

关于华鑫证券鑫盛 4 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“华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划”成立于 2020 年 8 月 31 日。为给投资者提供更专业的资产管理服务，我司拟对《华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXZQXS-2020 第 4 号）的“声明与承诺、当事人的权利与义务、资产管理计划的基本情况、资产管理计划的募集、资产管理计划的参与、退出与转让、资产管理计划的投资、利益冲突及关联交易、资产管理计划财产的估值和会计核算、资产管理计划的费用与税收、资产管理计划的收益与分配、信息披露与报告、风险揭示”等章节的部分条款及事项进行变更和修订，《华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划说明书》及《华鑫证券鑫盛 4 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《华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXZQXS-2020 第 4 号-2021XD）（以下简称《资管合同》）的方式对《华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXZQXS-2020 第 4 号）内容进行更新或修改。

一、 主要变更事项的说明

（一）华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划资产管理合同（合同编号：HXZQXS-2020 第 4 号-2021XD）

本次合同变更主要内容如下，详细修订内容详见“第二章、华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划资产管理合同修订前后款对照表”：

- (1) 前言
- (2) 释义
- (3) 声明与承诺
- (4) 当事人的权利与义务
- (5) 资产管理计划的基本情况
- (6) 资产管理计划的募集
- (7) 集合计划的成立与备案
- (8) 资产管理计划的参与、退出与转让
- (9) 资产管理计划的投资
- (10) 利益冲突与关联交易
- (11) 投资经理的指定与变更



- (12) 资产管理计划财产的估值和会计核算
- (13) 集合计划费用与税收
- (14) 资产管理计划的收益与分配
- (15) 信息披露与报告
- (16) 风险揭示
- (17) 资产管理合同的变更、终止与清算
- (18) 管理人自有资金参与集合计划

修改后的资产管理合同请参见华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划资产管理合同（合同编号：HXZQXS-2020 第 4 号-2021XD）。

（二）华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划说明书

《华鑫证券鑫盛 4 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、华鑫证券鑫盛 4 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
华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划资产管理合同 (编号: HXZQXS-2020 第 4 号)	华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划资产管理合同 (编号: HXZQXS-2020 第 4 号-2021XD)
重要提示	
特别约定:《华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”)以中登电子签名方式签订,管理人、托管人作为本合同签署方,已接受本合同项下的全部条款;投资者(华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划的投资者)作为本合同一方,以中登电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款,同时本合同成立。	特别约定:《华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”)以纸质合同或中登电子签名方式签订,管理人、托管人作为本合同签署方,已接受本合同项下的全部条款;投资者(华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划的投资者)作为本合同一方,以中登电子签名方式签署本合同的即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款,同时本合同成立。托管人仅认可通过中国证券登记结算有限责任公司系统进行合同文本及电子数据相关传输保存。
第一节 前言	
为规范华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划的运作,明确《华鑫证券鑫盛 4 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》)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》等法律法规、中国证监会、中国证	为规范华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划的运作,明确《华鑫证券鑫盛 4 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《中华人民共和国民法典》、《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》)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》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

券业协会和中国证券投资基金业协会的有关规定，投资者、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》、《华鑫证券鑫盛4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。	的有关规定，投资者、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》、《华鑫证券鑫盛4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。
--	--

第二节 释 义

投资者或持有人	指签订本合同，委托投资本资产管理计划初始金额不低于【40】万元人民币，且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人或其他组织。	投资者或持有人	指签订本合同，委托投资本资产管理计划初始金额不低于【30】万元人民币，且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人或其他组织。
		投资指令	指划款指令

第三节 声明与承诺

无	新增条款 投资者承诺 5. 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：郑帅 联系电话：0755-83025331 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：卢楠 联系电话：021-54967562 传真：021-54967780
二、投资者的权利和义务 （二）投资者的义务 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。	二、投资者的权利和义务 （二）投资者的义务 3、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二十三节“风险揭示”以及风险揭示书中列举的各类风险，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。投资者以其管理的私募资产管理产品（以下简称“该产品”）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

	<p>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。</p>
<p>二、投资者的权利和义务 (二) 投资者的义务 14、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。</p>	<p>二、投资者的权利和义务 (二) 投资者的义务 14、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。 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。</p>
<p>三、管理人的权利和义务 (一) 管理人的权利 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。 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。</p>	<p>三、管理人的权利和义务 (一) 管理人的权利 3、按照本合同及《说明书》的约定, 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, 停止办理集合计划的参与, 暂停办理集合计划的退出事宜, 但应符合法律法规的规定。 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、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。 12、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。</p>
<p>三、管理人的权利和义务 (一) 管理人的义务 14、聘请具有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, 采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定。</p>	<p>三、管理人的权利和义务 (二) 管理人的义务 14、聘请符合《证券法》要求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, 采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定。</p>

<p>16、办理与资产管理计划业务有关的信息披露事项。</p> <p>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。</p>	<p>16、办理与资产管理计划业务有关的信息披露事项。</p> <p>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，并报送中国证监会相关派出机构。</p>
<p>三、托管人的权利和义务</p> <p>(二) 托管人的义务</p> <p>6、监督管理人集合计划的经营运作，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，并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券基金业协会。</p> <p>7、根据本合同及托管协议的约定复核管理人计算的集合计划的资产净值和份额净值。</p> <p>8、保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息对外披露前予以保密，不向他人泄露（法律法规、中国证监会另有规定或有权机关要求、向所聘请的审计、法律等外部专业顾问提供、资产管理合同及托管协议等另有约定的除外）。</p> <p>9、按照本合同及托管协议的约定出具集合计划托管业务有关的信息披露事项。</p> <p>10、根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见。</p> <p>11、编制托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。</p>	<p>三、托管人的权利和义务</p> <p>(二) 托管人的义务</p> <p>6、监督管理人集合计划的经营运作，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，并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构。</p> <p>7、根据本合同及托管协议的约定复核管理人计算的集合计划的资产净值和份额净值。</p> <p>8、保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息对外披露前予以保密，不向他人泄露（法律法规、中国证监会另有规定或有权机关要求、向所聘请的审计、法律等外部专业顾问提供、资产管理合同及托管协议等另有约定的除外）。</p> <p>9、按照本合同及托管协议的约定出具集合计划托管业务有关的信息披露事项。</p> <p>10、根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见。托管人对管理人信息披露内容的复核仅为对管理人编制的份额净值、份额申购赎回价格、定期报告等公开披露的报告中的财务部分进行复核、审查。</p> <p>11、编制托管年度报告，并报送中国证监会相关派出机构。</p>

第五节 资产管理计划的基本情况

<p>二、类型：【开放式混合类】集合资产管理计划。</p>	<p>二、类型：【开放式固收类】集合资产管理计划。</p>
<p>三、目标规模</p> <p>本集合计划在销售期的募集资金（不含销售期利息）不低于1,000万元（含本数），募集规模上限以管理人公告为准；存续期规模上限以管理人公告为准；本集合计划投资者合计数为2人（含）以上200人（含）以下。</p>	<p>三、目标规模</p> <p>本集合计划在销售期的募集资金（不含销售期利息）不低于1,000万元（含本数），募集规模上限及存续期规模上限以管理人公告为准；本集合计划投资者合计数为2人（含）以上200人（含）以下。</p>
<p>五、投资范围和投资组合设计</p> <p>(一) 投资范围</p> <p>(1) 固定收益类资产：国债、央行票据、地方政府债、金融债、大额存单、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、非公开定向债务融资工具（PPN）、在交易所和银行间挂牌交易的资产支持证券（ABS）（不含次级）、资产支持票据（ABN）（不含次级）、项目收益债券（NPB）、债券回购、私募债、可转换公司债券、可交换公司债券；</p> <p>(2) 沪深交易所上市交易的股票（含科创板）、创业板交易的股票、港股通、优先股、新股申购（含科创板）、股指期货、国债期货、商品期货、场内期权；</p> <p>(3) 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、结构性存款等）、</p>	<p>五、投资范围和投资组合设计</p> <p>(一) 投资范围</p> <p>(1) 固定收益类资产：国债、央行票据、地方政府债、金融债、大额存单、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、非公开定向债务融资工具（PPN）、在交易所和银行间挂牌交易的资产支持证券（ABS）（不含次级）、资产支持票据（ABN）（不含次级）、项目收益债券（NPB）、债券逆回购、私募债、可转换公司债券、可交换公司债券；</p> <p>(2) 权益类、商品及金融衍生品类资产：沪深交易所上市交易的股票（含科创板）、创业板交易的股票、港股通、优先股、新股申购（含科创板）、股指期货、国债期货、商品期货、场内期权；</p> <p>(3) 现金类资产包括现金、银行存款（含活期存款、定期存款、</p>

