

附件：

海通沪盈集合资产管理计划
第六次合同变更核心条款对照明细

合同条款	变更前	变更后
特别约定		<p>特别约定：</p> <p>第六次合同变更的提示</p> <p>特别提示：本集合计划第六次合同变更后，本集合计划的投资范围、投资限制、利益冲突及关联交易、投资指令、估值方法、信息披露、风险揭示、计划终止情形等方面均发生了变化。</p> <p>请投资者务必详细阅读第六次合同变更后的资产管理合同、说明书、风险揭示书，审慎判断是否继续持有或参与本集合计划。</p>
十一、资产管理计划的投资（二）投资范围及比例	<p>1、投资范围</p> <p>本集合计划可以投资国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债(含政策性金融债、次级债(包括二级资本债)、企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、可分离债券、可转换债券、可交换债券(含非公开发行的可交换债券)、超短期融资券、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具、资产支持证券非次级份额(仅包含在银行间市场和证券交易所市场发行的资产支持证券)、债券型公募基金、公募分级基金优先级份额、债券回购、货币市场基金、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、现金、因可转换债券转股或可交换债券换股形成的股票。</p> <p>本集合计划不从二级市场买入股票。本集合计划投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的债券主体评级或债项评级不低于AA，其中债项评级为AA的民企债市值占比不超过本计划资产净值的30%，无债项评级的债券，按</p>	<p>1、投资范围</p> <p>本集合计划可以投资具有良好流动性的金融工具，包括国债、地方政府债、央行票据、金融债(含政策性金融债、次级债(包括二级资本债)、企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、可分离债券、可转换债券、可交换债券(含非公开发行的可交换债券)、超短期融资券、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具、资产支持证券(Abs)、资产支持票据(ABN)、债券型公募基金、债券回购、货币市场基金、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、因可转换债券转股或可交换债券换股形成的股票。</p> <p>投资者在此同意并授权管理人可以进行关联交易，具体约定以本合同第十四章“利益冲突及关联交易”约定为准。</p> <p>资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。变更应为管理人和托管人相关系统准备、投资组合调整、新增投资品种的估值核算等事项留出必要的时间。</p>

<p>照主体评级确定投资比例,短期融资券 债项评级为 A-1 级,资产支持证券的主 体或债项评级为 AA+ (含)以上。本集 合计划不投资于中小企业私募债。</p> <p>以上评级均不采用中债资信评估有 限责任公司提供的评级结果。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计 划投资其他品种的,管理人在履行合同 变更程序后,可以将其纳入本计划的投 资范围。</p>	
<p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 债权类资产: 投资于存款、债券等债权类资产,占集合计划资产总值的 80%-100%;</p> <p>(2) 股权类资产: 仅包括因可转换 债券转股或可交换债券换股形成的股票, 占计划资产总值的 0-20%。投资于 因可转换债券转股或可交换债券换股 形成的股票应在其可上市交易后的 30 个交易日内全部卖出,如遇股票停牌等 特殊情形的,上述时间期限自动顺延;</p> <p>(3) 债券正回购资金余额或逆回购 资金余额不得超过本集合计划上一日 净资产的 100%。</p> <p>若未来监管部门相关法规对该比例 限制予以修改或取消,管理人经公告并 告知托管人后将按照新的监管标准予 以调整,无需再征得委托人同意。</p> <p>(4) 其他资产: 包括货币市场基金 等。</p> <p>.....</p>	<p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 债权类资产: 依市值计占集合计 划资产总值的 80%-100%; 包括:</p> <p>①国债、地方政府债、央行票据、金融 债(含政策性金融债、次级债(包括二级 资本债))、企业债、公司债(含非公开 发行的公司债)、可分离债券、可转换债 券、可交换债券(含非公开发行的可交 换债券)、超短期融资券、短期融资券、中 期票据、非公开定向债务融资工具等经 银行间交易商协会批准发行的各类债务 融资工具、资产支持证券(ABS)、资产 支持票据(ABN)、债券逆回购、同业存 单等。</p> <p>②其他债权类资产: 包括银行存款(包 括协议存款、定期存款及其他银行存 款)、货币市场基金等、债券型公募基金 等。</p> <p>(2) 股权类资产: 仅包括因可转换债 券转股或可交换债券换股形成的股票, 依市值计占计划资产总值的 0-20%。投 资于因可转换债券转股或可交换债券换 股形成的股票应在其可上市交易后的 30 个交易日内全部卖出,如遇股票停牌等 特殊情形的,上述时间期限自动顺延, 本条款由计划管理人自行监控。</p> <p>(3) 本集合计划不从二级市场买入股 票,也不参与新股申购与新股增发。</p> <p>(4) 债券回购: 债券正回购融入资金 余额不超过前一日资产净值的 100%; 参 与债券逆回购资金余额不得超过集合计 划前一日资产净值的 100%。</p> <p>提请投资者注意,本集合计划参与债 券回购,包括债券逆回购、债券正回购。</p>

