

附件:

海通资管沪盈 2 号集合资产管理计划 第一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>特别约定：</p> <p><u>第一次合同变更的提示</u> 特别提示：本集合计划第一次合同变更后，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><u>请投资者务必仔细阅读第一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>
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、因可转换债券转股或可交换债券换股形成的股票。</p> <p>本集合计划投资于公司债、企业债、中期票据等信用债(可转债、可交换债除外)的债券主体评级或债项评级不低手 AA(含)短期融资券债项评级不低手 A-1 级(含); 资产支持证券的主体评级或债项评级不低手 AA+(含)。上</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 <u>(ABS)、资产支持票据(ABN)</u>、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><u>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。</u></p>

	<p>述投资品种若无债项评级的,则按照主体评级确定投资比例,即公司债、企业债、中期票据、短期融资券等信用债(可转债、可交换债除外)的债券主体评级不低手AA(含)、资产支持证券的主体评级不低手AA+(含)。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>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>产品的实际投向不得违反合同约定,如有改变,管理人应在与托管人协商一致、先行取得投资者书面同意后,履行合同变更程序,并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>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、公募分级基金优先级份额等。</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、债券型公募基金等。</p> <p>.....</p>
<p>十一、资产管理计划的 投资 (六) 投资限制及禁止</p>	<p>1、投资限制</p> <p>.....</p> <p>(4) 本集合计划投资于公司债、企业债、中期票据等信用债(可转债、可交换债除外)的债券主体评级或债项评</p>	<p>1、投资限制</p> <p>.....</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</p>

<p>行为</p>	<p>级不低手 AA (含); 短期融资券债项评级不低手 A-1 级 (含); 资产支持证券的主体评级或债项评级不低手 AA+ (含)。上述投资品种若无债项评级的, 则按照主体评级确定投资比例, 即公司债、企业债、中期票据、短期融资券等信用债 (可转债、可交换债除外) 的债券主体评级不低手 AA (含)、资产支持证券的主体评级不低手 AA+ (含)。本集合计划不投资于中小企业私募债。</p> <p>.....</p> <p>(8) 本集合资产管理计划投资资产支持证券的限制要求如下:</p> <p>1) 不投资于底层资产为资产管理产品或其收益权的资产支持证券;</p> <p>2) 不投资于资产支持证券次级份额;</p> <p>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;</p> <p>4) 所投资资产支持证券份额评级为不低手 AA+ (含)。</p> <p>.....</p> <p>(12) 本集合计划投资于可转债、可交换债的市值占比不超过总资产的 20%;</p> <p>.....</p>	<p>级或担保人主体评级不低手 AA (含); 短期融资券债项评级不低手 A-1 (含) 或发行人主体评级不低手 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>.....</p> <p>(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:</p> <p>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;</p> <p>2) 不投资于资产支持证券、资产支持票据的次级份额;</p> <p>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;</p> <p>.....</p> <p>(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。</p> <p>.....</p>
<p>十一、资产管理计划的投资 (八)</p>	<p>(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, 经全体投资者同意后, 投资于对应类别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%。</p> <p>.....</p>	<p>(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。</p> <p>.....</p>
<p>十四、利益冲突及关联交易</p>	<p>(一) 存在的或可能存在的利益冲突情形</p> <p>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将本计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托</p>	<p>(一) 存在的或可能存在的利益冲突情形</p> <p>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</p>

管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券（包括资产支持证券）或承销期内承销的证券（包括资产支持证券）或管理人管理的资产支持证券，或者从事其他关联交易，因此可能存在利益冲突情形。

.....

（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

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，其中，涉及关联交易的，按以下约定进行处理：

管理人运用受托管理资产从事关联交易的，应当遵循客户利益优先原则，事后及时、全面、客观地向投资者和托管人进行披露。管理人应通过网站或者本合同约定的联系方式，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。

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、客观地向投资者和托管人进行披露。管理人应通过网站或者本合同约定的联系方式，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。

管理人应当按照本合同的约定向投资者提供资产管理计划季度报告和年度报告，披露报告期内的重大关联交易。

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。

鉴于管理人目前存续比照公募基金管理的资产管理产品，因此在符合合同投资范围的前提下，存在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。

.....