<p>货币市场基金等；</p> <p>(4) 证券投资基金（包括分级基金 A、分级基金 B、ETF 和 LOF）、仅投资于以上标的的券商资产管理计划和于中国基金业协会官方网站公示并已登记为私募证券投资基金管理人发行的契约式私募投资基金。</p> <p>本集合计划可以依法参与债券回购、融资融券业务。</p> <p>本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例如下所列：经过穿透合并计算后，投资于股票、股票型基金等权益类资产、固定收益类资产的金额、商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值占本集合计划总资产的比例分别低于 80%。</p>	<p>通知存款、协议存款、同业存款、结构性存款等）、货币市场基金；</p> <p>(4) 经中国证监会依法核准或注册的公开募集基金（包含封闭式基金、开放式基金、上市开放式基金（LOF）和交易型开放式指数基金（ETF）、基础设施证券投资基金（Reits）），仅投资于以上标的的券商资产管理计划和于中国基金业协会官方网站公示并已登记为私募证券投资基金管理人发行的契约式私募投资基金。</p> <p>本集合计划可以依法参与债券正回购、融资融券业务，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。</p> <p>本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例如下所列：经过穿透合并计算后，投资于固定收益类及现金类资产的金额合计占本集合计划总资产的比例高于 80%。投资于权益类资产（包括股票、股票型基金）、商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值占本集合计划总资产的比例合计低于 20%。</p>
<p>七、集合计划份额面值</p> <p>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。</p>	<p>七、集合计划初始募集份额面值</p> <p>本集合计划初始募集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。</p>
<p>八、本集合计划的产品风险等级</p> <p>本资产管理计划属于【中高风险 R4】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【普通投资者的 C4-C5 及专业投资者】的合格投资者。</p>	<p>八、本集合计划的产品风险等级</p> <p>本资产管理计划属于【中风险 R3】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【普通投资者的 C3-C5 及专业投资者】的合格投资者。</p>
<p>第六节 资产管理计划的募集</p>	
<p>一、销售期、封闭期、开放期</p> <p>(二) 开放期和封闭期：</p> <p>1、开放期</p> <p>本集合计划运作期间每周二开放参与，如果周二为节假日，则顺延至周二之后的第一个工作日。管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑对本集合资产管理计划的可申购/认购额度进行控制。</p> <p>本集合计划每月第一个周一开放退出，如果周一为节假日，则顺延至周一之后的第一个工作日。投资者一旦参与本集合计划最短持有份额期限不得少于 270 天，投资者参与本集合计划份额满 270 天后方可按照本合同约定在开放退出日申请退出。</p>	<p>一、销售期、封闭期、开放期</p> <p>(二) 开放期和封闭期：</p> <p>1、开放期</p> <p>本集合计划运作期间每个自然月的 15 日、16 日开放，每次开放 2 个工作日（遇法定节假日顺延），但仅第 1 个开放日投资者可办理退出业务。</p> <p>投资者可退出的每笔份额持有时间不得少于 9 个月（例如投资者于 2021 年 6 月申购确认的份额可于 2022 年 3 月（含）及之后的任一开放期退出），办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间。</p> <p>管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑对本集合资产管理计划的可申购/认购额度进行控制，并通过管理人公告披露</p>
<p>二、本集合计划的风险收益特征及适合销售对象</p> <p>本资产管理计划属于【中高风险 R4】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【普通投资者的 C4-C5 及专业投资者】的合格投资者。</p>	<p>二、本集合计划的风险收益特征及适合销售对象</p> <p>本资产管理计划属于【中等风险 R3】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【普通投资者的 C3-C5 及专业投资者】的合格投资者。</p>
<p>三、参与本集合计划的最低金额</p> <p>投资者首次参与的最低金额为人民币【40】万元，追加参与的最低金额为人民币【1】万元，具体参与最低金额以管理人公告为准。</p>	<p>三、参与本集合计划的最低金额</p> <p>投资者首次参与的最低金额为人民币【30】万元，追加参与的最低金额为人民币【1】万元，具体参与最低金额以管理人公告为准。</p>
<p>四、本集合计划的销售</p>	<p>四、本集合计划的销售</p>

(二) 销售方式

本集合计划采用电子合同方式通过销售机构进行销售。本计划应当面向合格投资者销售，合格投资者累计不得超过200人。销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细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，引导客户审慎作出投资决定。禁止向投资者宣传资产管理计划预期收益率、通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段销售集合计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券投资基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划批准或者备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过广播、电视、报刊、互联网及其他公共传播媒体或者讲座、报告会、分析会等方式向不特定对象销售本集合计划。

(二) 销售方式

1、管理人直销渠道

(1) 投资者通过管理人直销渠道认购/申购本集合计划的，应将认购/申购款划入【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户（账户信息见《华鑫证券直销渠道募集结算资金归集专用账户信息告知书》（附件七））。

(2) 【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户监督机构华鑫证券有限责任公司作为运营服务机构，为【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户提供管理服务，对【管理人直销渠道】募集结算资金实施监督。管理人与运营服务机构不再另行订立账户监督协议，账户监督事项以双方签订的运营服务协议约定为准。

(3) 【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户是运营服务机构接受管理人委托代为提供资产管理产品服务的专用账户，并不代表运营服务机构接受投资者的认购或申购资金，也不表明运营服务机构对本集合计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。在【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户的使用过程中，除非有足够的证据证明是因运营服务机构的原因造成的损失外，管理人应就其自身操作不当等原因所造成的损失承担相关责任，运营服务机构对于管理人的投资运作不承担任何责任。

各方确认：管理人委托的运营服务机构不对其直销渠道以外的募集账户承担监管义务。本集合计划的投资者将投资资金划入本集合计划【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户的汇出账户为投资者收益账户，管理人只能将【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户中的资金定向划拨至该集合计划对应的托管资金账户、投资者收益账户（分红、赎回、清算时）及管理人或管理人委托的代销机构的账户（划拨认购费、申购费、赎回费等在本资产管理计划合同中列明的费用时）。

2、管理人委托的代销机构以及管理人认可并与其签署相关协议的其他机构

本集合计划采用电子合同方式通过销售机构进行销售。本计划应当面向合格投资者销售，合格投资者累计不得超过200人。销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细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，引导客户审慎作出投资决定。禁止向投资者宣传资产管理计划预期收益率、通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段销售集合计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券投资基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划批准或者备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过广播、