十一、资产管理计划的投资（六）投资限制及禁止行为	<p>1、投资限制</p> <p>.....</p> <p>1、集合计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种除外；</p> <p>2、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%。国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种除外；</p> <p>3、管理人管理的全部资产管理计划合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>4、本集合计划的证券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过集合计划前一日资产净值的 100%；</p> <p>5、在开放退出期内，本集合计划资产组合中 7 个工作日内可变现资产价值不低于本计划资产净值的 10%；</p> <p>6、本集合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本计划资产净值的 20%；</p> <p>7、本集合计划投资于非公开发行债券的市值占比不超过债券资产市值的 60%；</p> <p>8、本集合计划投资于单只信用债的比例不超过本计划资产净值的 10%；</p> <p>9、本集合计划投资于单只信用债的比例不超过该债券发行总量的 10%；</p> <p>10、法律法规及监管部门规定的其他投资限制、相关法律法规及中国证监会禁止的其他行为。</p>	<p>1、投资限制</p> <p>.....</p> <p>(1) 集合计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 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；</p> <p>(2) 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；</p> <p>(3) 管理人管理的全部资产管理计划合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(4) 本集合计划所投资的公司债、企业债、中期票据等信用债（可转债、可交换债除外）的发行人主体评级或债项评级或担保人主体评级不低于 AA（含），其中债项评级为 AA 的民企债市值占比不超过本计划资产净值的 30%；短期融资券债项评级不低于 A-1（含）或发行人主体评级不低于 AA（含）；资产支持证券（ABS）、资产支持票据（ABN）的主体或债项评级为 AA+（含）以上。本集合计划不投资于中小企业私募债。</p> <p>本集合计划所投资的可转债、可交债的比例依市值合计不超过本集合计划资产净值的 20%；同时，本集合计划所投资的主体评级或债项评级 AA-以下（不含 AA-）的可转债、可交换债的比例不超过本集合计划资产净值的 3%。</p> <p>以上评级均不采用中债资信评估有限责任公司提供的评级结果：</p> <p>(5) 在开放退出期内，7 个工作日内可变现资产价值不低于计划资产净值的 10%，本集合资产管理计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过资产管理计划净值的 20%；</p> <p>(6) 本集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 200%；</p> <p>(7) 债券正回购、逆回购：债券正回购融入资金余额不超过集合计划前一日</p>
--------------------------	--	--

		<p><u>资产净值的 100%; 债券逆回购资金余额不得超过集合计划前一日资产净值的 100%:</u></p> <p><u>(8) 本集合资产管理计划投资资产支持证券、资产支持票据的限制要求如下:</u></p> <p><u>1) 不投资于底层资产为资产管理产品或其(收)受益权的资产支持证券、资产支持票据;</u></p> <p><u>2) 不投资于资产支持证券、资产支持票据的次级份额;</u></p> <p><u>3) 仅投资于在上海/深圳证券交易所挂牌和在中国银行间市场交易商协会注册的资产支持证券、资产支持票据;</u></p> <p><u>(9) 本集合计划投资于非公开发行债券的市值占比不超过债券资产市值的 60%;</u></p> <p><u>(10) 本集合计划投资于单只信用债的比例不超过本计划资产净值的 10%;</u></p> <p><u>(11) 本集合计划投资于单只信用债的比例不超过该债券发行总量的 10%;</u></p> <p><u>(12) 本计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，本计划所申报的金额不得超过计划总资产，本计划所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</u></p> <p><u>(13) 本集合计划不投资于管理人管理的参照公募基金运作的资产管理产品。</u></p> <p><u>(14) 法律法规及中国证监会限制的其他行为。</u></p>
十一、资产管理计划的投资 (八)		<p><u>(八)本集合计划为固定收益类资产管理计划，计划存续期间，为规避特定风险，全体投资者在此同意并授权，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。若本计划持续 6 个月投资于债权类资产的比例低于计划总资产的 80%，则本计划终止。</u></p> <p>.....</p>
十四、利益冲突及关联交易	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、托管人及与管理人或托管人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。管	<p><u>(一)存在的或可能存在的利益冲突情形</u></p> <p><u>鉴于投资者签署本合同后，即表明其同意并授权管理人可以在合同投资范围内将本计划的资产投资于①管理人及关</u></p>

