

# 首创证券创赢 9 号集合资产管理计划

## 变更合同条款说明四

我司拟对《首创证券创赢 9 号集合资产管理计划资产管理合同》中的部分条款进行更改，产品条款更改涉及如下：

一、原合同中全部的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》的简称“《管理规定》”全部变更为“《运作规定》”。

二、原合同“一、前言”章节，原：

“为规范首创证券创赢 9 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作，明确《首创证券创赢 9 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国民法典》、《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》)、《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》等法律法规、中国证监会和中国证券业协会的有关规定，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《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《首创证券创赢 9 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。

委托人承诺以真实身份参与集合计划，保证委托资产的来源及用途合法，所披露或提供的信息和资料真实，并已阅知本合同和集合计划说明书全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，安全保管客户集合计划资产、办理资金收付事项、监督管理人投资行为，但不保证本集合计划资产投资不受损失，不保证最低收益。”

**变更为：**

“订立本合同的依据、目的和原则：

1. 订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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《运作规定》）、《集合资产管理计划管理合同内容与格式指引（试行）》、《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定。

2. 订立本合同的目的是规范首创证券创赢 9 号集合资产管理计划（以下简称“集合计划”或“计划”）运作，明确《首创证券创赢 9 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”）当事人的权利与义务，保护集合计划委托人的合法权益。

3. 订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护集合计划委托人的合法权益。

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》、《基金法》《管理办法》、《运作规定》、《首创证券创赢 9 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。

管理人应当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（如需）。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。”

### 三、原合同“二、释义”中

原：

“巨额退出：指本集合计划单个开放日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与总份额后的余额）超过上一日计划总份额 10%的情形；”

变更为：

“巨额退出：指本集合计划单个开放日累计净退出申请份额（退出申请总份

额扣除参与总份额后的余额)超过上一日计划总份额 20%的情形;”

**原:**

“推广期:指自本集合计划启动推广之日起不超过 60 个工作日的期间,具体推广时间以本集合计划推广公告为准(如无特别说明,公告一般以管理人网站公告。下同。);

封闭期:特指成立日后的一个期间,在此期间委托人不得参与、退出本集合计划;

存续期、管理期限:指计划成立并存续的期间。本集合计划存续期为 5 年;”

**变更为:**

“初始募集期/推广期:指自本集合计划启动份额发售推广之日起不超过 60 日的期间,管理人有权根据募集情况调整提前终止初始募集期/推广期,具体以管理人公告为准;

封闭期:指本集合计划存续期间除开放期和临时开放期以外的其他日期,在此期间委托人不得参与、退出本集合计划;”

存续期、管理期限:指计划成立并存续的期间。本集合计划存续期为 10 年;

**并新增:**

“《基金法》:指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,2012 年 12 月 28 日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自 2013 年 6 月 1 日起实施,并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订;

信义义务:信义义务是指依照《基金法》及本合同之约定,托管人在履行托管职责时,应当恪尽职守,履行诚实信用、谨慎勤勉的义务。”

**四、新增章节“三、承诺与声明”:**

“三、承诺与声明

### （一）管理人承诺

1. 在签订本合同前充分向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险。

2. 已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估。

3. 按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。

### （二）托管人承诺

1. 按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。

2. 根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

3. 在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定召集份额持有人大会（如有），维护投资者权益。

### （三）投资者声明

1. 符合《管理规定》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. 投资者承诺以真实身份参与集合计划，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。投资者承诺，如委托资金为资产管理产品募集的资金时，将确保资产管理产品的投资者中不包含其他资产管理产品。如委托资金为除公募资产管理产品外的合伙企业、契约等非法人形式，最终投资者满足法律法规、监管规则规定的合格投资者要求，并向管理人提供合法募集资金的证明文件、充分披露实际投资者和最终资金来源，保证所提供证明文件真实、准确、完整、合法。

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。”

**五、原合同“三、合同当事人”章节，原：**

“委托人

个人填写：

姓名：证件类型：证件号码：

通信地址：邮政编码：

联系电话：移动电话：电子信箱：

其他：

委托人的详细情况在电子签名合同数据电文中列示。

机构填写：

机构名称：法定代表人：

通信地址：邮政编码：

代理人姓名：身份证号码：

联系电话：其他：

管理人

机构名称：首创证券股份有限公司

法定代表人：毕劲松

通信地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

邮政编码：100088

联系电话：(010) 59366000

托管人

机构名称：平安银行股份有限公司北京分行

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号远洋大厦 5F

负责人：鞠维萍

电话：（010）66292298”

**变更为：**

**“四、当事人及权利义务”章节如下：**

“本资产管理计划设定为均等份额。除资产管理合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益。

委托人

1、委托人简况

个人填写：

姓名：

证件类型：

证件号码：

住所：

通信地址：

邮政编码：

联系电话：

移动电话：

电子信箱：

其他：

委托人的详细情况在电子签名合同数据电文中列示。

机构填写：

机构名称：

法定代表人：

住所：

通信地址：

邮政编码：

代理人姓名：

身份证号码：

联系电话：

其他：

## 2、委托人的权利

根据《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，委托人的权利包括但不限于：

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；
- (3) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (4) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- (5) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- (6) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- (7) 因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
- (8) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

## 3、委托人的义务

根据《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，委托人的义务包括但不限于：

- (1) 委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺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；委托人应当以真实身份参与集合计划；自然人不得用筹集的他人资金参与集合计划，法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或其他销售机构提供合法筹集资金的证明文件；
- (2) 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；
- (3) 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；
- (4) 认真阅读并签署风险揭示书；
- (5) 按照资产管理合同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（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；

（6）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；

（7）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；

（8）不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

（9）不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、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；

（10）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；

（11）不得违规或违反本合同约定转让其所拥有的计划份额；

（12）本集合计划如采用电子签名合同，委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料。委托人应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