	电视、报刊、互联网及其他公共传播媒体或者讲座、报告会、分析会等方式向不特定对象销售本集合计划。
<p>五、本集合计划的各项费用</p> <p>(一) 参与费率： 本集合计划不收取参与费，即参与费率为0。</p> <p>(二) 管理费率： 本集合计划的管理费率为【1】%/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投资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>(三) 托管费率： 本集合计划的托管费率为【0.02】%/年，托管费由集合计划财产承担。 集合计划于托管费每日计提，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投资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托管人。具体计算方式详见本合同第二十节。</p> <p>(四) 投资顾问费： 本计划无投资顾问费。</p> <p>(五) 业绩报酬： 以上一个业绩报酬计提日下一个工作日至本次业绩报酬计提日的年化收益率R超过业绩报酬计提基准部分的20%作为业绩报酬。</p>	<p>五、本集合计划的各项费用</p> <p>(一) 参与费率： 本集合计划参与费率为【1】%。计算方法如下： 净参与金额=参与金额÷(1+参与费率) 参与费用=参与金额-净参与金额 参与费用由投资人承担，不列入本集合计划财产；如果经由本计划代销机构(如有)办理参与的，本集合计划的申购费可由代销机构支配，不列入计划财产，具体以集合计划代销协议的约定为准。 集合计划管理人可根据情况自行调低或豁免部分基金投资者的参与费，如果代销机构的代销协议对投资者参与费进行调低或豁免的，从其规定。</p> <p>(二) 管理费率： 本集合计划的管理费率为【0.6】%/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投资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。</p> <p>(三) 托管费率： 本集合计划的托管费率为【0.02】%/年，托管费由集合计划财产承担。 集合计划于托管费每日计提，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投资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托管人。</p> <p>(四) 投资顾问费： 本计划无投资顾问费。</p> <p>(五) 业绩报酬： 以上一个业绩报酬计提日下一个工作日至本次业绩报酬计提日的投资者持有份额的年化收益率R超过业绩报酬计提基准部分的20%作为业绩报酬。</p>
<p>六、募集结算专用账户披露渠道和查询方式</p> <p>本计划募集结算专用账户在管理人官网进行披露，投资者可在管理人处查询；销售机构委托募集账户(如有)由销售机构向投资者进行披露，投资者可在销售机构处查询。 投资者的认购参与款项(不含认购费用)加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有，原则上T+2日起计息，以份额登记机构的记录为准。</p>	<p>六、募集结算专用账户披露渠道和查询方式</p> <p>本计划募集结算专用账户(含直销柜台募集结算账户)在管理人官网进行披露，投资者可在管理人处查询；销售机构委托募集账户(如有)由销售机构向投资者进行披露，投资者可在销售机构处查询。 投资者的认购参与款项(不含认购参与费用)加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有，原则上T+2日起计息，以份额登记机构的记录为准。</p>
第七节 集合计划的成立与备案	
<p>一、集合计划成立的条件和日期</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</p>	<p>一、集合计划成立的条件和日期</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，经管理人聘请的符合《证券法》要求的的</p>

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。	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。
--	--

第八节 资产管理计划的参与、退出与转让

<p>一、集合计划的参与</p> <p>(一) 参与的办理时间</p> <p>2、开放期参与</p> <p>本集合计划运作期间每周二开放参与，如果周二为节假日，则顺延至周二之后的第一个工作日。管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑对本集合资产管理计划的申购/认购额度进行控制。</p> <p>在开放期投资者可办理参与业务，办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间，遇法定节假日顺延。具体开放期以管理人公告为准，集合计划按规定限制或暂停退出的情况除外。</p>	<p>一、集合计划的参与</p> <p>(一) 参与的办理时间</p> <p>2、开放期参与</p> <p>本集合计划运作期间每个自然月的15日、16日开放，每次开放2个工作日（遇法定节假日顺延）。</p> <p>管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑对本集合资产管理计划的申购/认购额度进行控制，并通过管理人公告披露。</p>
<p>(二) 参与的原则</p> <p>3、“金额参与”原则，即参与时以金额申请。本集合计划的单个投资者首次参与的最低金额为40万元，超过部分按1万及1万整数倍递增，追加参与的最低金额为1万元，超过部分按1万元整数倍递增。首次参与指提出参与申请的投资者在参与之前未持有本计划份额的情形。</p>	<p>(二) 参与的原则</p> <p>3、“金额参与”原则，即参与时以金额申请。本集合计划的单个投资者首次参与的最低金额为30万元，超过部分按1万及1万整数倍递增，追加参与的最低金额为1万元，超过部分按1万元整数倍递增。首次参与指提出参与申请的投资者在参与之前未持有本计划份额的情形。</p>
<p>(四) 参与费及参与份额的计算</p> <p>1、参与费率：</p> <p>本集合计划不收取参与费，即参与费率为0。</p> <p>2、参与份额的计算方法：</p> <p>销售期参与份额的计算：</p> <p>参与份额 = (参与金额 + 销售期利息) ÷ 集合计划份额面值</p> <p>集合计划份额面值为1.0000元。投资者参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。</p> <p>如本集合计划在销售期内参与的客户数达到200户，或达到规模上限的，可提前终止销售期。管理人提前结束销售的，应通知各销售网点结束产品认购，同时公告销售期提前结束。</p> <p>本集合计划管理人在销售期内使用“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。</p> <p>具体计算参见例1。</p> <p>例1：某投资者投资1,000,000元参与本集合计划，假设销售期产生利息50元，则该投资者最终可得到的集合计划份额计算如下：</p> <p>参与份额 = (1,000,000 + 50) / 1.00 = 1,000,050份</p>	<p>(四) 参与费及参与份额的计算</p> <p>1、参与费率：</p> <p>本集合计划参与费率为【1】%。计算方法如下：</p> <p>净参与金额 = 参与金额 ÷ (1 + 参与费率)</p> <p>参与费用 = 参与金额 - 净参与金额</p> <p>参与费用由投资人承担，不列入本集合计划财产；如果经由本计划代销机构（如有）办理参与的，本集合计划的申购费可由代销机构支配，不列入计划财产，具体以集合计划代销协议的约定为准。</p> <p>集合计划管理人可根据情况自行调低或豁免部分基金投资者的参与费，如果代销机构的代销协议对投资者参与费进行调低或豁免的，从其规定。</p> <p>2、参与份额的计算方法：</p> <p>销售期参与份额的计算：</p> <p>参与份额 = (净参与金额 + 销售期利息) ÷ 集合计划份额面值</p> <p>集合计划份额面值为1.0000元。投资者参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。</p> <p>如本集合计划在销售期内参与的客户数达到200户，或达到规模上限的，可提前终止销售期。管理人提前结束销售的，应通知各销售网点结束产品认购，同时公告销售期提前结束。</p> <p>本集合计划管理人在销售期内使用“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。</p> <p>具体计算参见例1。</p>
<p>(2) 开放期参与份额的计算</p> <p>参与份额 = 参与金额 ÷ 受理申请当日（T日）集合计划份额单位净值</p>	<p>(2) 开放期参与份额的计算</p> <p>参与份额 = 参与金额 ÷ 受理申请当日（T日）集合计划份额单位净值</p>

	<p>例 1: 某投资者投资 1,000,000 元参与本集合计划, 对应参与费率 1%, 假设销售期产生利息 50 元, 则该投资者最终可得到的集合计划份额计算如下:</p> <p>参与份额 = $(1,000,000 / (1+1\%) + 50) / 1.00 = 990149.01$ 份</p> <p>(2) 开放期参与份额的计算</p> <p>参与份额 = 净参与金额 ÷ 受理申请当日 (T 日) 集合计划份额单位净值</p>
<p>二、集合计划的退出</p> <p>(一) 退出的办理时间</p> <p>本集合计划每月第一个周一开放退出, 如果周一为节假日, 则顺延至周一之后的第一个工作日。投资者一旦参与本集合计划最短持有份额期限不得少于 270 天, 投资者参与本集合计划份额满 270 天后方可按照本合同约定在开放退出日申请退出, 办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间。集合计划按规定限制或暂停退出的情况除外。</p>	<p>二、集合计划的退出</p> <p>(一) 退出的办理时间</p> <p>本集合计划运作期间每个自然月的 15 日、16 日开放, 每次开放 2 个工作日 (遇法定节假日顺延), 但仅第 1 个开放日投资者可办理退出业务。</p> <p>投资者可退出的每笔份额持有时间不得少于 9 个月 (例如投资者于 2021 年 6 月申购确认的份额可于 2022 年 3 月 (含) 及之后的任一开放期退出), 办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间。集合计划按规定限制或暂停退出的情况除外。</p>
<p>(二) 退出的原则</p> <p>4、投资者部分退出集合计划份额时, 如其该笔申请退出后在该销售机构剩余的集合计划份额净值低于 40 万元时, 则管理人自动将该投资者在该销售机构的全部份额退出给投资者。</p>	<p>(二) 退出的原则</p> <p>4、投资者部分退出集合计划份额时, 如其该笔申请退出后在该销售机构剩余的集合计划份额净值低于 30 万元时, 则管理人自动将该投资者在该销售机构的全部份额退出给投资者。</p>
<p>(三) 退出的程序和确认</p> <p>1、退出申请的提出: 投资者可于持有本集合计划满 270 天后的每月第一个周一开放退出日 (T 日) 申请退出, 如果周一为节假日, 则顺延至周一之后的第一个工作日。</p>	<p>(三) 退出的程序和确认</p> <p>1、退出申请的提出: 投资者可对持有时间满 9 个月的计划份额申请于每月开放期的第一个开放日退出, 具体开放退出日以管理人公告为准。</p>
<p>三、集合计划的转让</p> <p>(一) 集合计划份额的转让</p> <p>本计划成立后, 投资者可以按照规定申请份额转让事宜。申请份额转让事宜之后, 投资者、销售机构的客户之间可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额, 并按规定办理份额变更登记手续。但转让后每个投资者持有集合计划金额不得少于 40 万元, 投资者合计不超过 200 人。受让方应符合本合同约定的合格投资者要求, 受让方首次参与集合计划的, 应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。</p>	<p>三、集合计划的转让</p> <p>(一) 集合计划份额的转让</p> <p>本计划成立后, 投资者可以按照规定申请份额转让事宜。申请份额转让事宜之后, 投资者、销售机构的客户之间可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额, 并按规定办理份额变更登记手续。但转让后每个投资者持有集合计划金额不得少于 30 万元, 投资者合计不超过 200 人。受让方应符合本合同约定的合格投资者要求, 受让方首次参与集合计划的, 应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。</p>
第十一节 资产管理计划的投资	
<p>五、投资范围和投资组合设计</p> <p>(一) 投资范围</p> <p>(1) 固定收益类资产: 国债、央行票据、地方政府债、金融债、大额存单、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、非公开定向债务融资工具 (PPN)、在交易所和银行间挂牌交易的资产支持证券 (ABS) (不含次级)、资产支持票据 (ABN) (不含次级)、项目收益债券 (NPB)、债券回购、私募债、可转换公司债券、可交换公司债券;</p>	<p>五、投资范围和投资组合设计</p> <p>(一) 投资范围</p> <p>(1) 固定收益类资产: 国债、央行票据、地方政府债、金融债、大额存单、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、非公开定向债务融资工具 (PPN)、在交易所和银行间挂牌交易的资产支持证券 (ABS) (不含次级)、资产支持票据 (ABN) (不含次级)、项目收益债券 (NPB)、债券逆回购、私募债、可转换公司债券、可交换公司债券;</p>