	<p>理人应当遵循客户利益优先原则，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金管理协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。.....</p> <p>联方管理的资产管理产品（含公募基金及资产支持证券）；②管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券（含资产支持证券）或承销期内承销的证券（含资产支持证券）；③或从事其他关联交易。</p> <p><u>鉴于管理人目前存续比照公募基金管理的资产管理产品，因此存在在符合合同投资范围的前提下，本集合计划投资于管理人管理的比照公募基金管理的资产管理产品的情况，也存在投资于管理人关联方管理的公募基金及比照公募基金管理的资产管理产品的情况。</u></p> <p><u>鉴于管理人目前开展资产管理业务及投资顾问业务，因此管理人管理的资产管理计划账户以及管理人作为投资顾问管理的资产管理计划账户之间，可能存在同一交易日对同一标的或同一资产进行同向交易的情况。</u></p> <p><u>鉴于管理人目前开展资产支持证券业务，存在管理人管理的资产管理计划账户以及管理人作为投资顾问管理的资产管理计划账户投资于已发行或即将发行的资产支持证券的原始权益人发行的股票、债券等资产的情况。</u></p> <p><u>鉴于管理人管理的资产管理计划目前参与股票质押式回购业务，存在管理人管理的资产管理计划账户以及管理人作为投资顾问管理的资产管理计划账户投资于股票质押式回购业务标的股票涉及的上市公司股票、债券等资产的情况。</u></p> <p>(二)存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容及披露频率</p> <p><u>投资者在此对上述列举的存在的或可能存在的利益冲突情形表示知悉、确认并同意豁免上述情形。</u></p> <p><u>相关交易按照法律法规及管理人的监管机构要求或本合同约定应当进行信息披露的，管理人将通过法律法规及管理人的监管机构要求的方式、管理人网站或本合同约定的方式，在本计划的定期报告中进行披露（包括所投资资产的名称、数量、金额等信息）。此外，本计划资产投资于管理人、托管人及前述机构</u></p>
--	---

		<p><u>的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券（含资产支持证券）或承销期内承销的证券（含资产支持证券）的，管理人还应在前述投资发生之日起五日内按照法律法规及管理人的监管机构要求或本合同约定的方式告知投资者及托管人。</u></p> <p><u>管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益，事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露。在发生之日起五日内告知投资者及托管人，披露内容包括所投资资产的名称、数量、金额等信息，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。</u></p>
十七、投资指令的发送、确认和执行	<p>十一、集合计划资产托管</p> <p>本集合计划资产交由招商银行上海分行负责托管，并签署了托管协议。</p> <p>托管方式为：银行托管。</p> <p>签订的托管协议已经明确了托管人和管理人之间在计划资产的保管、资金归集和划转、会计核算责任、清算交收流程、最终交收责任、集合计划档案资料保管及集合计划运作互相监督等活动中的权利、义务关系，以确保计划资产的安全，保护委托人的合法权益。若本合同中相关约定与托管协议不一致的，托管人的托管职责以托管协议为准。</p>	<p>十七、投资指令的发送、确认和执行</p> <p>管理人在运用委托财产时向托管人发送资金划拨及其他款项付款指令，托管人执行管理人的指令、办理资产管理计划名下的资金往来等有关事项。</p> <p>管理人发送的指令包括电子指令和纸质指令。</p> <p>电子指令包括管理人发送的电子指令（采用深圳通指令直连传送的电子指令）。纸质指令包括传真指令。</p> <p>在集合计划开始运作前，管理人应事先书面向托管人提供电子指令启用函（格式见，海通沪盈集合资产管理计划托管协议附件5）。电子指令启用函应明确管理人采取电子指令的业务类型、启用日期、紧急情况下发送和接收传真指令的号码、指令确认的电话号码等。启用函应加盖管理人在书面授权通知（以下简称“授权通知”）中的预留印鉴。</p> <p>.....</p>
十九、资产管理计划财产的估值和会计核算 (四) 估值方法	<p>2、具体投资品种估值方法</p> <p>(1) 债券的估值方法</p> <p>1) 对在交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(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；</p> <p>2) 对在交易所上市交易的含有转股</p>	<p>2、具体投资品种估值方法</p> <p>(1) 债券的估值方法</p> <p>①对在交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(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；</p> <p>②交易所上市交易的可转换债券以每</p>

