

财通资管财臻 1 号集合资产管理计划

合同变更公告暨投资者告知函

尊敬的投资者：

根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于 2018 年 4 月 27 日联合印发的《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》”）、中国证券监督管理委员会于 2018 年 10 月 22 日发布并实施的《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“《管理规定》”）等法律、法规及规范性文件的相关规定，本集合计划管理人与托管人经协商一致，我公司拟对《财通资管财臻 1 号集合资产管理计划管理合同》的部分条款进行变更，变更内容如下：

合同变动位置	变更前	变更后
前言	为规范财通资管财臻 1 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”、“计划”、“集合资产管理计划”或“本集合计划”)运作,明确《财通资管财臻 1 号集合资产管理计划资产管理合同》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法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司监督管理条例》、《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“《管理规定》”)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理暂行规定》(以下简称《暂行规定》)等法律法规、中国证监会、中国证券业协会及中国证券投资基金业协会的有规	为规范财通资管财臻 1 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”、“计划”、“集合资产管理计划”或“本集合计划”)运作,明确《财通资管财臻 1 号集合资产管理计划资产管理合同》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法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司监督管理条例》、《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“《管理规定》”)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理暂行规定》(以下简称《暂行规定》)等法律法规、中国证监会、中国证券业协会及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



	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《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。	之间基本权利义务的法律文件, 当事人按照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。
二、释义	管理人指定网站、管理人网站: 指财通证券资产管理官方网站 (http://www.ctzg.com), 管理人指定网站变更时以管理人公告为准。	管理人指定网站、管理人网站: 指财通证券资产管理官方网站 (www.ctzg.com), 管理人指定网站变更时以管理人公告为准。
三、声明与承诺	<p>(三) 投资者声明</p> <p>1. 是符合《管理规定》要求的合格投资者, 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。</p> <p>2. 财产的来源及用途符合国家有关规定, 且投资本计划事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。</p> <p>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应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“买者自负”的原则, 投资于本计划将自行承担投资风险。</p>	<p>(三) 投资者声明</p> <p>1. 是符合《管理规定》要求的合格投资者, 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。</p> <p>2. 财产的来源及用途符合国家有关规定, 且投资本计划事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。</p> <p>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应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。</p>
四、合同当事人	<p>管理人</p> <p>机构名称: 财通证券资产管理有限公司</p> <p>法定代表人: 马晓立</p> <p>注册地址: 浙江省杭州市上城区白云路 26 号 143 室</p> <p>办公地址:</p>	<p>管理人</p> <p>机构名称: 财通证券资产管理有限公司</p> <p>法定代表人: 马晓立</p> <p>注册地址: 浙江省杭州市上城区白云路 26 号 143 室</p> <p>办公地址: 上海市浦东新区世纪大道栖霞路 26</p>

	<p>联系电话： 托管人 机构名称：中国工商银行股份有限公司浙江省分行 负责人或授权代理人： 通信地址： 电话：（0571）87803888 传真：（0571）87808186</p>	<p>号陆家嘴富汇大厦B座8-9层 联系电话：021-20561817 托管人 机构名称：中国工商银行股份有限公司浙江省分行 负责人或授权代理人：聂晶 通信地址：浙江省杭州市剧院路66号 电话：（0571）87336563 传真：（0571）87808186</p>
<p>五、集合资产管理计划的基本情况</p>	<p>（六）投资范围和投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划将主要投资于包括股票（含港股通标的股票、新三板股票、科创板股票）、现金、各种固定收益品种、国债期货、股指期货、个股期权、ETF期权、股指期权、货币市场基金、证券投资基金以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。</p> <p>其中，证券投资基金投资范围包括开放式基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和LOF、ETF、FOF等；固定收益品种包括新债申购、债券回购、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债、金融债、企业债（含可转债）、公司债、中小企业私募债、可分离交易债券、可交换债券、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金等。</p> <p>在法律法规和金融监管部门允许并且管理人与托管人系统支持的情况下，本集合计划后续可以参与个股期权、ETF期权、股指期权、新三板股票、科创板股票。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本集合计划投资组合在各类资产上的投资</p>	<p>（六）投资范围和投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划将主要投资于包括股票（含港股通标的股票、新三板股票、北京证券交易所上市的股票、科创板股票）、存托凭证、现金、各种固定收益品种、国债期货、股指期货、个股期权、ETF期权、股指期权、货币市场基金、证券投资基金以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。</p> <p>其中，证券投资基金投资范围包括开放式基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和LOF、ETF、FOF等；固定收益品种包括新债申购、债券回购、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债、金融债、企业债（含可转债）、公司债、中小企业私募债、可分离交易债券、可交换债券、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金等。</p> <p>在法律法规和金融监管部门允许并且管理人与托管人系统支持的情况下，本集合计划后续可以参与个股期权、ETF期权、股指期权、新三板股票、科创板股票。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定：</p>