<p>(2) 沪深交易所上市交易的股票(含科创板)、创业板交易的股票、港股通、优先股、新股申购(含科创板)、股指期货、国债期货、商品期货、场内期权;</p> <p>(3) 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、结构性存款等)、货币市场基金等;</p> <p>(4) 证券投资基金(包括分级基金A、分级基金B、ETF和LOF)、仅投资于以上标的的券商资产管理计划和于中国基金业协会官方网站公示并已登记为私募证券投资基金管理人发行的契约式私募投资基金。</p> <p>本集合计划可以依法参与债券回购、融资融券业务。</p> <p>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书面变更或补充,并由管理人向投资者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。</p> <p>(二) 本计划的投资比例和投资限制</p> <p>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:经过穿透合并计算后,投资于股票、股票型基金等权益类资产、固定收益类资产的金额、商品及金融衍生品持仓合约价值占本集合计划总资产的比例分别低于80%;</p>	<p>(2) 权益类、商品及金融衍生品类资产;沪深交易所上市交易的股票(含科创板)、创业板交易的股票、港股通、优先股、新股申购(含科创板)、股指期货、国债期货、商品期货、场内期权;</p> <p>(3) 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、结构性存款等)、货币市场基金;</p> <p>(4) 经中国证监会已发核准或注册的公开募集基金(包括封闭式基金、开放式基金、上市开放式基金(LOF)和交易型开放式指数基金(ETF)、基础设施证券投资基金(Reits))、仅投资于以上标的的券商资产管理计划和于中国基金业协会官方网站公示并已登记为私募证券投资基金管理人发行的契约式私募投资基金。</p> <p>本集合计划可以依法参与债券正回购、融资融券业务,为提升组合收益提供了可能,但也存在一定风险。</p> <p>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书面变更或补充,并由管理人向投资者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。</p> <p>(二) 本计划的投资比例和投资限制</p> <p>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:经过穿透合并计算后,投资于固定收益类及现金类资产的金额合计占本集合计划总资产的比例高于80%。投资于权益类资产(包括股票、股票型基金)、商品及金融衍生品持仓合约价值占本集合计划总资产的比例合计低于20%;</p>
<p>(二) 本计划的投资比例和投资限制</p> <p>2、投资限制(占集合计划资产总值)</p> <p>(5) 按照穿透原则合并计算,投资于股票、股票型基金等权益类资产、固定收益类资产的金额、商品及金融衍生品持仓合约价值占本集合计划总资产的比例分别低于80%;</p> <p>(6) 按照穿透原则合并计算,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。全部投资者为专业投资者且单个投资者投资金额不低于1000万元的,可以不受该限制。</p>	<p>(二) 本计划的投资比例和投资限制</p> <p>2、投资限制</p> <p>(5) 按照穿透原则合并计算,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。全部投资者为专业投资者且单个投资者投资金额不低于1000万元的,可以不受该限制。</p>
<p>4、投资禁止行为</p> <p>(7) 本计划投资的其他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。</p> <p>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</p>	<p>4、投资禁止行为</p> <p>(7) 本计划投资的其他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。</p>

<p>节第四点、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。</p>	
<p>六、集合计划的风险收益特征及适合销售对象 本计划属于【中高风险 R4】投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【普通投资者的 C4-C5 及专业投资者】的合格投资者。</p>	<p>六、集合计划的风险收益特征及适合销售对象 本计划属于【中等风险 R3】投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【普通投资者的 C3-C5 及专业投资者】的合格投资者。</p>
<p>七、投资决策与风险控制 （三）风险控制 3、风险控制组织架构 2) 实施系统：风控部门。公司风险管理的专职日常工作机构，组织实施风险管理的具体工作内容与任务，通过公司风控平台，对集合资产管理业务的运作状况进行监控、分析和评估。</p>	<p>七、投资决策与风险控制 （三）风险控制 3、风险控制组织架构 2) 实施系统：风控部门。公司风险管理的专职日常工作机构，组织实施风险管理的具体工作内容与任务，对集合资产管理业务的运作状况进行监控、分析和评估。</p>
<p>4、投资风险管理程序 1) 建立风险控制构架，完善风险控制制度和体系 在组织架构方面，在公司层面，风控部门动态监控资产管理业务的运作、稽核部门检查内控制度的执行情况及负责审计监督、合规部门审查业务的合规性、运营管理部门对资产管理业务实行集中清算。在资产管理业务部门内部将市场营销、投资管理、交易执行、风险管理等岗位分设，通过职能分离形成制衡。</p>	<p>4、投资风险管理程序 1) 建立风险控制构架，完善风险控制制度和体系 在组织架构方面，在公司层面，风控部门动态监控资产管理业务的运作、稽核部门检查内控制度的执行情况及负责审计监督、合规部门审查业务的合规性、运营管理部门对资产管理业务实行集中清算。在资产管理业务部门内部将市场营销、投资管理、交易执行、风险管理等岗位分设，通过职能分离形成制衡。</p>
<p>3) 风险评估 公司风控部门定期或不定期评估集合资产管理业务的风险状况，范围包括所有可能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对集合计划总体目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司领导及相关部门。 本集合计划参与股指期货交易业务的，管理人对期货交易业务进行实时监控。 管理人通过风险监控系統实时监控资产管理业务的风险，根据风控指标预警情况，及时发出风险提示。 4) 风险报告 公司风控部门对风险事件进行分析，制作定期或不定期风险管理报告，及时报送公司领导及相关部门。</p>	<p>3) 风险评估 公司风控部门定期或不定期评估集合资产管理业务的风险状况，范围包括所有可能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对集合计划总体目标产生影响的程度及可能性。 本集合计划参与股指期货交易业务的，管理人对期货交易业务进行实时监控。 管理人通过风险监控系統实时监控资产管理业务的风险，根据风控指标预警情况，及时发出风险提示。 4) 风险报告 公司风控部门对风险事件进行分析，制作定期或不定期风险管理报告。</p>
<p>5、外部风险监督 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>5、外部风险监督 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>第十四节 利益冲突及关联交易</p>	
<p>无</p>	<p>新增条款</p>