（13）除非在本合同规定的退出开放期或终止日，不得要求提前终止委托资产管理关系；

（14）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

管理人

1、管理人简况

机构名称：首创证券股份有限公司

法定代表人：毕劲松

住所及通信地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

邮政编码：100088

联系电话：（010）59366000

2、管理人权利



根据《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

- (1) 按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；
- (2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；
- (3) 按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；
- (4) 根据资产管理合同及其他有关规定，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；
- (5) 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；
- (6) 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；
- (7) 按照本合同及《说明书》的约定，停止办理集合计划份额的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；
- (8) 根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；
- (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) 法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及资产管理合同约定的其他权利。

### 3、管理人义务

根据《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；
- (2) 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；
- (3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；

(4) 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；

(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

(6) 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财产；

(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；

(8) 除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，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) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；

(13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(14) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；

(15) 确定资产管理计划份额参与、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；

(16) 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；

(17) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

(18) 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；

(19) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(20) 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，报送中国证监会相关派出机构，并向中国证券投资基金业协会备案（如需）；

(21) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(22) 建立并保存投资者名单；

(23) 组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(24) 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、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；

(25) 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通知托管人和投资者；

(26) 进行资产估值等会计核算并编制资产管理计划财务会计报告；

(27) 依法计算并披露资产管理计划净值，确定参与、退出价格；

(28) 按照有关合同和规定行使资产管理计划财产投资权利而应承担的义务，包括但不限于选择经纪商及投资标的等；

(29) 依法对托管人、销售机构的行为进行监督，如发现托管人、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；

(30) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《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；

(31) 在集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；

(32) 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；

(33) 确保本合同、说明书、托管协议及本集合计划相关文本相关约定保持一致。

(34) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。

## 托管人

### 1、托管人简况

机构名称：平安银行股份有限公司北京分行

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号远洋大厦 5F

负责人：鞠维萍

电话：(010) 66292298

### 2、托管人权利

根据《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

(1) 按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；

(3) 按照托管协议的约定监督管理人集合计划的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反托管协议之附件《交易监控合规表》对投资范围及投资比例约定的，如指令未生效，有权予以制止。如指令已生效，则按指令划款后，有权要求管理人纠正；

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 托管协议与本合同、说明书约定不一致的，托管人的托管职责以托管协议的约定为准。

(6) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

### 3、托管人的义务

根据《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 安全保管资产管理计划财产；

(2) 除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；

(4) 公平对待所托管的不同财产，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；

(5) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；

(6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；

(7) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；

(8) 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；

(9) 编制托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构，并向中国证券投资基金业协会备案（如需）；

(10) 按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(11) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；

(12) 根据法律、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、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(13) 根据法律法规规定和合同约定的监督内容和监督方式，监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会；

(14) 依照法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自自动用或处分集合计划资产；

(15) 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，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；

(16) 定期核对资产管理业务资产情况；

(17) 建立与管理人的对账机制，复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值和资产管理计划参与、退出价格；

(18) 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）；

（19）在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

（20）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；

（21）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；

（22）因管理人过错造成集合计划资产损失的，代委托人向管理人追偿；

（23）管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的，由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；

（24）投资于《管理办法》第三十七条第（5）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；

（25）国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。”

## 六、原合同“四、集合资产管理计划的基本情况”章节中原：

### “（三）投资范围和投资比例

#### 1、投资范围

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

#### 2、资产配置比例

（1）固定收益类资产包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、同业存单、企业债、项目收益债（NPB）、公司债（含非公开发行的公司债及中证机构间报价与服务系统发行的非公开公司债券，下同）、资产支持证券（含证监会和银监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券）、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、超过7天的债券逆回购、债券型基金。投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在AA及以上级别，短期融资券债项评级不低於A-1。

现金类资产包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在 1 年内（含 1 年）的国债、到期日在 1 年内（含 1 年）的央行票据、到期日在 1 年内（含 1 年）的政府债券、不超过 7 天（含 7 天）的债券逆回购；

（2）固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的 80%-100%。

全体委托人一致同意，在本资产管理计划存续期间，为规避特定风险保护投资者合法权益的，本产品投资于固定收益资产的比例可以低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。

（3）债券回购：债券正回购或逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的 100%；

（4）计划总资产不得超过计划净资产的 200%。

（5）以成本价计算，本集合计划投资于单一标的债券金额不得超过该债券发行规模的 25%，且不得超过本计划资产净值的 25%（国债、中央银行票据、政策性金融债、债券逆回购、银行存款等中国证监会认可的投资品种除外）”

### **变更为：**

#### **“（三）投资目标、投资范围和投资比例**

##### **1、投资目标**

本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资，在有效控制投资风险的基础上，力争获取稳健的投资回报。

##### **2、投资范围**

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

##### **3、资产配置比例**

（1）固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、同业存单、企业债、项目收益债（NPB）、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、资产支持证券（含证监会和银保监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券，限优先级，且底层不为产品）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等银行间市场交易的投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型基金等。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别,短期融资券债项评级不低于 A-1。

(2) 现金类资产包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在 1 年内(含 1 年)的国债、到期日在 1 年内(含 1 年)的央行票据、到期日在 1 年内(含 1 年)的政府债券、不超过 7 天(含 7 天)的债券逆回购;

(3) 固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的 80%-100%。

全体委托人一致同意,在本资产管理计划存续期间,为规避特定风险保护投资者合法权益的,本产品投资于固定收益资产的比例可以低于计划总资产的 80%,但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。

(4) 债券回购: 债券正回购或逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的 100%;

(5) 计划总资产不得超过计划净资产的 200%。

(6) 以成本价计算,本集合计划投资于单一标的债券金额不得超过该债券存续规模的 25%,且不得超过本计划资产净值的 25%。本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产,不得超过该计划资产净值的 25%,也不得超过该资产的 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。

(7) 本集合资产管理计划不得直接投资商业银行信贷资产;也不得违规为地方政府及其部门提供融资,不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保。

(8) 本集合资产管理计划不得投资于将资管/信托产品或其收/受益权作为底层资产的资产支持证券或资产支持票据。

(9) 管理人管理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。

本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。”

原:

“(四) 管理期限

本集合计划存续期为 5 年,具体以管理人公告为准。”



**变更为：**

“（四）管理期限

本集合计划存续期为 10 年，可展期。”