<p>比例，将严格遵守相关法律法规的规定：</p> <p>(1) 权益类资产（包括股票、股票型基金等）投资占集合计划资产总值的0%-80%（不含）；其中，投资于ST个股的投资比例不高于集合计划资产总值的50%（不含退市整理期）；投资于在全国中小企业股份转让系统挂牌转让的证券的比例不高于集合计划资产总值的50%；参与港股通业务投资比例不高于集合计划资产总值的60%；</p> <p>(2) 固定收益类资产（包括债券回购、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债、金融债、企业债（含可转债）、公司债、中小企业私募债、可分离交易债券、可交换债券、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券型基金等）投资占集合计划资产总值的0%-80%（不含）；其中，投资于中小企业私募债的投资比例不高于集合计划资产总值的30%，投资于单支中小企业私募债的投资比例不高于集合计划资产总值的5%；</p> <p>(3) 金融衍生品类资产（包括国债期货、股指期货、个股期权、ETF期权、股指期权等）投资的持仓合约价值占集合计划资产总值的0-80%（不含），或衍生品账户权益占集合计划资产总值的0-20%（不含）。</p> <p>(4) 混合型基金投资占集合计划资产总值的0%-100%（不含）；</p> <p>(5) 债券回购：债券正回购融入资金余额不得超过上一日资产净值的40%，债券逆回购不得超过上一日计划资产净值的100%。中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(6) 本计划开放退出期，资产组合中7个</p>	<p>(1) 权益类资产（包括股票、股票型基金、混合型基金、存托凭证等）投资占集合计划资产总值的0%-80%（不含）；其中，投资于ST个股的投资比例不高于集合计划资产总值的50%（不含退市整理期）；投资于在全国中小企业股份转让系统挂牌转让的证券的比例不高于集合计划资产总值的50%；参与港股通业务投资比例不高于集合计划资产总值的60%；</p> <p>(2) 固定收益类资产（包括债券回购、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债、金融债、企业债（含可转债）、公司债、中小企业私募债、可分离交易债券、可交换债券、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券型基金等）投资占集合计划资产总值的0%-80%（不含）；其中，投资于中小企业私募债的投资比例不高于集合计划资产总值的30%，投资于单支中小企业私募债的投资比例不高于集合计划资产总值的5%；</p> <p>(3) 金融衍生品类资产（包括国债期货、股指期货、个股期权、ETF期权、股指期权等）投资的持仓合约价值占集合计划资产总值的0-80%（不含），或衍生品账户权益占集合计划资产总值的0-20%（不含）。</p> <p>(4) 债券回购：债券正回购融入资金余额不得超过上一日资产净值的40%，债券逆回购不得超过上一日计划资产净值的100%。中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(5) 本计划开放退出期，资产组合中7个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的10%。</p> <p>(6) 本集合计划的总资产不得超过计划净资产的200%。</p> <p>(7) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值</p>
---	---

	<p>工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的 10%。</p> <p>(7) 本集合计划的总资产不得超过计划净资产的 200%。</p> <p>(8) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过计划资产净值的 20%。流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。</p>	<p>在开放退出期内合计不得超过计划资产净值的 20%。流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。</p>
五、集合资产管理计划的基本情况	<p>(七) 管理期限</p> <p>自集合计划成立之日起算，存续期为 10 年。存续期满后管理人可以决定到期清算终止，或满足适当条件后展期。</p>	<p>(七) 管理期限</p> <p>自本合同生效之日起算，具体以管理人公告时间为准，存续期为 10 年。存续期满后管理人可以决定到期清算终止，或满足本合同约定的相关条件后展期。</p>
五、集合资产管理计划的基本情况	<p>(十三) 本集合计划的各项费用</p> <p>1、认购/申购费：0</p> <p>2、退出费：0</p> <p>3、管理费率：0.5%/年；</p> <p>4、托管费率：0.2%/年</p> <p>5、业绩报酬：本集合计划管理人不提取业绩报酬</p> <p>6、其他费用：其他费用详见本合同第十七部分。</p>	<p>(十三) 本集合计划的各项费用</p> <p>1、认购/申购费：0</p> <p>2、退出费：0</p> <p>3、管理费率：1.5%/年；</p> <p>4、托管费率：0.2%/年</p> <p>5、业绩报酬：</p> <p>本计划的业绩报酬计提日为计划分红日、投资者退出日和计划终止日。</p> <p>在业绩报酬计提日，若投资者在持有期内的实际年化收益率（S）小于或等于该期的业绩报酬计提基准（K=0%/年），则管理人不提取业绩报酬；若在持有期内的实际年化收益率（S）大于该期的业绩报酬计提基准（K=0%/年），则管理人对超出部分按一定比例（Y=10%）提取业绩报酬，剩余部分归投资者所有。特别的，对于本</p>