	<p>本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率：</p> <p>（一）管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，公平对待全体投资者，实现在公司、股东和员工个人的利益与投资者的利益发生冲突时，优先保障投资者的利益，不同投资者之间的利益发生冲突时，公平对待不同投资者。</p> <p>（二）公司制定了利益冲突管理制度，按照内外部管控要求识别、报告、评估、解决利益冲突事项，包括采取相应的措施防止产生利益冲突；采取相应措施以确保公司、公司关联方以及员工不得因自己的利益导致投资者损失或使投资者处于不利地位；对于法律法规、监管规定允许的的利益冲突事项，公司以符合法律法规、监管规定或相关合同约定的方式向投资者披露、揭示或者报告。</p>
--	---

第十五节 投资经理的指定与变更

<p>一、投资经理的指定</p> <p>（二）投资经理简历</p> <p>袁馨</p> <p>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。</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>杨镭</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。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>一、投资经理的指定</p> <p>（二）投资经理简历</p> <p>赵睿</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>杨靖磊</p> <p>投资经理，法国蒙彼利埃大学博士，工学硕士，清华大学汽车安全与节能国家重点实验室成员，5年央企从业经历，4年证券研究经验。历任华鑫证券研究发展部汽车及新能源行业高级分析师、资产管理部高级研究员，并对可转债、封闭式基金等低风险稳收益投资品种有深入研究，擅长从绝对价值角度出发挖掘市场确定性投资机会。</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>
---	---

第十八节 越权交易的界定

<p>二、越权交易的处理程序</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>二、越权交易的处理程序</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>（四）托管人对管理人的投资行为行使监督权。托管人根据本合同附件《投资监督事项表》的约定，对本计划履行投资监督</p>
--	--

义务。

第十九节 资产管理计划财产的估值和会计核算

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初始取得成本时，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初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV = C + (P - C) \times \frac{D_1 - D_r}{D_1}$$

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初始取得成本；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）。

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或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在 0.5% 以上的，可参考停牌股票的估值方法，调整最近交易日收盘价，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一股票的收盘价进行估值。

(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一股票的市价进行估值；在考虑投资策略的情况下，也可以参照第 4 条的方法估值。

(4) 流通受限股的估值处理

本节所称流通受限股票，是指在发行时明确一定期限销售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行时股票公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票。

i. 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值。

$$FV = S \times (1 - LoMD)$$

其中：FV：估值日该流通受限股票的价值；S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值；LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。

ii. 引入看跌期权计算该流通受限股票对应的流动性折扣。

LoMD = P/S，P 是估值日看跌期权的价值。

iii. 证券投资基金持有的流通受限股票在估值日按平均价格亚式期权模型（“AAP 模型”）确定估值日看跌期权的价值。

AAP 模型公式如下所示：

$$P = Se^{-qT} \left[N \left(\frac{v\sqrt{T}}{2} \right) - N \left(-\frac{v\sqrt{T}}{2} \right) \right]$$

$$v\sqrt{T} = \left\{ \sigma^2 T + \ln \left[2 \left(e^{\sigma^2 T} - \sigma^2 T - 1 \right) \right] - 2 \ln \left(e^{\sigma^2 T} - 1 \right) \right\}^{\frac{1}{2}}$$

其中：S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值；T：剩余限售期，以年为单位表示；σ：股票在剩余限售期内的

	<p>股价的预期年化波动率；q：股票预期年化股利收益率；N：标准正态分布的累积分布函数。</p> <p>iv. 停牌股票可根据具体情况采用以下估值方法：指数收益法；可比公司法或相对估值法；市场价格模型方法。</p> <p>有充足理由表明按以上估值方法仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，可根据具体情况，选择现金流折现法（DCF）、市盈率法（Earnings Multiple）等估值模型进行估值。</p> <p>（5）交易所停止交易等非流通品种的估值：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。</p>
<p>（二）债券估值方法</p> <p>1、交易所市场交易品种估值处理</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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。如基金管理人认为成本能够近似体现公允价值，基金管理人应该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。</p> <p>（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。</p> <p>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。</p> <p>3、银行间市场交易品种估值处理</p> <p>（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。</p> <p>（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。</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> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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。未公开发行上市的资产支持证券和私募债券，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，按成本法估值。</p> <p>（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。</p> <p>2、银行间市场交易品种估值处理</p> <p>（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</p>

<p>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。</p> <p>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。</p>	<p>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。</p> <p>（2）对在银行间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。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本法估值。</p> <p>3、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>4、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；选定的第三方机构未提供估值价格的，按成本估值。管理人采用上述估值方法对固定收益品种进行估值，应被认为采用了适当的估值方法，但是如果管理人认为上述估值方法不能客观反应其公允价值的，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债券估值，管理人可以根据具体情况与托管人商定后，按最能反应其公允价值的价格估值。</p>
<p>（三）证券投资基金估值方法</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、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。</p>	<p>（三）证券投资基金估值方法</p> <p>1、持有的交易所基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）等），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p> <p>2、持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。</p> <p>3、场内申购获得的ETF基金按【转出股票价值+现金替代+现金差额-可收替代】确认成本，其中，转出股票价值按估值日各转出股票收盘价计算；基金公司未公布估值日现金替代的，按基金公司公布的估值日预估现金部分计算，并于估值日现金差额公布后调整ETF基金成本；可收替代款于收到退补数据后调整ETF基金成本；如果现金差额公布日或者退补数据公布日，已无ETF持仓，该部分差额直接计入产品收益。场内赎回ETF基金获得的成分股票按【当日收盘价，如果停牌取最近日收盘价】确认成本，管理人应按日向托管机构提供退补数据；持有的ETF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。</p> <p>4、场内持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母</p>

	<p>基金能够在交易所交易的，按照第1条规定的方法估值；不能在交易所交易的，按照第2条规定的方法估值。</p> <p>5、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，按照成本估值。</p> <p>6、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。</p>
<p>（四）现金管理类资产估值方法</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	<p>（四）现金管理类资产估值方法</p> <p>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。</p> <p>持有的货币市场基金，按基金公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计算。</p>
<p>（五）交易所交易衍生品的估值方法</p> <p>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。</p>	<p>（五）交易所交易衍生品的估值方法</p> <p>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,或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。</p> <p>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。</p> <p>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。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本进行估值。</p> <p>4、基金投资的股指期货合约一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,其最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。</p> <p>5、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,其最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。</p>
<p>第二十章 集合计划的费用与税收</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【1%】年费率计算,计算方法如下:</p> $H = E \times 1\% / 365$ <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>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【0.6%】年费率计算,计算方法如下:</p> $H = E \times 0.6\% / 365$ <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>（六）银行结算费用、开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费、注册登记机构收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用。</p> <p>银行结算费用(包括但不限于银行账户的资金结算汇划费、账户维护费、询证费等各类银行收取的费用等),在发生时一次性计入集合计划费用。</p>	<p>（六）银行结算费用、开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费、注册登记机构收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用。</p> <p>银行结算费用(包括但不限于银行账户的资金结算汇划费、账户维护费、询证费等各类银行收取的费用等),在发生时一次性计入集合计划费用。</p>