（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

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。

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。

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。

<p>十七、投资指令的发送、确认和执行</p>	<p>十七、投资指令的发送、确认和执行</p>	<p>十七、投资指令的发送、确认和执行</p> <p><u>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。</u></p> <p><u>管理人发送的指令包括电子指令和纸质指令。</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>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，海通资管沪盈2号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（以下称“授权通知”）中的预留印鉴。</u></p> <p>.....</p>
<p>十七、投资指令的发送、确认和执行</p> <p>（三）指令的发送、确认及执行时间与程序</p>	<p>1、指令的发送：管理人通过托管人网上托管银行系统录入或电子直连对接等方式，向托管人发送电子划款指令或投资指令。</p> <p>（1）网上托管银行方式（含电子直连对接方式）</p> <p>网上托管银行是指托管人基于Internet网络，向管理人提供的客户服务软件，实现管理人与托管人之间指令处理、数据传输、业务查询、资料传递和信息服务等直通式处理。</p> <p>管理人和托管人另行签订《招商银行网上托管银行服务协议》，具体事宜以《招商银行网上托管银行服务协议》的约定为准。</p> <p>对于管理人通过网上托管银行方式发送的指令，管理人不得否认其效力。</p> <p>（2）在应急情况下，管理人应事先书面告知托管人并说明原因后，以传真发送划款指令作为应急措施。</p> <p>对于管理人通过预留传真号码发出的指令，管理人不得否认其效力。</p> <p>对于通过非预留传真号码发送的传真指令，托管人需通过录音电话与管理</p>	<p>1、指令的发送：<u>管理人通过深证通指令直连方式，向托管人发送电子划款指令或投资指令。</u></p> <p><u>（1）深证通指令直连方式</u></p> <p><u>若管理人已与托管人建立深圳通指令直连，管理人应优先以电子指令形式向托管人发送指令，并应事先书面向托管人指定各业务类型投资指令的发送主渠道，以传真或电子邮件作为应急方式备用。</u></p> <p><u>对于管理人通过深圳通指令直连方式发送的指令，管理人不得否认其效力。</u></p> <p><u>（2）在应急情况下，管理人应事先书面告知托管人并说明原因后，以传真发送划款指令作为应急措施。</u></p> <p><u>对于管理人通过预留传真号码发出的指令，管理人不得否认其效力。</u></p> <p><u>对于通过非预留传真号码发送的传真指令，托管人需通过录音电话与管理人在《电子指令启用函》指定的指令确认电话号码核对指令日期、指令张数、指令类型、付款产品名称、收款方名称、金额、用途等。</u></p> <p><u>变更或新增接收传真指令的号码，管</u></p>

	<p>人在《指令启用函》指定的指令确认电话号码核对指令日期、指令张数、指令类型、付款产品名称、收款方名称、金额、用途等。</p> <p>变更或新增接收传真指令的号码，管理人应事先向托管人更新《指令启用函》。</p> <p><u>(3) 划款指令附件的发送</u></p> <p>管理人向托管人发送指令的同时，通过网上托管银行、《指令启用函》中的预留传真号码或预留指令附件发送电子邮箱提供相关合同、交易凭证或其他证明材料。管理人对该等资料真实性、有效性、完整性和合法合规性负责。</p> <p>对于通过网上托管银行、预留传真号码或预留电子邮箱发出的指令附件，管理人不得否认其效力。</p> <p>.....</p>	<p>理人应事先向托管人更新《电子指令启用函》。</p> <p><u>(3) 划款指令附件的发送</u></p> <p>管理人向托管人发送指令的同时，通过深圳通指令直连、《电子指令启用函》中的预留传真号码或预留指令附件发送电子邮箱提供相关合同、交易凭证或其他证明材料。管理人对该等资料的真实性、有效性、完整性和合法合规性负责。</p> <p>对于通过深圳通指令直连、预留传真号码或预留电子邮箱发出的指令附件，管理人不得否认其效力。</p> <p>.....</p>
<p>十九、资产管理计划财产的估值和会计核算</p> <p>(四) 估值方法</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对在交易所上市交易的含有转股权的债券，实行净价交易的，按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日收盘价进行估值。估值日没有交易的，且最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大事件的，可参考类似投资品种的现行价格及重大变化因素，调整最近交易日的收盘价确定公允价值。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，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去截至最近交易日所含的债券应收利息得到的净价进行估值。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，可参考类似投资品种的现行价格及重大变化因素，调整最近交易日的收盘</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</p>

价并减去所含的债券应收利息后确定公允价值；—

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；—

④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，主要依据第三方估值机构提供的估值价格；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，主要依据第三方估值机构提供的估值价格，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；—

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；—

……

(3) 证券投资基金估值方法

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，调整最近交易日的收盘价，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；