**原：**

“（七）参与本集合计划的最低金额

首次参与的最低金额为人民币 30 万元，具体以管理人公告为准，追加参与的最低金额为人民币 10000 元的整数倍。”

**变更为：**

“（七）参与本集合计划的最低金额

首次参与的最低金额为人民币 30 万元，具体以管理人公告为准，追加参与的金额为人民币 10000 元的整数倍。”

**原：**

“5、业绩报酬：参见合同集合计划的费用、业绩报酬部分

6、其他费用：参见合同集合计划的费用、业绩报酬部分”

**变更为：**

“5、业绩报酬：对年化收益率超过业绩报酬计提基准以上的部分提取 60% 作为管理人的业绩报酬，剩余 40% 作为超额收益分配给委托人。

6、其他费用：包括证券交易费用、证券账户开户费、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、会计师费、律师费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用。”

**七、原合同新增“六、集合资产管理计划的募集”章节，后续章节编号依次顺延：**

“（一）资产管理计划的募集对象、募集方式和募集期限

1、募集对象

本集合计划应当面向合格投资者，合格投资者累计不得超过 200 人。委托人

应确保自身符合合格投资者条件。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。

(1) 具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元。

(2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。

(3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

(5) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。依法设立并受监管的各类投资产品视为单一合格投资者。

## 2、募集方式

本计划通过管理人及管理人委托的代销机构进行募集。本计划募集机构及其从业人员以非公开方式向投资者募集资金。

## 3、募集期限

本计划的募集期限由管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 天。管理人有权根据本计划销售的实际情况按照相关程序延长或缩短初始销售期，此类变更适用于所有募集机构。延长或缩短募集期的相关信息将及时发布通知，即视为履行完毕延长或缩短募集期的程序。

### (二) 募集账户信息

本计划销售募集账户由计划管理人和管理人委托的销售机构自行开立并自

行聘请监督机构对其进行监督，销售募集账户的开户行、账户名称、账户号码及监督机构等信息以计划管理人或销售机构届时公告为准。

### （三）资产管理计划的认购事项

投资者认购本计划，以人民币货币资金形式交付。本计划不接受现金方式认购，在直销机构认购的投资者须将认购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集账户，在代销机构认购的投资者按代销机构的规定缴付资金。

#### 1、份额持有人的人数上限

本计划向合格投资者募集，合格投资者人数累计不得超过二百人。

#### 2、份额的认购费用

本计划认购费用为 0。

#### 3、认购申请的确认

认购申请受理完成后，不得撤销。募集机构受理认购申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表募集机构确实收到了认购申请。认购的确认以管理人的确认结果为准。若认购不成功，投资者已交付的款项将于计划成立后五个工作日内，无利息地退还至投资者银行账户。

本计划的人数规模上限为 200 人。管理人在募集期间每个工作日可接受的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效认购申请。超出计划人数规模上限的认购申请为无效申请。

通过代销机构进行认购的，人数规模控制以管理人和代销机构约定的方式为准。

#### 4、认购份额的计算方式

认购份额=（认购金额+认购资金利息）/认购份额初始面值。

其中，上述公式认购金额不包括额外缴纳的认购费。

认购份额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

#### 5、初始销售期间投资者资金的管理及利息处理方式

募集机构应当将计划初始销售期间投资者的资金存入募集结算资金专用账户，在计划初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。计划成立前，认购款在募集结算资金专用账户产生的利息将折算为计划份额归委托人所有，利息金

额以实际账户结息利率计息。利息金额在募集结算资金专用账户实际结息后折算为计划份额归委托人所有。

#### （四）计划份额认购金额

投资者在募集期间的认购金额应不低于 30 万元人民币（不含认购费），追加参与的金额为人民币 10000 元的整数倍。”

**八、原合同新增“七、资产管理计划的成立与备案”章节，后续章节编号依次顺延：**

#### “（一）集合计划成立的条件和日期

集合计划的募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定，初始募集资金总额（不含参与费）达到中国证监会规定的集合资产管理计划最低募集规模（即人民币 1000 万元）且其委托人的人数为 2 人（含）以上，并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，管理人宣布本集合计划成立，并将成立公告提供给托管人。集合计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告资产管理计划成立。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金，自募集资金账户向托管户划款的除外。

#### （二）集合计划设立失败

集合计划初始募集期结束，在集合计划初始募集资金总额（不含参与费）低于中国证监会规定的集合资产管理计划最低募集规模（即人民币 1000 万元）或委托人的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败。管理人需以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并将已认购资金及银行同期活期存款利息在初始募集期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人。

#### （三）集合计划开始运作的条件和日期

- 1、条件：本集合计划公告成立。
- 2、日期：本集合计划自成立之日起开始运作。

#### （四）集合计划的备案

管理人应当在集合资产管理计划成立之日起 5 个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告等材料报中国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（如需）。本集合计划完成备案前不得开展投资活动，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。”

**九、原合同“六、集合计划的参与和退出”章节变更为“八、资产管理计划的参与、退出与转让”，**

**原：**

“（2）存续期参与

本集合计划投资者可在本合同约定的开放期（包括临时开放期）内办理参与本集合计划的业务。具体开放参与安排以管理人公告为准。”

**变更为：**

“（2）存续期参与

本集合计划投资者可在本合同约定的开放期（临时开放期除外）内办理参与本集合计划的业务。具体开放参与安排以管理人公告为准。”

**原：**

“②存续期参与

参与份额=参与金额÷参与日计划单位净值

集合计划份额面值为 1.00 元。委托人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。”

**变更为：**

“②存续期参与

参与份额=参与金额÷参与日计划单位净值

委托人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。”

**原：**

“（2）退出金额的计算方法

委托人在开放日退出本计划，管理人根据计划单位份额净值计算其退出金额。

退出金额=退出份额×T日该类集合计划单位份额净值

退出金额采用四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的误差计入集合计划资产。”

**变更为：**

“（2）退出金额的计算方法

委托人在开放日退出本计划，管理人根据计划单位份额净值计算其退出金额。

退出金额=退出份额×T日该类集合计划单位份额净值（扣除业绩报酬及分红后）

退出金额采用四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的误差计入集合计划资产。”