<p>开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用。</p> <p>与集合计划运营有关的其他费用，在发生时一次进入集合计划费用。</p>	<p>开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费及与集合计划运营有关的其他费用，在发生时一次计入集合计划费用。</p>																		
<p>二、业绩报酬</p> <p>2、业绩报酬计算方法、计提比例和提取频率</p> <table border="1" data-bbox="167 488 762 683"> <thead> <tr> <th>年化收益率 (R)</th> <th>计提比例</th> <th>业绩报酬 (E) 的计算方法</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>R ≤ 7%</td> <td>0</td> <td>E=0</td> </tr> <tr> <td>R > 7%</td> <td>20%</td> <td>$E = F \times P_0^* \times [(R - \text{业绩报酬计提基准}\%) \times 20\%] \times D / 365$</td> </tr> </tbody> </table>	年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (E) 的计算方法	R ≤ 7%	0	E=0	R > 7%	20%	$E = F \times P_0^* \times [(R - \text{业绩报酬计提基准}\%) \times 20\%] \times D / 365$	<p>二、业绩报酬</p> <p>2、业绩报酬计算方法、计提比例和提取频率</p> <table border="1" data-bbox="794 488 1412 683"> <thead> <tr> <th>年化收益率 (R)</th> <th>计提比例</th> <th>业绩报酬 (E) 的计算方法</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>R ≤ 5.8%</td> <td>0</td> <td>E=0</td> </tr> <tr> <td>R > 5.8%</td> <td>20%</td> <td>$E = F \times P_0^* \times [(R - 5.8\%) \times 20\%] \times D / 365$</td> </tr> </tbody> </table>	年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (E) 的计算方法	R ≤ 5.8%	0	E=0	R > 5.8%	20%	$E = F \times P_0^* \times [(R - 5.8\%) \times 20\%] \times D / 365$
年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (E) 的计算方法																	
R ≤ 7%	0	E=0																	
R > 7%	20%	$E = F \times P_0^* \times [(R - \text{业绩报酬计提基准}\%) \times 20\%] \times D / 365$																	
年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (E) 的计算方法																	
R ≤ 5.8%	0	E=0																	
R > 5.8%	20%	$E = F \times P_0^* \times [(R - 5.8\%) \times 20\%] \times D / 365$																	
<p>3、业绩报酬计提说明</p> <p>(2) 收益分配时计提</p> <p>当管理人进行收益分配时，管理人将根据年化收益计提业绩报酬，业绩报酬计提方式与清算终止计提方式相同，从投资者分红款项中予以扣除。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。</p> <p>例 3：某投资者分红日持有份额 400,000 份，分红日单位累计净值为 1.15 元，上一业绩报酬计提日单位累计净值为 1.10 元，上一业绩报酬计提日单位净值为 1.00 元，分红日至上一个业绩报酬计提日的间隔天数为 183 天，则</p> <p>R (年化收益率) = $(1.15 - 1.10) \div 1.00 \times (365 \div 183) \times 100\% = 9.97\%$</p> <p>$E$ (业绩报酬) = $400,000 \times 1.00 \times [(9.97\% - 7.0\%) \times 20\%] \times 183 / 365 = 1191.25$ 元。</p> <p>注：当分红时，不满足业绩报酬提取条件时，不计提业绩报酬。</p> <p>业绩报酬采用按账户计提的方式。</p>	<p>3、业绩报酬计提说明</p> <p>(2) 收益分配时计提</p> <p>当管理人进行收益分配时，管理人将根据年化收益计提业绩报酬，业绩报酬计提方式与清算终止计提方式相同，从投资者分红款项中予以扣除。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。</p> <p>注：当分红时，不满足业绩报酬提取条件时，不计提业绩报酬。业绩报酬采用按账户计提的方式，多次参与、退出的在计算份额持有天数时采用“先进先出”法，比如，某投资者首次参与了 100 万份，1 个月后又追加参与 200 万份，10 个月后又退出 150 万份，则认为这 150 万份中的 100 万份持有 10 个月，另外的 50 万份持有 9 个月，分别计算业绩报酬。</p> <p>4、业绩报酬支付</p> <p>业绩报酬在业绩报酬计提日计提，由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人据此计提应付管理人业绩报酬。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，业绩报酬以管理人提供的数据为准。托管人根据管理人的指令将业绩报酬支付给管理人。</p>																		
<p>无</p>	<p>新增条款：</p> <p>五、费用调整</p> <p>本集合计划各项费用调低，经管理人和托管人协商一致即可；若各项费用需调高，则应由管理人、托管人与投资者协商一致通过后由管理人向投资者发布公告后方可调整。</p>																		
<p>第二十一节 资产管理计划的收益与分配</p>																			
<p>三、收益分配原则</p> <p>(一) 每份集合计划份额享有同等分配权。</p> <p>(二) 如果投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。</p> <p>(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。</p> <p>(四) 原则上集合计划收益分配频率以管理人公告为准。</p> <p>(五) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者承担。</p> <p>(六) 法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>	<p>三、收益分配原则</p> <p>(一) 每份集合计划份额享有同等分配权。</p> <p>(二) 如果投资当期出现净亏损，则不进行收益分配。</p> <p>(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。</p> <p>(四) 本集合计划的分红方式为现金红利方式，即集合计划份额收益分配基准日 (R 日)。R 日管理人在扣除集合计划相关费用后，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折算为现金，向投资者分配。但若集合计划可分配收</p>																		

	<p>益小于零，则管理人不对集合计划进行收益分配。</p> <p>(五) 在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，分配频率不高于6个月一次，收益分配频率以管理人公告为准。</p> <p>(六) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者承担。</p> <p>(七) 法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>
<p>四、收益分配方案的确定与披露</p> <p>1、管理人计算集合计划的可分配收益。</p> <p>2、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。</p> <p>3、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，由托管人核实总金额后确定。</p> <p>4、管理人通知投资者。管理人将收益分配方案在官网上向投资者公告。</p> <p>5、实施分配方案。</p>	<p>四、收益分配方案的确定与披露</p> <p>各方一致同意本集合计划收益分配方案由管理人拟定，包括集合计划收益的范围、集合计划收益分配基准日、分红权益登记日、集合计划净收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，由托管人复核后确定，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投资者公告。集合计划收益分配基准日和红利发放日由管理人决定，但收益分配基准日到红利发放日的时间不超过15个工作日。</p>
<p>五、收益分配的执行</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，在收益分配日根据资产管理计划管理人的投资指令进行处理。</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，默认现金分红。</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>五、收益分配的执行</p> <p>资产管理人依据具体的收益分配方案的规定就支付的现金红利向资产托管人发送划款指令，资产托管人按照资产管理人的指令及时进行分红资金的划付。</p> <p>收益分配由托管人将分红款划至管理人账户（管理人统一分配）。收益分配方案中需载明的内容包括但不限于收益范围、分配对象、分配原则、分配时间、分配方式等。托管人仅依据合同约定及管理人指令，对收益分配方案中的收益范围、分配方式、分配金额等要素进行核对。若划至管理人统一分配，托管人对于收益分配方案的复核内容仅限于对收益分配的总金额进行复核，对于在不同投资者之间分配的金额、分配顺序不承担复核义务，托管人不对向受益人划转资金本息的及时性、准确性负责。</p>
<p>第二十二节 信息披露与报告</p>	
<p>一、定期报告</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>报告内容需披露信息：</p> <p>1、管理人履职报告；</p> <p>2、托管人履职报告；</p>	<p>一、定期报告</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>报告内容需披露信息：</p> <p>1、管理人履职报告；</p> <p>2、托管人履职报告；</p> <p>3、资产管理计划投资表现；</p> <p>4、资产管理计划投资组合报告；</p>

<p>3、资产管理计划投资表现；</p> <p>4、资产管理计划投资组合报告；</p> <p>5、资产管理计划运用杠杆情况（如有）；</p> <p>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；</p> <p>7、资产管理计划投资收益分配情况；</p> <p>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；</p> <p>9、中国证监会规定的其他事项。</p>	<p>5、资产管理计划运用杠杆情况（如有）；</p> <p>6、资产管理计划财务会计报告；</p> <p>7、资产管理计划投资收益分配情况；</p> <p>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；</p> <p>9、中国证监会规定的其他事项。</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公告，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公告。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>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>（四）年度审计报告</p> <p>管理人应当聘请符合《证券法》要求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>二、临时报告</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（其中第七条严重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）集合计划终止和清算。</p> <p>（三）合同的补充、修改与变更。</p> <p>（四）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁、财产纠纷事项。</p> <p>（五）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>（六）管理人、托管人因严重违法违规，被中国证监会取消相关业务资格。</p> <p>（七）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>（八）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>二、临时报告</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（其中第六条严重违法违规发生之日起两个工作日内），除以下第三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，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、负面舆论、群体性事件等重大风险事件的。</p> <p>（三）集合计划合同的变更、展期、终止和清算。</p> <p>（四）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁、财产纠纷事项。</p> <p>（五）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>（六）管理人、托管人因严重违法违规，被中国证监会取消相关业务资格。</p> <p>（七）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>（八）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>(九) 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) 其他管理人认为的重大事项。</p>	<p>(九) 其他管理人认为的重大事项。</p> <p>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>
---	---