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；

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

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；

……

(3) 证券投资基金估值方法

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；

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；

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

	<p>计算；若涉及法律法规调整，以最新规定估值；</p> <p>.....</p> <p><u>(8) 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，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</u></p> <p><u>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>管理人更改原则进行估值的，要及时书面通知托管人。托管人要认真核查管理人采用的估值政策和程序。当托管人对计划估值方法存有异议时，托管人有权要求管理人做出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。</u></p> <p><u>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。本资管计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本资管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，按照管理人对资产净值的计算结果对外予以公布。</u></p>	<p>益计算；若涉及法律法规调整，以最新规定估值；</p> <p>.....</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，由管理人承担相应的赔偿责任。</u></p>
<p>二十二、信息披露与报告（二）定期报告</p>	<p>3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>.....</p> <p>年度报告包括但不限于下列信息：</p> <p>.....</p> <p><u>(10) 中国证监会规定的其他事项。</u></p>	<p>3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>.....</p> <p>年度报告包括但不限于下列信息：</p> <p>.....</p> <p><u>(10) 本合同约定的其他需要以定期报告形式披露的事项；</u></p> <p><u>(11) 中国证监会规定的其他事项。</u></p>
<p>二十二、信息披露与报告（二）临时报告</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，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><u>(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、管理人管理的资产支持证券；</u></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，<u>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：</u></p> <p>.....</p> <p><u>(10) 本计划投资于管理人、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</u></p>

		<p>资产支持证券)的;本计划从事重大关联交易的;</p>
<p>二十三、风险揭示</p>	<p>(一)资产管理计划面临的一般风险</p> <p>4、流动性风险</p> <p>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。流动性风险按照其来源可以分为三类:</p> <p>.....</p> <p>9、其他风险</p> <p>(1)关联交易风险</p> <p>投资者在此同意并授权管理人可以将本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、管理人管理的资产支持证券,或者从事其他关联交易。相关关联交易可能存在一定风险。</p> <p>.....</p> <p>(二)资产管理计划面临的特殊风险</p> <p>1、资产管理计划委托募集所涉风险</p> <p>.....</p>	<p>(一) 资产管理计划面临的一般风险</p> <p>4、流动性风险</p> <p>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<u>以下几种:</u></p> <p>.....</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>(1) 关联交易及利益冲突风险</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。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>(二) 资产管理计划面临的特殊风险</p> <p>1、资产管理计划委托募集所涉风险</p> <p>.....</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>

.....

14、本集合计划的预警与止损机制

本计划预警线为计划份额净值 0.95 元。本计划止损线为计划份额净值 0.92 元。

(1) 本计划建仓期满后，如某一工作日（N 日）本计划份额净值等于或低于预警线，则本计划触及预警线，管理人应从 N+1 日起停止新增股权类资产，即通过可转换债券转股或可交换债券换股形成的股票。若触发预警机制后的任一工作日本计划份额净值高于预警线，则自该工作日的下一个工作日起，管理人可以恢复新增股权类资产。

(2) 任一工作日（N 日）日终本计划份额净值等于或低于止损线，管理人应自 N+1 日起对本计划持有的非现金资产执行强制卖出操作，直至本计划的资产全部变现（当出现无法变现资产时除外）。按照上述要求变现完成后，本计划终止。对于计划终止时无法变现的资产，管理人将按照本合同第二十四章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”约定的处理方式延期清算。

(3) 若触发止损机制后的任一工作日计划份额净值恢复至止损线以上（不含）但不超过预警线（含），则自该工作日的下一个工作日起，管理人可按照触发预警机制的要求进行投资运作；若任一工作日计划份额净值恢复至不低于 1 元（不含），则自该工作日的下一个工作日起，管理人可解除预警机制、止损机制，并可按照本合同约定的其他投资政策执行。

投资者确认，集合计划份额净值达到预警线（含）或止损线（含）元是管理人采取相应行动的起点，在管理人执行相应操作后，计划份额净值可能会低于预警线元或止损线，该等计划份额净值不是管理人的保证或担保。

15、第一次合同变更的提示

特别提示：本集合计划第一次合同变更后，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

		<p><u>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>请投资者务必仔细阅读第一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>
<p>二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算</p>	<p>(三) 集合计划的终止与财产清算</p> <p>.....</p> <p>(7) 管理人按合同约定进行平仓止损，资产全部变现，本计划提前终止。</p>	<p>(三) 集合计划的终止与财产清算</p> <p>.....</p> <p><u>(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%，则本计划终止；</u></p> <p>(8) 管理人按合同约定进行平仓止损，<u>按要求变现完成后</u>，本计划提前终止。</p>

注：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。