		<p>次合同变更生效前存续客户持有的本计划份额，首个持有期指该存续客户持有该份额自本次合同变更生效日起至业绩报酬计提日的持有期间。本计划业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的 60%。因投资者退出资产管理计划，管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。</p> <p>管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划资产本金不受损失，也不保证最低收益。本计划的业绩报酬计提基准不构成管理人、托管人和销售机构保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。</p> <p>6、其他费用：其他费用详见本合同第十七部分。</p>
<p>六、集合计划的参与和退出</p>	<p>(二) 集合计划的退出</p> <p>1、退出的办理时间</p> <p>投资者在本集合计划存续期内的开放期内可以办理退出业务，本集合计划的开放期为每周第 1 个交易日。此外，若本合同因第三十部分第（二）款原因发生变更，且在合同变更公告日起至合同变更生效日内无开放期的，则管理人将合同变更生效日前的 2 个工作日设置为临时开放期，接受投资者的赎回申请。</p> <p>业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，管理人有权视情况对前述退出办理的日期及时间进行相应的调整并公告。</p> <p>2、退出的原则</p> <p>(1) “未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出申请日当日（T 日）的集合计划份额净值为基准进行计算；</p>	<p>(二) 集合计划的退出</p> <p>1、退出的办理时间</p> <p>投资者在本集合计划存续期内的开放期内可以办理退出业务，本集合计划的开放期为每周第 1 个交易日。此外，若本合同因第三十部分第（二）款原因发生变更，且在合同变更公告日起至合同变更生效日内无开放期的，则管理人将合同变更生效日前的 2 个工作日设置为临时开放期，接受投资者的赎回申请。</p> <p>业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，管理人有权视情况对前述退出办理的日期及时间进行相应的调整并公告。</p> <p>2、退出的原则</p> <p>(1) “未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出申请日当日（T 日）的集合计划份额净值为基准进行计算；</p> <p>(2) “份额退出”原则，即退出以份额申请，</p>

<p>(2) “份额退出”原则，即退出以份额申请，单笔退出申请份额不低于1万份；</p> <p>(3) “先进先出”原则，即对委托人在该推广机构参与的集合计划份额进行退出处理时，参与确认日期在先的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出；</p> <p>(4) 当日的退出申请可以且只能在当日交易时间结束之前撤销；</p> <p>(5) 除非巨额退出，退出一般不受限制。若某笔退出导致该委托人在某推广机构持有的份额少于40万份，则余额部分必须一起退出。</p> <p>(6) 本集合计划在存续期内单个开放日，集合计划净退出申请份额超过上一日本集合计划总份额的10%时，即认为发生了巨额退出。</p> <p>3、退出的程序和确认</p> <p>(1) 退出申请的提出</p> <p>委托人必须根据本集合计划推广机构规定的手续，在开放日的业务办理时间内向推广机构提出退出申请。申请退出份额数量超过委托人持有份额数量时，申请无效。</p> <p>(2) 退出申请的确认</p> <p>委托人可在T+2日（包括该日）之后到推广机构取得T日退出申请成交确认单，若交易未成功或数据不符，委托人可与为其办理手续的人员联系并进行核实。</p> <p>(3) 退出款项划付</p> <p>委托人的退出申请确认后，退出款项将在T+5日内从托管账户划出。</p> <p>4、退出费及退出份额的计算</p> <p>(1) 退出费用</p> <p>本集合计划退出费率为0。</p>	<p>单笔退出申请份额不低于1万份；</p> <p>(3) “先进先出”原则，即对委托人在该推广机构参与的集合计划份额进行退出处理时，参与确认日期在先的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出；</p> <p>(4) 当日的退出申请可以且只能在当日交易时间结束之前撤销；</p> <p>(5) 除非巨额退出，退出一般不受限制。若某笔退出导致该委托人在某推广机构持有的金额少于40万元（不含），则余额部分必须一起退出。</p> <p>(6) 本集合计划在存续期内单个开放日，集合计划净退出申请份额超过上一日本集合计划总份额的10%时，即认为发生了巨额退出。</p> <p>3、退出的程序和确认</p> <p>(1) 退出申请的提出</p> <p>委托人必须根据本集合计划推广机构规定的手续；在开放日的业务办理时间内向推广机构提出退出申请。申请退出份额数量超过委托人持有份额数量时，申请无效。</p> <p>(2) 退出申请的确认</p> <p>委托人可在T+2日（包括该日）之后到推广机构取得T日退出申请成交确认单，若交易未成功或数据不符，委托人可与为其办理手续的人员联系并进行核实。</p> <p>(3) 退出款项划付</p> <p>委托人的退出申请确认后，退出款项将在T+5日内从托管账户划出。</p> <p>4、退出费及退出份额的计算</p> <p>(1) 退出费用</p> <p>本集合计划退出费率为0。</p> <p>(2) 退出金额的计算方法</p> <p>本集合计划退出时以申请日计划单位净值作为计价基准，按扣除退出费后的实际金额支付。退</p>
---	---