第二十三节 风险揭示

<p>二、一般风险</p> <p>(一) 本金损失风险</p> <p>管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产,但不保证资产管理计划财产中的认(申)购资金本金不受损失,也不保证一定盈利及最低收益。本资产管理计划属于【中高风险 R4】风险投资品种,适合风险识别、评估、承受能力【普通投资者的 C4-C5 及专业投资者】的合格投资者。</p>	<p>二、一般风险</p> <p>(一) 本金损失风险</p> <p>管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产,但不保证资产管理计划财产中的认(申)购资金本金不受损失,也不保证一定盈利及最低收益。本资产管理计划属于【中等风险 R3】风险投资品种,适合风险识别、评估、承受能力【普通投资者的 C3-C5 及专业投资者】的合格投资者。</p>
<p>(八) 合同变更风险</p> <p>管理人经托管人同意后可以对本合同做出调整和补充。管理人将及时通过管理人网站或书面形式(由管理人决定)就合同变更内容向投资者征询意见。</p> <p>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。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人网站公告满 5 个工作日后生效。投资者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。</p> <p>除上述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)向投资者发送合同变更征询意见函(或通知)。投资者应在征询意见函(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。投资者不同意变更的,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以书面方式告知管理人;投资者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)指定的日期届满的最后一工作日开始生效,对合同各方均具有法律效力。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:在本集合计划份额可以转让前,若有任意一位投资者不同意</p>	<p>(八) 合同变更风险</p> <p>管理人可自行决定合同内容变更的事项,管理人与托管人协商一致可变更的事项,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变更的。除以上事项外,如发生合同变更的其余事项,需向投资者征询意见,投资者不同意变更的,应在收到征询意见函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提出退出本计划的申请,对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本计划的投资者,管理人将统一在合同变更生效日次日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)。以上合同变更流程及程序可能对投资者带来的风险。</p>

<p>合同变更，则管理人不得变更合同，并公告本次合同变更未成立。</p> <p>在本集合计划份额可以转让后，投资者不同意合同变更的，按相关规定转让本集合计划份额。</p>	
<p>无</p>	<p>新增条款</p> <p>(十三) 投资标的风险</p> <p>2、投资证券投资基金、券商资产管理计划、公募基金、于基金业协会官方网站公示已登记的私募证券投资基金管理人发行的契约式私募投资基金的风险。</p> <p>I、基础设施证券投资基金 (Reits) 份额持有人的特有风险</p> <p>由于基础设施证券投资基金 (Reits) 主要投资于最终标的为基础设施项目的基础设置资产支持证券，通过资产支持证券、项目公司等特殊目的载体取得寄出设施项目完全所有权。基金交易价格会因为基础设施项目运营情况、证券市场波动等因素产生波动，并承担基金投资运作中的各项风险，包括但不限于系统性风险，基金管理人在基础设施项目运营过程中产生的风险等。</p> <p>5、投资于商品及金融衍生品风险 (如有)</p> <p>D、场内期权投资的风险</p> <p>期权会面临流动性风险，同时因杠杆特性，较普通金融工具面临更大的市场风险。在交易这一类金融衍生品时，如果不能按照约定的期限清偿债务，或标的证券价格波动导致担保物价值与其金融衍生品债务之间的比例低于维持担保比例，且不能按照约定的时间、数量追加担保物时，将面临担保物被证券公司强制平仓的风险。可能出现金融机构降低授信额度，或者提高相关警戒指标、平仓指标，可能给本基金造成经济损失。另外，受贷款基准利率调高影响，金融机构可能相应调高融资利率，本基金将面临资金成本上升的风险。</p>
<p>第二十四节 资产管理合同的变更、终止与清算</p>	
<p>一、合同的补充、修改与变更</p> <p>(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。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人网站公告满 5 个工作日后生效。投资者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。</p> <p>(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) 向投资者发送合同变更征询意见函 (或通知)。投</p>	<p>一、合同的补充、修改与变更</p> <p>(一) 资产管理合同的变更</p> <p>1、委托人、管理人与托管人书面一致同意，以下事项由管理人自行决定变更：</p> <p>(1) 调低管理人的报酬标准 (需告知托管人) ；</p> <p>(2) 不影响后续投资策略执行的情况下，投资经理的变更；</p> <p>(3) 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；</p> <p>2、委托人、管理人与托管人书面一致同意，以下事项可由管理人和托管人协商后变更：</p> <p>(1) 调低托管人的报酬标准；</p> <p>(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</p>

投资者应在征询意见函（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。投资者不同意变更的，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；投资者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）指定的日期届满的最后一工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。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：
在本集合计划份额可以转让前，若有任意一位投资者不同意合同变更，则管理人不得变更合同，并公告本次合同变更未成立。
在本集合计划份额可以转让后，投资者不同意合同变更的，按相关规定转让本集合计划份额。

集合计划备案补正意见的要求涉及到合同修改的，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、除前文第1项、第2项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）向投资者发送合同变更征询意见函（或通知）。投资者应在征询意见函（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。投资者不同意变更的，应在征询意见函（或通知）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或未在指定开放期内退出本集合计划的，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日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。

（二）发生下列事项时，应由承接的管理人或托管人承接合同相应的权利与义务，并按上述第3项履行合同变更程序：

（1）管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接。发生此等情形时，原管理人应当向新的管理人交接本资产管理计划资产管理事务。

（2）托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他托管人承接。发生此等情形时，原托管人应当向新的托管人交接本资产管理计划资产托管事务。

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。

管理人应根据二次清算方案的规定，对该部分未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，将变现后的资产扣除

三、集合计划的清算

（四）清算结束后5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。并及时向证券投资基金业协会报告。清算期间继续根据本合同约定计提管理费、托管费等相关费用。

二次清算完成后，清算财产的分配按照下列顺序清偿：

（1）支付二次清算费用。

<p>相关费用后按照投资者拥有份额的比例，以货币形式全部分配给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。在进行二次清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。未返还投资者的计划资产照常计提管理费及托管费。</p> <p>对于由计划交纳、注册登记机构收取的最低结算备付金和交易单元保证金，在注册登记机构对其进行调整交收日才能收回，届时，集合计划清算小组将及时按照投资者拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分配给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，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>(六) 管理人需向托管人提供清算分配所需资料，托管人据此复核。</p> <p>(七) 清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，由清算小组从集合计划资产中支付。</p> <p>资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。</p>	<p>(2) 缴纳所欠税款；</p> <p>(3) 清偿计划债务；</p> <p>(4) 按照合同约定支付管理费、业绩报酬及托管费等费用；</p> <p>(5) 将资产管理计划资产按照投资者拥有本计划份额的比例或资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给投资者；</p> <p>委托资产未按前款(1)、(2)、(3)、(4)项规定清偿前，不分配给投资者，但对于管理费和业绩报酬，在计划资产分配给投资者之前管理人有权仅计提，不支付。清算费用中的银行汇划费、账户管理费用由资产托管行负责进行匡算，并于清算日确认入账。</p> <p>在进行二次清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。对于由计划交纳、注册登记机构收取的最低结算备付金和交易单元保证金，在注册登记机构对其进行调整交收日才能收回，届时，集合计划清算小组将及时按照投资者拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分配给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，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。投资者、管理人、托管人对清算报告无异议后，管理人匡算合同终止日的下一个月最低备付金及保证金，并预提足够的清算备用资金后向投资者支付首期清算款。</p> <p>(六) 管理人需向托管人提供清算分配所需资料，托管人据此复核。</p> <p>(七) 清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，由清算小组从集合计划资产中支付。</p> <p>(八) 清算费用的来源为本集合计划财产承担，支付方式以管理人指令为准。</p> <p>(九) 本集合计划财产清算完毕后，托管人应按照规定注销资产管理计划财产的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。</p> <p>资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。</p>
---	---

第二十八节 管理人自有资金参与集合计划

<p>一、 自有资金的参与</p> <p>(三) 参与的金额和比例</p> <p>管理人以自有资金参与本集合计划，参与份额不超过本集合计划份额总数的 16%。</p> <p>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限的，管理人应当在 10 个工作日内办理超出份额的退出手续。</p> <p>为解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与可不受上述限制，但管理人应通过管理人网站通告投资者和托管人，说明有关处理方法，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。</p>	<p>一、 自有资金的参与</p> <p>(三) 参与的金额和比例</p> <p>管理人以自有资金参与本集合计划，参与份额不超过本集合计划份额总数的 16%，未来监管机构对自有资金参与有新规定的，本计划将按照新规定执行。</p> <p>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限的，不视为管理人违反此项约定，但在客观条件允许的情况下，管理人应当在 10 个工作日内办理超出份额的退出手续，并在调整后 5 个工作日内通过管理人网站公告告知投资者和托管机构，确保符合前述约定。</p> <p>为解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与可不受上述限制，但管理人应通过管理人网站通告投资者</p>
--	--