	<p>权的债券，实行净价交易的，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，按最近交易日收盘价进行估值。估值日没有交易的，且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。实行全价交易的，按估值日收盘价减去所含债券应收利息后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，按最近交易日收盘价减去可转换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>③首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>④在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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>⑤交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。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，按估值技术估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按照成本估值；</p> <p>⑥在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格；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>.....</p> <p>(3) 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</p>	<p>日收盘价作为估值全价；交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值；</p> <p>③首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>④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>⑤在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格；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>.....</p> <p>(3) 证券投资基金估值方法</p> <p>①持有的 ETF 基金、境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按估值日其所</p>
--	--	---

	<p>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；未上市的交易所基金，在未上市前如有基金单位净值，估值日按估值日前一交易日的基金单位净值估值；估值日前一交易日基金单位净值无公布的，按此前最近交易日的基金单位净值估值；</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单位净值估值；估值日前一交易日基金单位净值无公布的，按此前最近交易日的基金单位净值估值；</p> <p>③持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司的每万份收益计算；若涉及法律法规调整，以最新规定估值；</p> <p>.....</p> <p><u>(6) 其他品种的估值由管理人和托管人按照估值原则协商确定。</u></p> <p><u>(7) 如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值，管理人应于新规定实施后及时在管理人指定网站进行公告。</u></p> <p><u>(8) 相关法律法规以及监管部门另有新规定的，从其规定。</u></p> <p><u>如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</u></p> <p><u>就与本产品有关的会计问题，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，管理人有权按照其对计划净值的计算结果对外予以公布，由此给投资者和本计划造成的损失，由</u></p>	<p>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，且最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，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；未上市的交易所基金，在未上市前如有基金单位净值，估值日按估值日前一交易日的基金单位净值估值；估值日前一交易日基金单位净值无公布的，按此前最近交易日的基金单位净值估值；</p> <p>②持有的场外基金（包括上市开放式基金（LOF），按估值日前一交易日的基金单位净值估值；估值日前一交易日基金单位净值无公布的，按此前最近交易日的基金单位净值估值；</p> <p>③持有的场外货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司的每万份收益计算；若涉及法律法规调整，以最新规定估值；</p> <p>.....</p> <p><u>(6) 本计划投资的期货合约（包括国债期货合约），一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日结算价估值。</u></p> <p><u>(7) 其他品种的估值由管理人和托管人按照估值原则协商确定。</u></p> <p><u>(8) 如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值，管理人应于新规定实施后及时在管理人指定网站进行公告。</u></p> <p><u>(9) 相关法律法规以及监管部门另有新规定的，从其规定。</u></p> <p><u>如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</u></p> <p><u>就与本产品有关的会计问题，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，管理人有权按照其对计划净值的计算结果对外予以公布，由此给投资者和本计划造成的损失，由</u></p>
--	---	--

		管理人承担相应的赔偿责任。
二十二、信息披露与报告（二）定期报告	<p>1、集合计划单位净值报告 披露时间：本集合计划存续期内每日披露上一个工作日的计划单位净值</p>	<p>1、集合计划单位净值报告 披露时间：本集合计划的封闭期内，管理人应当至少每周公告一次经托管人复核的计划份额净值。在本集合计划的开放期内，管理人应当在每个工作日披露经托管人复核的上一个工作日的计划单位净值。</p>
二十二、信息披露与报告（三）临时报告	<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、销售机构网站或网点、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：</p> <p>.....</p> <p>（9）集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券；</p>	<p>集合计划存续期间，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，除另有约定外，应当在事项发生之日起五日内向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>.....</p> <p>（10）本计划资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券（含资产支持证券）或承销期内承销的证券（含资产支持证券）的；本计划从事重大关联交易的；</p>
二十三、风险揭示	<p>.....</p> <p>（三）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。</p>	<p>（一）资产管理计划面临的一般风险 1、本金损失风险 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 R2 风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2 及以上的合格投资者。</p> <p>.....</p> <p>4、流动性风险 集合计划不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。流动性风险可以分为以下几种：</p> <p>（1）市场整体流动性相对不足。证券市场的流动性受到市场行情、投资群体等众多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，</p>