	<p>(2) 退出金额的计算方法</p> <p>本集合计划退出时以申请日计划单位净值作为计价基准，按扣除退出费后的实际金额支付。退出费和退出金额的计算公式如下：</p> <p>退出总额=T 日计划单位净值×退出份额</p> <p>退出费=退出总额×退出费率</p> <p>退出金额=退出总额-退出费</p> <p>上述计算结果均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>(3) 收取方式</p> <p>委托人退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出委托人的指定账户，退出款项将在 T+5 日内从托管账户划出。如集合计划出现暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。</p> <p>5、退出的限制与次数</p> <p>每次退出的最低份额为 1 万份，委托人可将其部分或全部集合计划单位退出。若某笔退出导致该委托人在某推广机构持有的份额少于 40 万份，则余额部分必须一起退出。</p> <p>本集合计划不设退出次数限制。</p>	<p>出费和退出金额的计算公式如下：</p> <p>退出总额=T 日计划单位净值×退出份额</p> <p>退出费=退出总额×退出费率</p> <p>退出金额=退出总额-退出费-应计提的业绩报酬（如有）</p> <p>上述计算结果均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>(3) 收取方式</p> <p>委托人退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出委托人的指定账户，退出款项将在 T+5 日内从托管账户划出。如集合计划出现暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。</p> <p>5、退出的限制与次数</p> <p>每次退出的最低份额为 1 万份，委托人可将其部分或全部集合计划份额退出。若某笔退出导致该委托人在某推广机构持有的金额少于 40 万元（不含），则余额部分必须一起退出。</p> <p>本集合计划不设退出次数限制。</p>
<p>十一、投资经理的指定与变更</p>	<p>本集合资产管理计划的投资经理由管理人负责指定。具体投资经理信息如下：</p> <p>马宏毅先生，本科就读于北京工商大学金融工程专业，西南财大 EMBA，长期从事投资研究工作，从业 7 年。曾担任申银万国证券研究所中小公司分析师，中信证券自营部高级经理，财通证券资产管理部投资经理，</p>	<p>本集合资产管理计划的投资经理由管理人负责指定。具体投资经理信息如下：</p> <p>陈李先生，同济大学工学硕士。曾就职于上汽集团市场部，3 年后从实业转为研究员，主攻汽车、电力设备、新能源、高端装置，2015 年 6 月起担任财通证券资管投资经理。</p> <p>管理人可以根据工作需要变更投资经理。投资经</p>

	<p>中山证券锦弘和富投资有限公司副总经理，2015年加入财通证券资产管理有限公司任投资经理。</p> <p>管理人可以根据工作需要变更投资经理。</p> <p>投资经理变更后，管理人应在三个工作日内在管理人网站以公告形式告知投资者。</p>	<p>理变更后，管理人应在三个工作日内在管理人网站以公告形式告知投资者。</p>
<p>十六、集合计划的估值</p>	<p>(七) 估值方法：</p> <p>估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据相关行业自律组织指导意见及指导价格估值。</p> <p>1、投资股票的估值方法</p> <p>(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。</p> <p>(2) 上市流通股票估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值。</p> <p>(3) 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。</p> <p>(4) 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种股票的收盘价进行估值。</p> <p>(5) 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种股票的收盘价进行估值。</p> <p>(6) 通过非公开发行等其他方式获取且有</p>	<p>(七) 估值方法：</p> <p>估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据相关行业自律组织指导意见及指导价格估值。</p> <p>1、投资股票的估值方法</p> <p>(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。</p> <p>(2) 上市流通股票估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值。</p> <p>(3) 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。</p> <p>(4) 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种股票的收盘价进行估值。</p> <p>(5) 流通受限股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时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），按下列公式进行估值：</p> $FV = S \times (1 - LoMD)$

<p>明确锁定期的股票，按以下方法估值：</p> <p>1) 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，可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；</p> <p>2) 估值日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，可按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：</p> $FV = C + (P - C) \times \frac{D_l - D_r}{D_l}$ <p>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；D_l 为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数；D_r 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）。</p> <p>3) 股票的锁定期起始日为上市公司公告的股份上市日所对应的日历日，估值起始日为上市公司发布公告日。</p> <p>2、投资固定收益品种的估值方法</p> <p>(1) 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>(2) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；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，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，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最</p>	<p>其中：</p> <p>FV：估值日该流通受限股票的价值</p> <p>S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值</p> <p>LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣；</p> <p>2、投资固定收益品种的估值方法</p> <p>(1) 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>(2) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固收品种（另有规定的除外）选取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；具体估值机构由管理人与托管人另行协商约定。</p> <p>(3) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，选取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，具体估值机构由管理人与托</p>
---	--