和托管人，说明有关处理方法，并向相关派出机构报告。
全体投资者同意，尽管有其他约定，但集合计划在存续期内当法律法规或有关针对自有资金投资集合计划的政策发生变化时，管理人经与托管人协商一致，可以按照新的法律法规或有关政策，根据本合同约定对本集合计划合同及说明书的内容进行更新或修改。

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	上海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	华鑫思佰益融资租赁（上海）有限公司
15	上海鑫之众投资管理有限公司
16	上海全创信息科技有限公司
17	烟台山基金小镇（烟台）运营管理有限公司
18	天津东疆基金管理有限公司

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		
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）/注册号（境外机构）
1	上海金欣联合发展有限公司	91310101132352737T
2	上海金陵投资有限公司	91310115132310625R
3	上海择励实业有限公司	91310230057678883Q
4	上海普林电路板有限公司	310104000015714
5	上海普林电子有限公司	310000400435444
6	上海鑫敦实业有限公司	9131023008009785XR
7	上海力敦行房地产经纪有限公司	91310115787820407L
8	华鑫思佰益融资租赁（上海）有限公司	91310000MA1FL02T7J
9	上海鑫之众投资管理有限公司	91310000MA1FL3EG5U
10	上海全创信息科技有限公司	91310104MA1FRJB1XP
11	烟台山基金小镇（烟台）运营管理有限公司	91370602MA3QWYREXU
12	天津东疆基金管理有限公司	91120118MA06EA4NX9
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		
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）
1	华鑫期货有限公司	91310000132110746J

	2	华鑫证券投资有限公司	913100000841449245
	3	华鑫宽众投资有限公司	91310000351133569C
	4	摩根士丹利华鑫基金管理有 限公司	913100007178847982
	5	摩根士丹利华鑫基金管理有 限公司	91440300746637454W

附件四：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 HXZQXS-2020 第 4 号的《华鑫证券鑫盛 4 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。

管理人预留印鉴
(用章样本)

上述预留印鉴如需更换，应提供加盖管理人公章的新的预留印鉴样本。新的预留印鉴样本相应替代原有预留印鉴样本。未提供加盖公章的新预留印鉴样本的，预留印鉴不得更换。

管理人：华鑫证券有限责任公司（公章）
 法定代表人或其授权签字人（签字或盖章）：
 年 月 日

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 HXZQXS-2020 第 4 号-2021XD 的《华鑫证券鑫盛 4 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。

管理人预留印鉴
(用章样本)

上述预留印鉴如需更换，应提供加盖管理人公章的新的预留印鉴样本。新的预留印鉴样本相应替代原有预留印鉴样本。未提供加盖公章的新预留印鉴样本的，预留印鉴不得更换。

管理人：华鑫证券有限责任公司（公章）
 法定代表人或其授权签字人（签字或盖章）：
 年 月 日

附件五：投资监督事项表

序号	监督项目	监督内容	序号	监督项目	监督内容

	<p>(1) 固定收益类资产：国债、央行票据、地方政府债、金融债、大额存单、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、非公开定向债务融资工具（PPN）、在交易所和银行间挂牌交易的资产支持证券（ABS）（不含次级）、资产支持票据（ABN）（不含次级）、项目收益债券（NPB）、债券回购、私募债、可转换公司债券、可交换公司债券；</p> <p>(2) 沪深交易所上市交易的股票（含科创板）、创业板交易的股票、港股通、优先股、新股申购（含科创板）、股指期货、国债期货、商品期货、场内期权；</p> <p>(3) 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、结构性存款）、货币市场基金。</p> <p>(4) 证券投资基金（包括分级基金 A、分级基金 B、ETF 和 LOF）、仅投资于以上标的的券商资产管理计划和于中国基金业协会官方网站公示并已登记为私募证券投资基金管理人发行的契约式私募投资基金；</p> <p>本集合计划可以依法参与债券回购、融资融券业务。</p>		<p>(一) 投资范围</p> <p>(1) 固定收益类资产：国债、央行票据、地方政府债、金融债、大额存单、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、非公开定向债务融资工具（PPN）、在交易所和银行间挂牌交易的资产支持证券（ABS）（不含次级）、资产支持票据（ABN）（不含次级）、项目收益债券（NPB）、债券逆回购、私募债、可转换公司债券、可交换公司债券；</p> <p>(2) 权益类、商品及金融衍生品类资产：沪深交易所上市交易的股票（含科创板）、创业板交易的股票、港股通、优先股、新股申购（含科创板）、股指期货、国债期货、商品期货、场内期权；</p> <p>(3) 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、结构性存款）、货币市场基金；</p> <p>(4) 经中国证监会已发核准或注册的公开募集基金（包括封闭式基金、开放式基金、上市开放式基金（LOF）和交易型开放式指数基金（ETF）、基础设施证券投资基金（Reits））、仅投资于以上标的的券商资产管理计划和于中国基金业协会官方网站公示并已登记为私募证券投资基金管理人发行的契约式私募投资基金。</p> <p>本集合计划可以依法参与债券正回购、融资融券业务，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。</p>
二	<p>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：</p> <p>经过穿透合并计算后，投资于股票、股票型基金等权益类资产、固定收益类资产、商品及金融衍生品持仓合约价值占本集合计划总资产的比例分别低于 80%；</p>	二	<p>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：</p> <p>经过穿透合并计算后，投资于固定收益类及现金类资产、商品及金融衍生品持仓合约价值占本集合计划总资产的比例合计高于 80%。投资于权益类资产（包括股票、股票型基金）、商品及金融衍生品持仓合约价值占本集合计划总资产的比例合计低于 20%；</p>

附件七：华鑫证券直销渠道募集结算资金归集专用账户信息告知书

无	<p>新增条款</p> <p>尊敬的投资者：</p> <p>华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划投资者通过【管理人直销渠道】认购或申购本集合资产管理计划的，基金投资者应当将认购款或申购款以其境内开立的银行账户划款至【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户。本集合资产管理计划【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户由管理人委托运营服务机构开立，该账户仅用于华鑫证券鑫盛 4 号集合资产管理计划募集期间和存续期间【管理人直销渠道】认购、申购和赎回资金的统一归集与支付。</p> <p>【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户信息如下：</p> <p>账户名：华鑫证券有限责任公司</p>
---	--

	账号：9550880040729700803 开户行：广发银行上海徐汇支行 大额支付号：306290003526 自华鑫证券鑫盛4号集合资产管理计划推广募集之日起，本集合资产管理计划【管理人直销渠道】投资人认购、申购和赎回资金的归集与支付均通过上述募集结算资金归集专用账户进行。特此告知！ 华鑫证券有限责任公司（预留印鉴） 日期： 年 月 日
--	---

三、本计划托管人对本次合同变更的意见

托管人宁波银行股份有限公司同意本次合同变更事宜，请参见《关于华鑫证券鑫盛4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《华鑫证券鑫盛4号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXZQXS-2020第4号）第二十四节 资产管理合同的变更、终止与清算中第一条“（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）向投资者发送合同变更征询意见函（或通知）。投资者应在征询意见函（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。投资者不同意变更的，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；投资者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）指定的日期届满的下一工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。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：

在本集合计划份额可以转让前，若有任意一位投资者不同意合同变更，则管理人不得变更合同，并公告本次合同变更未成立。

在本集合计划份额可以转让后，投资者不同意合同变更的，按相关规定转让本集合计划份额。”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2021年6月11日，1个工作日。

委托人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：zcg1b@cfsc.com.cn

委托人不同意变更的，应在2021年6月11日内提出退出本集合计划的申请；投资者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）指定的日期届满的最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 6 月 15 日（含）正式生效。

如有疑问，请拨打客服热线：95323。

特此公告。