	<p><u>对集合计划造成不利影响。</u></p> <p><u>(2) 证券市场中流动性不均匀，存在个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些个券的流动性可能仍然比较差，从而使得集合计划在进行个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行对个券价格产生比较大的影响，增加个券的建仓成本或变现成本。</u></p> <p><u>(3) 集合计划中的资产不能应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出的风险。在集合计划退出开放期间，可能会发生巨额退出或大额退出的情形，巨额退出或大额退出可能会产生本计划仓位调整的困难，导致流动性风险，甚至影响本计划资产净值。</u></p> <p><u>(4) 本集合计划存续期内，除开放退出日外投资者不能退出本资产管理计划，对投资者存在流动性风险。</u></p> <p><u>(5) 受限于本集合计划投资标的可能存在的流动性风险，进而导致本集合计划委托财产无法及时变现，对投资者存在流动性风险。</u></p> <p>.....</p> <p>9、其他风险</p> <p><u>(1) 关联交易及利益冲突风险</u></p> <p><u>投资者签署本合同后，即表明其同意并授权管理人可以在合同投资范围内将本计划的资产投资于①管理人及关联方管理的资产管理产品（含公募基金及资产支持证券）；②管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券（含资产支持证券）或承销期内承销的证券（含资产支持证券）；③或从事其他关联交易。投资者对本合同列举的存在的或可能存在的利益冲突情况表示知悉、确认并同意豁免。</u></p> <p><u>相关交易可能存在一定风险，进而影响收益甚至发生亏损，投资者明确知悉且自愿承担该类风险。</u></p> <p>.....</p> <p><u>(二) 资产管理计划面临的特殊风险</u></p> <p><u>1、资产管理计划委托募集所涉风险</u></p> <p>管理人可根据有关法律法规的要求，</p>
<p><u>(八) 本集合计划特有风险</u></p> <p>.....</p>	

	<p><u>选择其他符合要求的销售机构销售本集合计划，管理人增减或变更本集合计划的销售机构时，将提前在管理人指定网站上公告。</u></p> <p><u>投资者通过代销机构参与/退出的本集合计划，需按照代销机构的规定提出申请，由于代销机构不同的规定可能导致投资者参与/退出失败的风险。</u></p> <p><u>除管理人直接办理计划销售外，本计划还可以通过管理人指定的其他销售机构销售，但是，计划资产并不是销售机构的存款或负债，也没有经销售机构担保收益，销售机构并不能保证其收益或本金安全。投资者自愿投资于本计划，须自行承担投资风险。</u></p> <p>.....</p> <p><u>13、资产管理合同与证券投资基金管理协会合同指引不一致所涉风险</u></p> <p><u>基金业协会针对集合资产管理计划资产管理合同的内容及格式发布了《集合计划格式指引》，本资产管理合同虽然尽量在能够满足本计划投资需要的前提下涉及了《集合计划格式指引》的条款，但《集合计划格式指引》主要为概括性、原则性约定，因此本资产管理合同具体条款的约定不可避免的比《集合计划格式指引》更为复杂、更为具体，也不可避免地与《集合计划格式指引》不完全相同。</u></p> <p><u>投资者应当认真阅读本资产管理合同，理解本资产管理合同的全部条款，独立做出是否签署本资产管理合同的决定。</u></p> <p><u>14、第六次合同变更的提示</u></p> <p><u>特别提示：本集合计划第六次合同变更后，本集合计划的投资范围、投资限制、利益冲突及关联交易、投资指令、估值方法、信息披露、风险揭示、计划终止情形等方面均发生了变化。</u></p> <p><u>请投资者务必详细阅读第六次合同变更后的资产管理合同、说明书、风险揭示书，审慎判断是否继续持有或参与本集合计划。</u></p>
二十四、资产管理合同	<p>(一)有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <p>(三)集合计划的终止与财产清算</p> <p>.....</p>

的变更、终 止与财产清 算 8、管理人认为可以提前终止的情况，	(7)本计划持续6个月投资于债权类 资产的比例低于计划总资产的80%，则 <u>本计划终止；</u>
---------------------	-------------------------------------	---

注：本次合同变更，管理人按照中国证券投资基金业协会发布的《集合计划格式指引》对《海通沪盈集合资产管理计划资产管理合同》进行了重述；以上表格列举本次合同变更的核心条款对照，具体请以资产管理合同为准。