<p>近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。</p> <p>(3)在证券交易所市场挂牌交易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;估值日无交易的,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,可参考监管机构和行业协会估值意见,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>(4)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。</p> <p>(5)对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券,按照成本估值。</p> <p>(6)在对银行间市场的固定收益品种估值时,应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。</p> <p>(7)对在银行间市场上市交易的资产支持证券,按中债登公司提供的相应品种的当日估值净价估值。对在银行间市场上市交易且中债登公司未提供价格的,按成本估值。对在交易所上市的资产支持证券品种,鉴于其交易不活跃,各产品的未来现金流也较难确认的,按成本估值。</p> <p>(8)中小企业私募债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;</p> <p>3、投资证券投资基金的估值方法</p> <p>(1)持有的交易所上市基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)、创新型分</p>	<p>管人另行协商约定;交易所上市的资产支持证券,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>(4)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种,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>(5)对在交易所上市交易的可交换债券、可转换债券,按估值日收盘价减去债券收盘价中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债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考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>(6)在对银行间市场的固定收益品种估值时,应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。</p> <p>3、投资证券投资基金的估值方法</p> <p>(1)持有的交易所上市基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)、创新型分级基金等),</p>
---	--

	<p>级基金等),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)持有的货币市场基金及理财债券基金,按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利;</p> <p>(4)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>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)持有的货币市场基金,按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利;</p> <p>(4)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>十七、集合计划的费用、业绩报酬</p>	<p>(一)费用种类</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人的管理费 2、托管人的托管费 3、证券交易费用 4、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用 5、本集合计划成立后的会计师费和律师费 6、按照国家有关规定可以列入的其他费用 <p>(二)集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、托管费:</p> <p>本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的0.2%年费率计提,计算方法如下:</p> $H = E \times 0.2\% \div 365$	<p>(一)费用种类</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人的管理费 2、托管人的托管费 3、业绩报酬 4、证券交易费用 5、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用 6、本集合计划成立后的会计师费和律师费 7、按照国家有关规定可以列入的其他费用 <p>(二)集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、托管费:</p> <p>本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的0.2%年费率计提,计算方法如下:</p> $H = E \times 0.2\% \div 365$

	<p>H 为每日应支付的托管费； E 为前一日集合计划资产净值。 集合计划托管费每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人出具的划款指令于次季首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。</p> <p>2、管理费： 本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值的 0.5% 年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 0.5\% \div 365$ H 为每日应计提的集合计划管理费 E 为前一日集合计划资产净值 集合计划管理费每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人出具的划款指令于次季首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。</p>	<p>H 为每日应支付的托管费； E 为前一日集合计划资产净值。 集合计划托管费每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人出具的划款指令于次季首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给托管人。</p> <p>2、管理费： 本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值的 1.5% 年费率计提。计算方法如下： $H=E \times 1.5\% \div 365$ H 为每日应计提的集合计划管理费 E 为前一日集合计划资产净值 集合计划管理费每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人出具的划款指令于次季首日起 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。</p>
<p>十七、集合计划的费用、业绩报酬</p>	<p>(四) 管理人的业绩报酬 本集合计划管理人不提取业绩报酬。</p>	<p>(四) 管理人的业绩报酬</p> <p>1、管理人提取业绩报酬的原则</p> <p>(1) 本集合计划有权对投资者持有的计划份额实际年化收益率超过业绩报酬计提基准的部分按一定比例计提业绩报酬；</p> <p>(2) 同一投资者不同时间多次参与本计划的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；</p> <p>(3) 业绩报酬计提日为：本计划的业绩报酬计提日为计划分红日、投资者退出日和计划终止日。</p> <p>2、业绩报酬的计提方法</p> <p>在业绩报酬计提日，若投资者在持有期内的实际年化收益率 (S) 小于或等于该期的业绩报酬计提基准 (K=0%/年)，则管理人不提取业绩报</p>

酬；若在持有期内的实际年化收益率（S）大于该期的业绩报酬计提基准（K=0%/年），则管理人对超出部分按一定比例（Y=10%）提取业绩报酬，剩余部分归投资者所有。特别的，对于本次合同变更生效前存续客户持有的本计划份额，首个持有期指该存续客户持有该份额自本次合同变更生效日起至业绩报酬计提日的持有期间。本计划业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的60%。因投资者退出资产管理计划，管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。由于涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人根据管理人的划款指令进行划款。

业绩报酬计提办法：

$$S = \frac{(C'' - C')}{C} \times \frac{365}{D}$$

$$H = Q \times C \times (S - K) \times \frac{D}{365} \times Y$$

其中：

C'' ：在业绩报酬计提日的累计单位净值；

C' ：在上一业绩报酬计提日的累计单位净值；

C ：在上一业绩报酬计提日的单位净值；

D ：业绩报酬计提日（含）至上一业绩报酬计提日（不含）的间隔天数；

H ：业绩报酬计提日管理人应计提的业绩报酬；

Q ：业绩报酬计提日投资者退出份额数或计划分红、终止时持有份额总数。

K ：为业绩报酬计提基准，0%/年。

对于推广期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的，上一业绩报酬计提日的单位净值和累计净值均为1.00元， D 为业绩报酬计提日（含）至

