

**东北证券6号核心优势
集合资产管理计划
风险揭示书
（第4次修订）**

尊敬的投资者：

投资有风险。当您/贵机构参与东北证券6号核心优势集合资产管理计划（以下简称“资产管理计划”或“本计划”）时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在做出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和《东北证券6号核心优势集合资产管理计划管理合同》（以下简称“资产管理合同”），充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎做出投资决策。本集合计划面临包括但不限于以下风险：

1、市场风险

市场风险是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。市场风险主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、衍生品风险、购买力风险和再投资风险。

2、管理风险

在集合计划资产管理业务运作过程中，管理人的知识、经验、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响集合计划资产管理业务的收益水平，从而产生风险。

3、流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本集合计划在开放期出现投资者大额或巨额赎回，致使本集合计划没有足够的现金应付集合计划退出支付的要求所导致的风险。

4、信用风险

集合计划在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人倒闭、信用评级被降低、违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致集合计划财产损失。

(1) 交易品种的信用风险：投资于公司债券等固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，集合计划资产管理业务所投资的债券可能面临价格下跌风险。

(2) 交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借

出证券产生的所有股息、利息和分红，将使集合计划资产管理业务面临交易对手的信用风险。

5、操作风险

(1) 技术或系统风险。在集合计划资产管理业务的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等等。

(2) 流程风险。管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或操作规程不完善而引起的风险。

(3) 外部事件风险。战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

(4) 法律风险：公司被提起诉讼或业务活动违反法律或行政法规，可能承担行政责任或者赔偿责任，有可能导致委托资产损失的风险。

6、合规性风险

指计划管理或运作过程中，可能出现违反国家法律、法规的规定，或者计划投资违反法规及合同有关规定的风险。

7、参与失败风险

(1) 投资者在认购、申购本集合计划时，由于重复开立基金开户等原因，使得中国证券登记结算有限责任公司无法进行确认，投资者参与被认定为无效认购或申购，导致参与失败的风险。

(2) 管理人在推广期内使用“末日渠道比例配售+先到先得”方法对集合计划认购或申购总规模实行限量控制。根据配售比例确定代销商的末日配售确认额度，管理人根据代销商提供的投资者申请单编号进行从小到大排序，根据先到先得原则进行逐笔金额确认，直到累计确认金额达到该代销商的末日配售确认额度。因此，投资者认购或申购的申请由于参与时间比较晚，排序在后面而可能导致其认购或申购失败的风险。

8、合同变更风险

本集合计划的合同变更条款有如下安排：

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、中国证券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，

自相关规定颁布或修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该颁布或修订的规定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五个工作日后生效。投资者可能面临由于上述原因发生合同变更的风险。

本集合计划成立后，相关材料需要报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人所在地中国证监会派出机构。管理人按照协会的要求补正备案材料涉及到本合同修改的，投资者特此授权管理人经与托管人协商一致后，由管理人公告补正后的合同，补正的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后两个工作日内以书面或者管理人网站公告方式（由管理人确定）向投资者发送合同变更征询意见。投资者不同意变更的，投资者应在征询意见函发出后管理人公告的临时开放期内提出退出申请，未提出退出申请的，视同投资者已经同意合同变更，合同变更于临时开放期结束后的下一个工作日生效，公告内容即成为本合同组成部分。部分投资者可能未及时了解管理人网站公告或因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果投资者因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

在此合同变更安排中，还可能存在但不限于以下潜在风险：

默认处理的风险。合同中约定“投资者不同意变更的，投资者应在征询意见函发出后管理人公告的临时开放期内提出退出申请，未提出退出申请的，视同投资者已经同意合同变更。在这种情况下，投资者对默认情况的忽略或误解，可能存在潜在风险。

9、大额资金退出预约风险

固定期限类份额投资者一次申请退出份额超过500万份（含本数），必须在申请日前3个工作日向管理人提出书面预约。如果投资者没有及时提出书面预约，使得投资者退出申请不能得以确认和实施，可能产生大额退出预约风险。

10、巨额退出风险

当集合计划单个开放日（T日），固定期限类份额集合计划净退出申请份额超过上一日集合计划总份额的10%时，即认为发生了巨额退出。当计划连续两个开放日以

上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。当出现巨额退出与连续巨额退出时，集合计划管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定部分顺延退出或暂停退出，使得投资者已经接受的退出申请延缓支付退出款项，而没有接受的退出申请不能实施，可能存在潜在的巨额退出风险。

11、强制退出风险

投资者部分退出集合计划份额时，由于某笔退出完成后在某一销售机构剩余的集合计划份额低于1,000份，管理人自动将该投资者在该销售机构的全部分额退出给投资者，可能产生强制退出风险。

12、电子合同风险

在签署电子合同时，投资者提供的基本资料（客户姓名、客户类型、证件类型、证件编号）和中登公司留存资料不一致，管理人和托管人在核对电子合同时，会将投资者的电子合同设置为核对需补正，并由代销机构通知投资者进行资料补正。如果投资者未进行资料补正，可能产生投资者的电子合同将不会被核对通过的风险。

13、其他风险

包括因业务竞争压力可能产生的风险；或者管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

14、本集合计划特有风险

（1）本集合计划投资于债权类资产的风险

本集合计划投资于银行存款、债券等债权类资产，如果债券市场出现下跌，债权类资产价格波动，本集合计划的净值表现将受到影响。

（2）本集合计划的业绩报酬计提基准（年化）仅作为业绩报酬计算的基准，供投资者参考，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。本集合计划份额可能出现净值损失，投资风险由投资者自行承担。

（3）资产管理计划委托募集所涉风险

管理人委托第三方代销机构代理销售本集合计划，因第三方代销机构不符合金融监管部门规定的资质要求、不具备提供相关服务的条件和技能、不尽职履行客户服务、信息披露、资金交收、投资者适当性管理、反洗钱等各项职责等，可能给投资者带来一定的风险。

（4）资产管理计划外包事项所涉风险

资产管理人将应属本机构负责的事项以服务外包等方式交由外包服务机构（如有）办理，因外包服务机构不符合金融监管部门规定的资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、操作失误等，可能给投资者带来一定的风险。

（5）提前终止的风险

本集合计划存续期间，当计划的投资者持续五个工作日少于2人或出现本合同约定的终止情形时，集合计划将终止。投资者可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险。本集合计划主要投资于固定收益品种，属于中低风险品种，适合于风险承受能力为谨慎型及以上的合格投资者。

由上可见，参与集合资产管理计划存在一定的风险，投资者存在盈利的可能，也存在亏损的风险；管理人不承诺确保投资者委托的资产本金不受损失或者取得最低收益。

本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与集合资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者财产损失的所有因素。

投资者在参与集合资产管理计划前，应认真阅读并理解相关业务规则、计划说明书、集合资产管理合同及本风险揭示书的全部内容，并确信自身已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与集合资产管理计划而遭受难以承受的损失。

集合资产管理计划的投资风险由投资者自行承担，证券公司、资产托管机构不以任何方式向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。

特别提示：投资者在本风险揭示书上签字，表明投资者已经理解并愿意自行承担参与集合资产管理计划的风险和损失。

（注：自然人客户，请签字；机构客户，请加盖机构公章并由法定代表人或其授权代理人签字）

管理人：东证融汇证券资产管理有限公司

客户：（签字及/或盖章）

签署日期：