**原：**

“5、退出的限制与次数

本集合计划委托人单笔退出份额最低为 1000 份，退出后单个委托人持有的份额最低为 30 万份。若某笔退出导致该委托人在某一推广机构处持有的份额低于 30 万份，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

本集合计划不设大额退出限制条款，但因单个委托人大额退出导致出现巨额退出，则根据巨额退出的认定和处理方式办理。

7、巨额退出的认定和处理方式

（1）巨额退出的认定

单个开放日，委托人当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的 10%时，即为巨额退出。”

**变更为：**

“5、退出的限制与次数

集合计划份额持有人持有的集合计划资产净值高于 30 万元时，可以选择部分退出集合计划份额，集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30 万元。集合计划份额持有人申请退出集合计划份额时，其持有的集合

计划资产净值低于 30 万元的，必须选择一次性退出全部集合计划份额，集合计划份额持有人没有一次性全部退出持有份额的，管理人将该集合计划份额持有人所持份额做全部退出处理。

#### 6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

##### (1) 单个委托人大额退出的认定

对单个委托人单日退出份额超过上一工作日计划总份额数的 15%时，即视为单个委托人大额退出。如果大额退出情况触发巨额退出条件，按照巨额退出进行认定和处理。

##### (2) 单个委托人大额退出的申请和处理方式

委托人必须提前 5 个工作日直接或通过销售机构向管理人预约申请；大额退出未预约申请，管理人有权拒绝接受其退出申请。

#### 7、巨额退出的认定和处理方式

##### (1) 巨额退出的认定

单个开放日，委托人当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的 20%时，即为巨额退出。”

#### **并新增：**

##### “（三）集合计划份额的转让

集合计划存续期间，本资产管理计划份额方可转让。集合计划份额转让业务的开通和处理方式、份额转让的实际收费标准以管理人公告为准。在符合管理人公告的条件下，并经管理人同意后，客户可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。

转让后，持有资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。受让方首次参与集合计划，应满足合格投资者的条件。转让完成之日，受让人即自动成为本合同当事人，享有合同项下相关权利义务。

##### （四）集合计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的

行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定及费用标准办理。

#### （五）集合计划份额的冻结

资产管理计划份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

资产管理计划注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的资产管理计划份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的资产管理计划份额的冻结与解冻。

当资产管理计划份额处于冻结状态时，资产管理计划注册登记机构或其他相关机构有权拒绝资产管理计划份额的退出、非交易过户等业务的申请。

#### （六）管理人自有资金参与集合计划

管理人可选择以自有资金参与本集合计划份额。

（1）自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

（2）自有资金参与的金额和比例：自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 50%。

（3）自有资金退出的条件：管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于 6 个月。

（4）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时的处理原则及处理措施：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，管理人在满足持有期限要求且约定责任解除后，管理人将在 5 个工作日内公告退出安排。

（5）信息披露：管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前 5 个工作日通过管理人网站公告。

（6）自有资金责任承担方式和金额：管理人自有资金参与的享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。

（7）收益分配以管理人的公告为准。”

### 十、原合同新增章节“九、份额持有人大会及日常机构”：



“九、份额持有人大会及日常机构

本计划不设置份额持有人大会及日常机构。”

**十一、原合同新增章节“十、资产管理计划份额的登记”：**

“十、资产管理计划份额的登记

本集合资产管理计划的份额登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

全体资产管理计划份额持有人同意管理人将集合资产管理计划投资者名称、身份信息以及本集合资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。”

**十二、删除原合同“六、管理人自有资金参与集合计划”章节，后续章节编号依次顺延。**

**十三、删除原合同“七、集合计划的分类、分级”章节，后续章节编号依次顺延。**

**十四、删除原合同“八、集合计划客户资产的管理方式和管理权限”章节，后续章节编号依次顺延。**

**十五、删除原合同“九、集合计划的成立”章节，后续章节编号依次顺延。**

**十六、原合同新增“十一、资产管理计划的投资”章节，后续章节编号依次顺延：**

“（一）投资目标

本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资，在有效控制投资风险的基础上，力争获取稳健的投资回报。

（二）投资范围及比例

**1、投资范围**

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

**2、资产配置比例**

（1）固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、同业存单、企业债、项目收益债（NPB）、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、资产支持证券（含证监会和银保监会主管及在交易商协会注

册的资产支持证券，限优先级，且底层不为产品）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等银行间市场交易的投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型基金等。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别，短期融资券债项评级不低于 A-1。

(2) 现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在 1 年内（含 1 年）的国债、到期日在 1 年内（含 1 年）的央行票据、到期日在 1 年内（含 1 年）的政府债券、不超过 7 天（含 7 天）的债券逆回购等；

(3) 固定收益类和现金类资产占本计划总资产的 80%-100%；

全体委托人一致同意，在本资产管理计划存续期间，为规避特定风险保护投资者合法权益的，本产品投资于固定收益资产的比例可以低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。

(4) 债券回购：债券正回购或逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的 100%；

(5) 本资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%；

(6) 以成本价计算，本集合计划投资于单一标的债券金额不得超过该债券存续规模的 25%，且不得超过本计划资产净值的 25%。本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的 25%，也不得超过该资产的 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。

(7) 本集合资产管理计划不得直接投资商业银行信贷资产；也不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保。

(8) 本集合资产管理计划不得投资于将资管/信托产品或其收/受益权作为底层资产的资产支持证券或资产支持票据。

(9) 管理人管理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。

本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。

委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人

及与管理人、托管人有关关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券, 交易完成 10 个工作日内, 管理人应书面通知委托人和托管人, 并采取有效措施防范利益冲突保护投资者合法权益。

### （三）投资比例超限的处理方式及流程

本集合计划的建仓期为自产品成立之日起 6 个月的期限。本计划自投资运作期开始之日起 6 个月内使集合资产管理计划的投资组合比例符合上述资产组合比例的要求。建仓期的投资活动, 应当符合资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。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。建仓期结束后, 资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素, 造成集合计划投资比例超标, 管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。计划持有债券资产期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 管理人应在评级报告发布之日起且具备交易条件的 10 个工作日内予以全部卖出。