		<p>计划成立日（含）的间隔天数；对于开放期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的，上一业绩报酬计提日指参与日。</p> <p>业绩报酬的支付，由托管人根据管理人发送的业绩报酬划付指令于 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。</p>
<p>十八、集合计划的收益分配</p>	<p>（三）收益分配原则</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、每一集合计划份额享有同等分配权； 2、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配； 3、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值； 4、红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日； 5、现金红利款自款项从集合计划托管账户划出之日起 7 个工作日内划转到委托人账户； 6、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担； 7、集合计划成立不满 3 个月可不进行收益分配； 8、在符合分红条件下，本集合计划可以每个会计年度至少分红一次； 9、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。 	<p>（三）收益分配原则</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、每一集合计划份额享有同等分配权； 2、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配； 3、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值； 4、红利发放日距离收益分配基准日的时间不得超过 15 个工作日； 5、现金红利款自款项从集合计划托管账户划出之日起 7 个工作日内划转到委托人账户； 6、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担； 7、集合计划成立不满 3 个月可不进行收益分配； 8、在符合分红条件下，本集合计划可以每个会计年度分红一次； 9、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。
<p>二十、越权交易的界定</p>		<p>（三）托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>托管人按照法律、行政法规、中国证监会的规定以及本合同的约定，对本集合计划的投资范围、投资比例、投资限制、关联方交易等投资运作事项进行监督，并按照前款内容履行相应的越权交易的处理程序。托管人对管理人的投</p>

		<p>资监督和检查自本集合资产管理计划成立之日起开始。</p>
<p>二十二、集合计划的信息披露</p>	<p>(一) 定期报告</p> <p>4、年度审计报告</p> <p>管理人进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本集合资产管理计划出具单项审计意见。管理人应当将审计结果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，并将本集合资产管理计划的单项审计意见提供给委托人和托管人。</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，管理人应当以管理人指定网站及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>(1) 集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或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；</p> <p>(2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>(3) 发生巨额退出并延期支付；</p> <p>(4) 集合计划终止和清算；</p> <p>(5) 管理人以自有资金参与和退出；</p> <p>(6) 合同的补充、修改与变更；</p> <p>(7) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>(8) 负责本集合计划的代理推广机构发生变更；</p> <p>(9) 集合计划投资于管理人及与管理人有</p>	<p>(二) 定期报告</p> <p>4、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计划的运营情况进行年度审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见，并在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给管理人、托管人，通过管理人网站向投资者提供。</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，管理人应当以管理人指定网站及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>1、集合计划运作过程中，投资经理发生变更；</p> <p>2、更换托管人；</p> <p>3、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项（即因集合计划投资的资产处理涉及诉讼、仲裁，而该项资产超过集合计划资产净值的0.5%）；</p> <p>4、集合计划从事重大关联交易；</p> <p>5、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>6、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>7、管理人认为的其他重大事项。</p>

	<p>关联方关系的公司发行的证券；</p> <p>(10) 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>(11) 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>(12) 集合计划分红；</p> <p>(13) 资产计价出现错误导致集合计划单位净值错误偏差达到或超过本集合计划份额净值的 0.25%；</p> <p>(14) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；</p> <p>(15) 其他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。</p>	
<p>二十五、集合计划终止和清算</p>	<p>(二) 集合计划的清算</p> <p>1、自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算。集合计划清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动；</p> <p>2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</p> <p>3、管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定或其他合理方式，以货币资金的形式全部分派给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户；</p> <p>4、管理人在本集合计划清算结束后五个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案，并抄报管理人住所地中国证监会派出机构；</p>	<p>(二) 集合计划的清算</p> <p>1、自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算。集合计划清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动；</p> <p>2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</p> <p>3、管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定或其他合理方式，以货币资金的形式全部分派给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户；</p> <p>4、管理人在本集合计划清算结束后五个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案，并抄报管理人住所地中国证监会派出机构；</p> <p>5、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定延期清算方案，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据延期清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通</p>

