集合资产管理业务投资的其他品种，管理人和托管人协商一致后按本合同约定对合同进行变更或补充，并向委托人充分揭示相应风险且履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序后，可以将其纳入投资范围。	货币市场基金等。 以上投资范围中，由于投资主体（本集合计划）暂未获得相关资质或资格而无法投资的投资品种，在投资主体获得相关资质或资格后，可进行投资。 法律法规或监管机构以后允许集合资产管理业务投资的其他品种，管理人和托管人协商一致后按本合同约定对合同进行变更或补充，并向委托人充分揭示相应风险且履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序后，可以将其纳入投资范围。
二、投资比例及投资限制 1、本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例如下所列： 现金类资产市值占集合计划总资产的 0-100%。 固定收益类资产市值占集合计划总资产的 80-100%。 债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的 0-100%。 2、投资限制（占集合计划资产总值） （1）本计划不得投向未经具有证券投资基金托管资格的机构托管的私募基金； （2）本计划不得投资未在中国基金业协会备案的合伙企业份额； （3）本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过 200%。计算单个资产管理计划的总资产按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。 （4）本计划投资于固定收益类资产投资比例为资产管理计划财产总值的【80~100%】 （5）本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%，资产管理人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。 （6）本计划不得投资于资产支持证券次级，仅限投资在交易所和银行间和机构间私募产品报价与服务系统（报价系统）挂牌交易的资产支持证券。投资标的遵循法律法规对产品嵌套的要求。 （7）法律法规、中国证监会以规定的其他投资限制。 4、在本集合计划成立之日起六个月内，可不受上述比例限制，但应当符合本集合计划合同约	二、投资比例及投资限制 1、本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例如下所列： 现金类资产市值占集合计划总资产的 0-100%。 固定收益类资产市值占集合计划总资产的 80-100%。 债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的 0-100%。 2、投资限制（占集合计划资产总值） （1）本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过 200% （2）本计划投资于固定收益类资产投资比例为资产管理计划财产总值的【80~100%】 （3）本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；资产管理人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）本计划不得投资于资产支持证券次级，仅限投资在交易所和银行间和机构间私募产品报价与服务系统（报价系统）挂牌交易的资产支持证券。 （5）法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。 3、投资比例超限的处理方式及流程 因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本集合计划投资不符合法律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，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和

定的投向和资产管理计划的风险收益特征。因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本计划投资比例超标的,管理人应自可交易之日起的 15 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的,从其规定。 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,投资于对应类别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。】 委托人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委托人中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告,投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告,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。 在发生上述所列投资证券事项时,管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定,应当将交易结果告知托管人,同时向证券交易所报告(如需),并通过本集合计划季报、年报等定期报告形式向委托人披露。 托管人仅依据法律法规或合同明确约定的投资范围、投资限制、投资禁止行为、管理人书面提供的关联方名单(若有)等内容进行投资监督,对投资策略及其他合规性问题不承担任何形式的责任。	证券投资基金业协会报告。 4、在本集合计划成立之日起六个月内,可不受上述比例限制,但应当符合本集合计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本计划投资比例超标的,管理人应自可交易之日起的 15 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的,从其规定。 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,投资于对应类别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: (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、应付可能出现的委托人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风险。
三、投资禁止 本计划财产禁止从事下列行为: ①不得承销证券; ②不得将计划资产用于对外担保等用途; ③不得将计划资产用于可能承担无限责任的投资; ④不得从事内幕交易、操纵证券交易价格及其	三、投资禁止 本计划财产禁止从事下列行为: ①不得承销证券; ②不得将计划资产用于对外担保等用途; ③不得将计划资产用于可能承担无限责任的投资; ④不得利用本计划资产为委托人之外的任何第

他不正当的证券交易活动； 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他活动。	三方谋取不正当利益、进行利益输送； ⑤不得从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动； ⑥不得从事法律法规、行政法规等有关规定及国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。
---	--

三、本计划托管人对本次合同变更的意见

托管人广发银行股份有限公司同意本次合同变更事宜，请参见《关于华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同变更的征询函及回函》

四、向全体投资者征询意见及后续安排

根据《华鑫鑫国 1 号集合资产管理合同》（合同编号：HXXG-2019 第 2 号）第二十四节资产管理合同的变更、终止与清算中第一条合同的补充、修改与变更的第二条“（二）除上述（一）所述情形外需要变更合同的，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 个工作日内以邮件或者管理人网站公告方式（由管理人决定）向委托人发送合同变更征询意见函（或通知）。委托人应在征询意见函（或通知）指定的日期内（不得多于 5 个工作日）按指定形式回复意见。委托人不同意变更的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内即临时开放期内提出退出本集合计划的申请；委托人未在指定日期内即临时开放期内回复意见或未在指定日期内提出退出本集合计划申请的，视为委托人同意合同变更。如委托人同意变更，则变更事项自征询意见函（或通知）指定的日期届满的后一工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。”之约定。

本征询意见函及临时开放期设置公告将通过管理人网站公告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 31 日、2021 年 1 月 4 日，共 2 个工作日。

投资者应在临时开放期内以邮件形式回复意见并发送至我司邮箱：zcglb@cfsc.com.cn

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；对于投资者在临时开放期内提出的退出申请，管理人将于最近一次开放期首日为投资者办理退出；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）指定的日期届满的后一工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。

五、合同变更的效力及生效时间

本征询意见函及临时开放期设置公告构成变更后合同的组成部分，变更后的合同将于 2021 年 1 月 5 日（含）正式生效。

如有疑问，请拨打客服热线：95323。

特此公告。