委托人在此同意, 本计划存续期间, 为规避特定风险, 本计划投资于固定收益类资产的比例可以低于计划总资产的 80%, 但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。

### （四）风险收益特征

本计划属于中低风险 R2 的证券投资产品。

### （五）业绩比较基准

本计划不设业绩比较基准。

### （六）投资策略

#### 1、决策依据

集合计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据, 并以维护集合计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括:

（1）《管理办法》、《运作规定》、《指导意见》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关规范性文件;

(2) 根据宏观、微观经济环境和有关经济政策以及证券市场趋势制定投资策略；

(3) 在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是本集合计划维护投资者利益的重要保障。在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，力争保护投资者的本金安全，在控制风险的前提下追求收益的最大化。

## 2、投资程序

(1) 投资经理根据研究报告，结合对投资品种的分析判断，形成本集合计划的投资预案。

(2) 交易人员依据投资经理指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易；投资经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

(3) 管理人风控岗对投资计划的过程进行日常监督和风险控制，投资经理根据本集合资产管理计划退出的情况控制投资组合的流动性；

(4) 管理人在确保本集合资产管理计划委托人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

## 3、具体的投资策略

### (1) 资产配置策略

本集合计划主要资产投资于固定收益类金融工具，并在严格控制风险的基础上，通过对全球经济形势、中国经济发展（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况）、证券市场估值水平等的研判，动态调整计划各类资产的投资比例，力争为计划资产获取稳健回报。

### (2) 债券投资策略

#### 1) 利率预期策略

管理人通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平。

#### 2) 收益率曲线策略

管理人通过对债券市场微观因素的分析判断，形成对未来收益率曲线形状变化的预期，获取收益率曲线形变带来的投资收益。

### 3) 信用策略

信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响，因此，一方面，本集合计划将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势；另一方面，采用内外结合的信用研究和评级制度，研究债券发行主体企业的基本面，以确定企业主体债的实际信用状况。

### 4) 个券优选策略

管理人根据债券市场收益率数据，对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

#### (3) 新券申购策略

对于新发行的证券品种，管理人将凭借丰富的资产管理经验以及新券定价能力，可在询价与配售过程中把握主动、发挥优势，追求可控风险之下的收益最大化。

#### (4) 基金投资策略

本集合计划坚持从研究基金价值入手，采用定性分析与定量分析相结合的方法，选择管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金构建备选基金池，对基金的投资理念和投资价值进行判断。

### (七) 投资限制

为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：

- 1、参见集合计划合同对投资范围、投资比例的约定；
- 2、证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资，如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

### (八) 禁止行为

本集合计划的禁止行为包括：

- 1、违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；
- 2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；

- 3、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；
- 4、挪用集合计划资产；
- 5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；
- 6、募集资金超过计划说明书约定的规模；
- 7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；
- 8、使用集合计划资产进行不必要的交易；
- 9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；
- 10、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

**（九）集合计划的预警和止损机制**

本计划无预警、止损机制。

**（十）资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配**

开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%，7 个工作日可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具以及同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。”

**十七、原合同新增章节“十二、投资顾问”：**

“本计划未聘请投资顾问。”

**十八、原合同新增“十三、分级安排”章节，后续章节编号依次顺延：**

“本计划未进行分级安排。”

**十九、原合同新增“十四、利益冲突及关联交易”章节：**

“1、存在或可能存在利益冲突的情形

（1）集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划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者承销期内承销的证券。

（2）集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。

(3) 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本集合资产管理计划的，管理人应当向投资者进行披露，对该资产管理计划账户进行监控，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。

## 2、存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率

### (1) 存在利益冲突的处理方式

集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划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者承销期内承销的证券，但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

集合计划投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意本集合计划将进行上述关联交易。

集合计划份额持有人不得因本集合计划投资收益劣于集合计划管理人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向集合计划管理人或集合计划托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

### (2) 发生利益冲突情形信息披露的方式

本集合计划发生利益冲突情形的信息披露将严格按照《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他规定进行。

本集合计划包含利益冲突情形的定期报告和临时报告等有关集合计划的信息将在管理人网站上披露，委托人可随时查阅。

管理人网站：[www.sczq.com.cn](http://www.sczq.com.cn)

### (3) 发生利益冲突情形信息披露的内容和时间

#### 1、定期报告

定期报告包括集合计划份额净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、年度审计报告。

发生利益冲突情形需在集合计划的资产管理季度（年度）报告进行信息披露。

## 2、临时报告

本集合计划运用受托管理资产从事关联交易的，应当于签订交易协议后 10 个工作日内（无交易协议的，自事项发生之日起 10 个工作日内），按照规定在管理人网站发布信息披露公告。

本集合计划未聘请投资顾问，不存在与投资顾问之间存在利益冲突情形。”

## 二十、原合同新增“十五、投资经理的指定与变更”章节：

### “十五、投资经理的指定与变更

#### 1、投资经理的指定：

资产管理计划投资经理由管理人负责指定。

邹怡菲，首创证券资产管理事业部固定收益投资部总经理，对外经贸大学经济学学士；美国东北大学金融学硕士。偏向于通过数据分析调整投资组合来寻找固定收益投资机会。历任首创证券资产管理事业部固定收益交易员、投资经理助理、总经理助理、副总经理，负责资管产品的资产配置、流动性管理，现任资产管理事业部固定收益投资部总经理、投资经理。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

#### 2、投资经理的变更

委托人同意，管理人有权根据本资产管理计划投资运作需求及内部审批流程变更投资经理。投资经理发生以下情形时，管理人应及时变更：

- （1）投资经理离职的；
- （2）投资经理被取消投资经理资格的；
- （3）投资经理因违反法律法规及其他监管规定无法履职的；
- （4）其他可能导致投资经理无法正常行使投资经理职责的。

管理人应在上述情形发生之日起 5 个工作日内按照内部管理程序完成投资经理变更并及时公告。”