	<p>5、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定延期清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据延期清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行延期清算，并将变现后的资产按照投资者拥有份额的比例或本合同的约定或其他合理方式，以货币形式全部分配给投资者。发生延期清算的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和证券投资基金业协会报告。</p> <p>6、管理人将及时向投资者与托管人告知集合计划财产清算报告。</p> <p>7、资产管理计划财产清算完毕后，当事人在资产管理计划财产相关账户注销中的职责及相应的办理程序。管理人和托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户、证券账户等投资所需账户；</p> <p>8、资产管理计划财产清算账册及文件的保存，说明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>变现后进行延期清算，并将变现后的资产按照投资者拥有份额的比例或本合同的约定或其他合理方式，以货币形式全部分配给投资者。发生延期清算的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和证券投资基金业协会报告。</p> <p>6、管理人将及时向投资者与托管人告知集合计划财产清算报告。</p> <p>7、资产管理计划财产清算完毕后，当事人在资产管理计划财产相关账户注销中的职责及相应的办理程序。管理人和托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户、证券账户等投资所需账户；</p> <p>8、资产管理计划财产清算账册及文件的保存，说明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>二十六、 当事人的 权利 和义务</p>	<p>(三) 托管人的权利与义务</p> <p>2、托管人的义务</p> <p>(1) 依法为集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户等相关账户；</p> <p>(2) 非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或本合同、说明书及托管协议约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；</p> <p>(3) 在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管集合计划的资产，依法确保集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；</p> <p>(4) 安全保管集合计划资产，执行管理人的投资或者清算指令，负责办理集合计划</p>	<p>(三) 托管人的权利与义务</p> <p>2、托管人的义务</p> <p>(1) 依法为集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户等相关账户；</p> <p>(2) 非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或本合同、说明书及托管协议约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；</p> <p>(3) 在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管集合计划的资产，依法确保集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；</p> <p>(4) 安全保管集合计划资产，执行管理人的投资或者清算指令，负责办理集合计划名下的资金</p>

	<p>名下的资金往来；</p> <p>(5) 定期核对资产管理业务资产情况；</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、说明书以及托管协议约定的，应当要求其改正；未能改正的，有权拒绝执行；</p> <p>(7) 复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值；</p> <p>(8) 保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前予以保密，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的除外）；</p> <p>(9) 按规定出具集合计划托管情况的报告；</p> <p>(10) 妥善保管与集合计划托管业务有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、资料和数据，保存期不少于二十年；</p> <p>(11) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算事宜；</p> <p>(12) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人；</p> <p>(13) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；</p> <p>(14) 法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同、说明书及《托管协议》约定的其他义务。</p>	<p>往来；</p> <p>(5) 定期核对资产管理业务资产情况；</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、说明书以及托管协议约定的，应当要求其改正；未能改正的，有权拒绝执行；</p> <p>(7) 复核管理人计算的集合计划的资产净值；</p> <p>(8) 保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前予以保密，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的除外）；</p> <p>(9) 按规定出具集合计划托管情况的报告；</p> <p>(10) 妥善保管与集合计划托管业务有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、资料和数据，保存期不少于二十年；</p> <p>(11) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算事宜；</p> <p>(12) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人；</p> <p>(13) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；</p> <p>(14) 法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同、说明书及《托管协议》约定的其他义务。</p>
<p>二十八、 风险揭示</p>	<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>6、强制退出风险</p> <p>投资者提出退出申请，可能因某笔退出导致该投资者在某一推广机构持有的份额少于 40 万份（不含），投资者需面临将该余</p>	<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>6、强制退出风险</p> <p>投资者提出退出申请，可能因某笔退出导致该投资者在某一推广机构持有的金额少于 40 万元（不含），投资者需面临将该余额部分一起退出，</p>

	<p>额部分一起退出，或者被管理人作强制退出处理的风险。</p>	<p>或者被管理人作强制退出处理的风险。</p> <p>17、存托凭证投资风险</p> <p>1) 发行相关的风险</p> <p>可能存在公司公开发行并上市时尚未盈利，上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配、退市的情形；可能存在发行价格高于每股净资产账面值或者境外市场价格；可能存在境内外规定或者上市公司未实行完毕激励措施，导致给投资者带来风险。</p> <p>2) 业务相关的风险</p> <p>企业可能因重大技术、产品、经营模式、相关政策变化而出现经营风险；企业可能处于初步发展阶段，企业持续创新能力、主营业务发展可持续性、公司收入及盈利水平等具有较大不确定性；企业在项目研发结果、研发成果商业化前景、核心研发人员稳定性、所处市场竞争环境、客户群体变化等方面，均可能面临重大不确定性，并对公司盈利能力产生重大影响。</p> <p>3) 境外发行人相关的风险</p> <p>企业受注册地法律法规、境内外上市公司治理结构不同的影响，在境内存托凭证持有人享有的权益、权利的行使、保护性、维护权利成本等均可能受境外法律变化影响；针对语言、工作时间等不同，存在具体披露时间、投资者对披露事项的理解存在一定差异。</p> <p>4) 存托凭证相关的风险</p> <p>存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但不能等同于直接持有境外基础证券，所代表的权利在范围和行使方式等方面的存在差异，交易和持有存托凭证过程中需要承担的义务可能受到限制。</p> <p>存托凭证存续期间，存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化，包括但不限于存托凭证与</p>
--	----------------------------------	---

基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改，更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式，即对投资者生效。投资者可能无法对此行使表决权。

存托凭证退市的，投资者可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券。

5) 交易机制相关的风险

由于时差和交易制度、停复牌制度、境内外证券价格的差异，导致给投资者带来风险；因不可抗力、交易或登记结算系统技术故障、人为差错等原因，导致存托凭证交易或登记结算不能正常进行、交易或登记结算数据发生错误等情形的，交易所和登记结算机构可以根据规则采取相关处置措施。交易所和登记结算机构对于因上述异常情况及其处置措施造成的损失不承担责任，导致给投资者带来风险。