## 二十一、原合同新增“十八、越权交易的界定”章节，后续章节编号依次顺延：

### “（一）越权交易的界定

本合同约定的越权交易是指集合计划管理人违反本合同的约定而进行的投资交易行为，包括：（1）违反本合同约定的投资范围和投资比例限制等进行的投



资交易行为；(2)法律法规禁止的超买、超卖行为。

集合计划管理人应在本合同规定的投资范围和投资限制权限内运用集合计划财产进行投资管理，不得违反本合同关于投资范围和投资限制的约定，超越权限从事投资。

## (二) 对越权交易的处理程序

### 1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为

集合计划托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反托管协议附件《交易监控合规表》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证券投资基金业协会。

集合计划托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反托管协议附件《交易监控合规表》约定的，应立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证券投资基金业协会。

集合计划管理人应向托管人主动报告越权交易。托管人有权督促管理人在限期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。集合计划管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证券投资基金业协会。

### 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

集合计划托管人在行使监督职能时，如果发现集合计划资产投资过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人。如果因管理人原因发生交易所场内超买行为，必须于发生超买行为日的下一个工作日上午 10:00 点之前完成融资，保证完成清算交收。

3、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资产所有。

## (三) 集合计划托管人对管理人越权交易的监督

1、集合计划托管人对管理人的越权交易行使监督权，具体投资监督事项见托管协议附件《交易监控合规表》。

集合计划托管人对集合计划管理人进行本集合计划越权交易的监督和检查自本计划建账估值之日起开始。

2、投资范围或投资限制变更，集合计划管理人应以书面形式通知集合计划

托管人，并应与集合计划托管人重新协商调整投资监督事项。

#### （四）越权交易的例外

以下不属于越权交易情形：

- 1、非因管理人主观原因导致本集合计划投资比例不符合本合同约定；
- 2、本集合计划终止前 10 个交易日内，管理人对所投资的资产进行变现造成投资比例不符合本合同约定。”

二十二、原合同“十五、集合计划的估值”章节变更为“十九、资产管理计划的估值和会计核算”，原：

#### “（七）估值方法

##### 1、证券投资基金估值方法

持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的每万份收益计算。

持有的债券型基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的单位净值计算。

在任何情况下，资产管理人如采用本项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

2、银行存款以成本列示，每日按照约定利率预提收益。

3、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的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

4、在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

5、回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计算利息；

6、在机构间私募产品报价与服务系统发行的债券以成本估值。在持有期按票面利率每日计提应收利息。

7、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。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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。本计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布，托管人对由此造成的损失不承担责任。

#### （八）估值程序：

管理人应每个工作日对集合计划资产估值，但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。用于披露的资产净值等数据由管理人完成估值后，将估值结果以书面或邮件形式报送托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核，复核无误后以书面或邮件形式返回给管理人，如有出入，原则上以管理人提供的数值为准。

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造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

#### （九）估值错误与遗漏的处理方式：

因发生估值差错导致本计划资产或本计划持有人损失的，由本计划管理人负责赔偿，本计划管理人在赔偿本计划资产或本计划持有人后，对不应由其承担的责任，有权根据过错责任原则，向存在过错的一方追偿。

（十）暂停估值的情形：当出现下列情形致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按

规定完成估值工作。”

**变更为：**

“（七）估值方法

1、证券投资基金估值方法

持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的每万份收益计算。

持有的债券型基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的单位净值计算。

在任何情况下，资产管理人如采用本项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

2、银行存款以成本列示，每日按照约定利率预提收益。

3、回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计算利息；

4、债券估值方法

①在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的相应品种对应的估值净价估值；

②在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；

③首次发行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，采用估值技术确定公允价值。

④交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用第三方估值机构（中证指数有限公司）确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债，采用第三方估值机构（中证指数有限公司）确定公允价值。

⑤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（中债金融估值中心有限公司）公布的收益率曲线及估值价格。

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。

5、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。

6、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

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。本计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布，托管人对由此造成的损失不承担责任。

#### （八）估值程序：

管理人应每个工作日对集合计划资产估值，但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。用于披露的资产净值等数据由管理人完成估值后，将估值结果以书面或邮件形式报送托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核，复核无误后以书面或邮件形式返回给管理人，如有出入，原则上以管理人提供的数值为准。

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造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

#### （九）估值错误与遗漏的处理方式：

因发生估值差错导致本计划资产或本计划持有人损失的，由本计划管理人负责赔偿，本计划管理人在赔偿本计划资产或本计划持有人后，对不应由其承担的责任，有权根据过错责任原则，向存在过错的一方追偿。

#### （十）估值调整的情形与处理

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

（十一）暂停估值的情形：当出现下列情形致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。”

**新增：**

“(十二) 资产管理计划份额净值的确认；

用于集合计划信息披露的集合计划资产净值和集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。

(十三) 特殊情况的处理

(1) 管理人或托管人按估值方法的第 1-6 项进行估值时，所造成的误差不得作为集合计划资产估值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所、证券经纪机构、期货公司及登记结算公司发送的数据错误等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

(十四) 集合计划的会计政策

1、集合计划管理人为本计划的会计责任方；

2、集合计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；集合计划首次募集的会计年度按如下原则：如果《资管合同》生效少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；

3、集合计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计核算制度执行国家有关会计制度；

5、本集合计划独立建账、独立核算；

6、集合计划管理人或其委托的服务机构保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表；集合计划托管人定期与集合计划管理人就集合计划的会计核算、报表编制等进行核对。”

**二十三、原合同“十三、集合计划的费用、业绩报酬”章节中，**

**原：**

“(1) 管理人核算业绩报酬的原则：

在本集合计划存续过程中，业绩报酬计提日为本集合计划收益分配日（以管理人的分红公告为准）、计划开放日或本集合计划终止日。以上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日）至本次业绩报酬计提日的年化收益率  $R$ ，作为计提业绩报酬的基准，按照业绩报酬计提基准以上部分的 60% 提取业绩报酬，具体提取方式如下：”

**变更为：**

“（1）管理人核算业绩报酬的原则：

在本集合计划存续过程中，业绩报酬计提日可以为本集合计划收益分配日（以管理人的分红公告为准）、投资者退出时、计划开放日、临时开放日或本集合计划终止日。以上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日）至本次业绩报酬计提日的年化收益率  $R$ ，作为计提业绩报酬的基准，按照业绩报酬计提基准以上部分的 60% 提取业绩报酬，具体提取方式如下：”

**原：**

“（2）业绩报酬的支付

由于涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人进行计算，托管人不对其进行复核。业绩报酬支付时间分别是收益分配、份额退出和本集合计划终止时，由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时，支付日期顺延。”

**变更为：**

“（2）业绩报酬的支付

每个自然季度起 10 个工作日内或产品终止时，管理人有权全额提取当期计提的业绩报酬，具体以管理人安排和计算为准。支付时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时，支付日期顺延。

业绩报酬的计算和复核由管理人完成。托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。”

**原：**

“5、审计费用：

本集合计划的年度审计费用，按管理人与会计师事务所确定的金额，审计费用支付时一笔计提并支付。”

**变更为：**

“5、审计费用：

本集合计划的年度审计费用，按管理人与会计师事务所确定的金额，审计费用按年度一次性计提。”

**二十四、删除原合同“十五、投资理念与投资策略”章节，后续章节编号依次调整。**

**二十五、删除原合同“十六、投资决策与风险控制”章节，后续章节编号依次调整。**

**二十六、删除原合同“十七、投资限制及禁止行为”章节，后续章节编号依次调整。**

**二十七、原合同“十八、集合计划的信息披露”章节变更为“二十二、信息披露与报告”章节，后续章节编号依次调整：**

**原：**

“（一）定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告和托管季度（年度）报告、年度审计报告和对账单。

1、集合计划单位净值披露

披露时间：至少每周披露一次集合计划的单位净值，并于推广期或开放期前公告下一个封闭期的业绩报酬计提基准。

披露方式：披露文件等信息将在管理人指定网站上披露，委托人可随时查阅。

2、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向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告和托管季度报告，对报告期内集合计划资产的投资表现、投资组合、收益分配情



况、投资经理变更、重大关联交易做出说明。资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，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。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的季度报告。

### 3、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向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告和托管年度报告，对报告期内集合计划资产的投资表现、投资组合、收益分配情况、投资经理变更、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。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的年度报告。

### 4、年度审计报告

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提供。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人可不提供审计报告。

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。

### 5、对账单

管理人应当每个季度以电子方式（包括但不限于电子邮件、管理人网站、柜台交易系统、网上交易等自助终端等）向委托人提供对账单。对账单内容应包括委托人持有集合计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。如本集合资产管理计划由银行等第三方代销机构代销，管理人将不再单独向委托人提供对账单，委托人持有集合计划份额的数量、净值及参与、退出明细由代销机构向委托人提供。

### 6、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指定网站、推广机构网站、或其他途径和方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

（1）集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的投资经理人员发生变更，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；

（2）暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

（3）发生巨额退出并延期支付；

（4）集合计划终止和清算；

（5）集合计划存续期满并展期；

（6）管理人以自有资金参与和退出；

（7）合同的补充、修改与变更；

（8）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

（9）负责本集合计划的代理推广机构发生变更；

（10）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；

（11）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；

（12）管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

（13）集合计划分红；

（14）资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误。）；

（15）管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；

（16）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。”

#### **变更为：**

“本集合计划的信息披露应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》及相关自律规则的规定。如中国证监会、中国基金业协会更新了相关信息披露规则或制定了其他相关规则，则从其规则执行。

#### **（一）定期报告**

定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告和年度审计报告。

#### **1、集合计划单位净值披露**

披露时间：至少每周披露一次经托管人复核的集合计划的单位净值，并于初始募集期或开放期前公告下一个封闭期的业绩报酬计提基准。

披露方式：披露文件等信息将在管理人指定网站上披露，委托人可随时查阅。

## 2、集合计划的资产管理季度报告

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的季度报告，报告包括但不限于以下内容：

（一）管理人履职报告；

（二）托管人履职报告；

（三）资产管理计划投资表现；

（四）资产管理计划投资组合报告；

（五）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；

（六）资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；

（七）资产管理计划投资收益分配情况；

（八）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；

（九）若本计划投资国债期货的，季度报告还应披露集合计划参与国债期货交易的有关情况，包括投资目的，持仓情况，损益情况，投资国债期对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的等。

（十）中国证监会及自律组织规定的其他事项。

资产管理季度报告由管理人、托管人编制，由管理人公告，每季度结束之日起一个月内通过管理人网站披露季度报告，并报送管理人住所地中国证监会派出机构，并向中国证券投资基金业协会备案（如需）。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，可以不编制当期的季度报告。

## 3、集合计划的资产管理年度报告

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，年度报告包括但不限于以下内容：

（一）管理人履职报告；

（二）托管人履职报告（如适用）；

（三）资产管理计划投资表现；

- (四) 资产管理计划投资组合报告；
- (五) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (六) 资产管理计划财务会计报告；
- (七) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (八) 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；
- (九) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理年度报告由管理人、托管人编制，报送管理人住所地中国证监会派出机构，并向中国证券投资基金业协会备案（如需）。托管人在每年度向委托人提供一次托管报告。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的年度报告。

#### 4、年度审计报告

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提供。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人可不提供审计报告。

管理人应当将审计结果按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。

#### 5、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指定网站、销售机构网站、或其他途径和方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

- (1) 集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的投资经理发生变更，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；
- (2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；
- (3) 发生巨额退出并延期支付；
- (4) 集合计划终止和清算；
- (5) 集合计划存续期满并展期；
- (6) 管理人以自有资金参与和退出；

- (7) 合同的补充、修改与变更；
- (8) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- (9) 负责本集合计划的销售机构发生变更；
- (10) 集合计划资产投资于管理人、托管人及前述机构控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (11) 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；
- (12) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- (13) 集合计划分红；
- (14) 资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误。）；
- (15) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；
- (16) 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。

## （二）其他事项

如发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向投资者披露。

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。”