18、北京证券交易所上市股票投资风险

(1) 北交所主要服务创新型中小企业，企业多处于成长期，规模可能偏小，往往具有依赖核心技术人员和供应商、客户集中度高、应对外部冲击能力较弱等特点，企业上市后的持续创新能力、收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。

(2) 北交所设置四套上市标准，其中允许未盈利企业上市。因此可能存在企业向不特定合格投资者公开发行股票并在北交所上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，以及在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情况。

(3) 因北交所上市企业多聚焦行业细分领域，业绩受外部环境影响大，可比公司较少，传统估值方法可能不适用，上市后可能存在股价波动的风险。

	<p>(4) 发行人发行承销过程中，出现预计发行后总市值无法满足招股文件所选上市标准的，将按规定中止发行。</p> <p>(5) 公开发行股票并上市时，发行人和主承销商可以采用超额配售选择权，即存在超额配售选择权实施结束后，发行人增发股票的可能性。</p> <p>(6) 北交所股票可能因触及退市情形被终止上市。因触及交易类情形被终止上市的北交所股票，不进入退市整理期；因触及财务类、规范类及重大违法类情形被终止上市的，进入退市整理期交易 15 个交易日，且首个交易日不设价格涨跌幅限制。</p> <p>(7) 北交所允许上市公司存在表决权差异安排。根据此项安排，上市公司可能存在控制权相对集中，以及因每一特别表决权股份拥有的表决权数量大于每一普通股份拥有的表决权数量等情形，而使普通投资者的表决权利及对公司日常经营等事务的影响力受到限制。出现北交所上市规则及上市公司章程规定的情形时，特别表决权股份将按 1:1 的比例转换为普通股份，股份转换自相关情形发生时生效，并可能与相关股份转换登记时点存在差异。</p> <p>(8) 北交所股票上市首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%，可能产生股价波动的风险。</p> <p>(9) 北交所股票交易具有盘中临时停牌情形，设有异常波动股票核查制度。</p> <p>(10) 北交所证券相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件（以下简称法律法规）和交易所业务规则，可能根据公开征求意见结果和市场情况进行修改，或者由相关部门制定新的法律法规和业务规则。</p> <p>投资北交所上市股票可能存在上述风险，从而对本计划资产净值带来影响，请投资者关注。</p>
--	---

	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>1、本金损失风险</p> <p>资产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。</p> <p>本计划属于 R5（高风险）风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C5（激进型）的合格投资者。</p>	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>1、本金损失风险</p> <p>资产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。</p> <p>本计划属于 R5（高风险）风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C5（激进型）的合格投资者。本计划存在本金和收益可能全部损失的风险。</p>
二十九、合同的成立与生效	<p>(一) 合同的成立与生效</p> <p>本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。</p> <p>本合同成立后，同时满足以下条件时生效：</p> <p>1、委托人参与资金实际交付并确认；</p> <p>2、本集合计划成立。</p> <p>但是根据本合同约定各方当事人应当在本合同生效前履行的权利义务，亦应按本合同约定执行。</p> <p>本集合计划终止，本合同终止。但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。至本合同终止日，任何一方在本合同项下的义务尚未履行完毕的，则本合同有效期自动延期至各方义务完全履行完毕之日止。</p>	<p>(一) 合同的成立与生效</p> <p>本合同将于 2022 年 1 月生效，具体以管理人公告为准。本协议与原协议不一致的，以本协议为准。</p>

同时修改《财通资管财臻 1 号集合资产管理计划说明书》对应条款。

管理人特别提示，本次合同变更提高了本计划的管理费率；同时增加了管理人提取业绩报酬的条款。本次合同变更生效后，在业绩报酬计提日，对于符合本计划业绩报酬提取条件的投资者（特别提示：本次合同变更生效前存续客户持有的份额首次业绩报酬计算区间为自本次合同变更生效日起至业绩报酬计提日），管理人将按生效后的合同约定收取业绩报酬。根据合同约定，如果投资者未在管理人网站公告发出后的 3 个工作日内提出异议的，应视为其同意管理人

对本合同做出变更。投资者不同意管理人对合同进行变更的，可在管理人设置的临时开放期（2022年1月26日、27日）提出退出申请，逾期未退出且未有意见答复的以及答复不同意合同变更但逾期未退出的投资者，均视为同意本合同变更。

管理人在此特别提示：管理人于2022年1月21日发布了《财通资管财臻1号集合资产管理计划合同变更公告暨投资者告知函》，自本次合同变更生效之日起，变更公告内容即成为合同组成部分。自本次合同变更公告日至本次合同变更生效日之间参与本集合计划的委托人，请仔细阅读财通资管财臻1号集合资产管理计划原合同以及变更公告，知晓相关变更内容。

咨询电话：95336。



财通证券股份有限公司
2022年1月21日