**二十八、删除原合同“十九、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结”章节，后续章节编号依次调整。**

**二十九、原合同“二十六、集合计划的展期”章节变更为“二十三、集合计划的展期”章节，原：**

“本集合计划不设置展期条款。”

**变更为：**

“1、展期的条件

(1) 在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反《集合资产管理合同》、《说明书》的约定；

(2) 展期没有损害委托人利益的情形；

(3) 托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；

- (4) 展期后符合本集合计划的成立条件；
- (5) 中国证监会规定的其他条件。

## 2、展期的安排

### (1) 通知展期的时间

在集合计划到期前 3 个月且不超过 1 个月期间内。

### (2) 通知展期的方式

管理人拟定展期方案，经托管人确定后，管理人将通过管理人网站、邮件或者短信等方式通知委托人。

### (3) 委托人回复的方式

委托人应当在 5 个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确意见。

## 3、委托人不同意展期的处理办法

若委托人明确表示不同意展期，委托人有权在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续。若不同意展期的委托人未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续，管理人将对此类委托人进行强制退出。委托人回复意见不明确或不回复意见的，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。

## 4、展期的实现

如果同意集合计划展期的委托人户数不少于 2 户，则集合计划存续期将依法展期；如果同意本集合计划展期的各委托人户数低于 2 户则集合计划到期终止，将按照《集合资产管理计划管理合同》等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。”

**三十、删除原合同“二十二、当事人的权利和义务”章节，后续章节编号依次调整。**

**三十一、原合同“二十四、风险揭示”章节调整为“二十六、风险揭示”章节，其中原：**

### **“2、强制退出条款**

本集合计划委托人单笔退出份额最低为 1000 份，单个委托人持有的份额最低为 30 万份。若某笔退出导致该委托人在某一推广机构处持有的份额低于 30 万份，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。”

**变更为：**

**“2、强制退出条款**

集合计划份额持有人持有的集合计划资产净值高于 30 万元时，可以选择部分退出集合计划份额，集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30 万元。集合计划份额持有人申请退出集合计划份额时，其持有的集合计划资产净值低于 30 万元的，必须选择一次性退出全部集合计划份额，集合计划份额持有人没有一次性全部退出持有份额的，管理人将该集合计划份额持有人所持份额做全部退出处理。”

**三十二、原合同“二十六、合同的补充、修改与变更”章节调整为“二十八、合同的补充、修改与变更”，原：**

“1、本合同签署后，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、基金业协会、证券业协会等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理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人网站公告满 10 个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。

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 5 个工作日内以通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的 10 个工作日内的开放日或 10 个工作日内期限届满后的合同变更临时开放期内提出退出本集合计划的申请；委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：委托人不同意变更的，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委托人，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。合同变更生效日以管理人公告为准。

委托人同意，无论其是否同意合同变更或提出退出申请，管理人变更本合同

的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。”

**变更为：**

“1、本合同签署后，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、基金业协会、证券业协会等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理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人网站公告之日起生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照管理人开放公告中约定的开放日申请退出本集合计划。

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。管理人须通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的 10 个工作日内的开放日或 10 个工作日内期限届满后的合同变更临时开放期内提出退出本集合计划的申请；委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：委托人不同意变更的，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委托人，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。合同变更生效日以管理人公告为准。

委托人同意，无论其是否同意合同变更或提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

其中，由于其他原因需要变更合同的情形，包括但不限于以下情形：

（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；

（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。”

**三十三、原合同新增章节“二十九、其他事项”：**

“本合同所称的其他事项是指，根据相关法律法规的规定，在满足本合同约



定的情况下，本集合计划管理人与托管人可能发生变更。

(一) 资产管理计划管理人和托管人的更换的情形

1、资产管理计划管理人的更换

(1) 资产管理计划管理人的更换条件

有下列情形之一的，管理人职责终止：

- ①管理人被依法取消资产管理业务资格；
- ②管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；
- ③法律法规和基金合同规定的其他情形。

2、资产管理计划托管人的更换

(1) 托管人的更换条件

有下列情形之一的，托管人职责终止：

- ①托管人被依法取消基金托管资格；
- ②托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产；
- ③法律法规和基金合同规定的其他情形。

(二) 管理人的变更程序

1、经本集合计划全体委托人、托管人同意，本集合计划可变更管理人；

2、管理人应按照监管机构的要求办理转让手续；

3、管理人职责终止的，管理人应妥善保管资产管理业务资料，及时向新任管理人办理资产管理业务的移交手续，新任管理人应及时接收。新任管理人应与托管人核对本计划资产总值和净值；

4、管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报法律法规规定的监管机构、自律组织备案，审计费用从计划财产中列支；

5、管理人更换后，如果原任或新任管理人要求，应按其要求替换或删除计划名称中与原管理人有关的名称字样；

6、管理人变更程序的例外：管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的子公司。委托人在此同意，如果本事件发生，在管理人与托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务由从事资产管理业务的子公司承继，并无须就此项变更和

委托人另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告委托人。管理人保障委托人退出本专项计划的权利，并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

### （三）托管人的更换程序

1、经本集合计划全体委托人、管理人同意，本集合计划可变更托管人；

2、托管人应按照监管机构的要求办理转让手续；

3、托管人职责终止的，托管人应妥善保管资产管理业务资料，及时向新任托管人办理资产管理业务的移交手续，新任托管人应及时接收。新任托管人应与管理人核对本计划资产总值和净值；

4、托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报法律法规规定的监管机构、自律组织备案，审计费用从计划财产中列支。

（四）新任管理人接受资产管理或新任托管人接受计划财产和托管业务前，原管理人或托管人应依据法律法规和本合同的规定继续履行相关职责，并保证不对委托人的利益造成损害。原管理人或托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本合同的规定收取管理费或托管费。

（五）本部分关于管理人、托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需经委托人同意。”

### 三十四、删除原合同“二十七、特别约定”章节。

若产品合同变更条款涉及到托管协议、风险揭示书和计划说明书，对应一并修改。

首创证券股份有限公司  
2022年1月7日