

# 关于安信证券添添利3号集合资产管理计划

## 合同变更的公告

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及《安信证券添添利3号集合资产管理计划资产管理合同》“第24部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算”的规定，经与托管人广发银行股份有限公司协商一致，管理人安信证券资产管理有限公司将对《安信证券添添利3号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）中相关内容进行变更（以下简称“本次变更”），现就本次变更相关事项公告如下：

### 一、合同主要变更内容：

本次变更详细内容请参见附件一《安信证券添添利3号集合资产管理计划资产管理合同修订对照表》。

### 二、合同变更安排

#### 1、征询意见期

本次变更征询意见期为：2022年9月5日至2022年9月9日15:00。

#### 2、回复意见

请委托人在征询意见期内，书面签署附件二《关于安信证券添添利3号集合资产管理计划合同变更的回复意见函》（以下简称“《回复函》”）反馈意见，未签署《回复函》的委托人或逾期回复的委托人视为同意合同的变更，同意合同变更的委托人，无需签署新合同。

#### 3、退出安排

(1) 不同意变更或回复意见不明确的委托人，可于征询意见期内2022年9月9日退出本集合计划；

(2) 不同意变更或回复意见不明确但未于征询意见期退出的，管理人将在征询意见期最后一个工作日即2022年9月9日日终做强制退出处理。

### 三、合同变更生效日

本合同满足法律法规要求的集合计划成立要件后，本合同变更生效。合同变更生效日为征询意见期结束次一工作日，即2022年9月13日。

### 四、其他事项

1、安信证券添利3号集合资产管理计划将于2022年9月9日正常办理参与业务。于此期间办理参与业务的委托人，管理人默认委托人已知悉本次变更的相关内容，并同意本次合同变更，管理人将依据变更生效后新合同进行资产管理业务。

2、根据生效后的《安信资管周周盈1号集合资产管理计划资产管理合同》关于开放期的安排，本资产管理计划变更生效后进入首个参与开放期，首个参与开放期为本合同生效之日（含）起连续3个交易日，即2022年9月13日至9月15日，投资者可正常办理参与业务；首个参与开放期结束后，本资产管理计划于每【周三】开放，若【周三】为法定节假日，则顺延至下一周的【周三】，投资者可以在开放期内办理参与和退出业务。

3、本公告发布同时向委托人就合同变更事宜征求意见，不再另行征询，敬请各位委托人根据公告要求予以函复。

如有疑问，可咨询电话：95517。

安信证券资产管理有限公司

2022年9月2日



附件一：安信证券添添利3号集合资产管理计划合同修订对照表

变更前	变更后
产品名称	
安信证券添添利3号集合资产管理计划	安信资管周周盈1号集合资产管理计划
管理人	
安信证券股份有限公司	安信证券资产管理有限公司
<b>第1部分 前言</b>	
<p>一、订立本资产管理合同（以下简称“本合同”）的依据包括但不限于《中华人民共和国合同法》、《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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》等法律法规、中国证券监督管理委员会和中国证券业协会、中国证券投资基金业协会的有关规定。</p> <p>二、订立本合同的目的是为了规范安信证券添添利3号集合资产管理计划的运作，明确《安信证券添添利3号集合资产管理计划资产管理合同》当事人的权利与义务，确保委托财产的安全，保护当事人各方的合法权益。</p>	<p>一、订立本资产管理合同（以下简称“本合同”）的依据包括但不限于《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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》等法律法规、中国证券监督管理委员会和中国证券业协会、中国证券投资基金业协会的有关规定。</p> <p>二、订立本合同的目的是为了规范安信资管周周盈1号集合资产管理计划的运作，明确《安信资管周周盈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，确保委托财产的安全，保护当事人各方的合法权益。</p>
<b>第2部分 释义</b>	
集合资产管理计划、本资产管理计划、资产管理计划、本资产管理计划、计划：指安信证券添添利3号集合资产管理计划；	集合资产管理计划、本资产管理计划、资产管理计划、本资产管理计划、计划：指安信资管周周盈1号集合资产管理计划；
资产管理计划说明书、说明书：指《安信证券添添利3号集合资产管理计划说明书》及其对任何有效修订和补充；	资产管理计划说明书、说明书：指《安信资管周周盈1号集合资产管理计划说明书》及其对任何有效修订和补充；
集合资产管理合同、资产管理合同、本合同、纸质合同、电子合同：指《安信证券添添利3号集合资产管理计划资产管理合同》及其对任何修订和补充；	集合资产管理合同、资产管理合同、本合同、纸质合同、电子合同：指《安信资管周周盈1号集合资产管理计划资产管理合同》及其对任何修订和补充；
托管协议：指《安信证券添添利3号集合资产管理计划托管协议》及其对任何有效修订和补充；	托管协议：指《安信资管周周盈1号集合资产管理计划托管协议》及其对任何有效修订和补充；
管理人：指安信证券股份有限公司，简称“安信证券”；	管理人：指安信证券资产管理有限公司，简称“安信资管”；
销售机构：安信证券股份有限公司及其他符合条件的销售机构（以管理人公告为准）；	销售机构：安信证券股份有限公司、安信证券资产管理有限公司及其他符合条件的销售机构（以管理人公告为准）；
注册登记机构：指办理本资产管理计划注册登记业务的机构，本资产管理计划的注册登记机构为安信证券股份有限公司或接受安信证券股份有限公司委托代为办理登记结算业务的机构；	注册登记机构：指办理本资产管理计划注册登记业务的机构，本资产管理计划的注册登记机构为安信证券资产管理有限公司或接受安信证券资产管理有限公司委托代为办理登记结算业务的机构；
管理人指定网站：指 www.essence.com.cn，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：指 www.axzqzg.com，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。
<b>第2部分 当事人权利义务</b>	
<p>（二）管理人</p> <p>机构名称：安信证券股份有限公司</p> <p>法定代表人：王连志</p> <p>住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元</p> <p>通讯地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦A座27层</p> <p>邮政编码：518026</p> <p>联系人：郝笑寒</p> <p>联系电话：0755-88027203</p>	<p>（二）管理人</p> <p>机构名称：安信证券资产管理有限公司</p> <p>法定代表人：李力</p> <p>注册地址：深圳市福田区福田街道福安社区福华一路119号安信金融大厦21楼、22楼</p> <p>住所：深圳市福田区莲花街道福中社区金田路4018号安联大厦27A02、27B02</p> <p>邮政编码：518026</p> <p>联系人：马志茹</p> <p>联系电话：0755-88027228</p>
<b>第5部分 资产管理计划的基本情况</b>	
一、资产管理计划的名称	一、资产管理计划的名称
安信证券添添利3号集合资产管理计划	安信资管周周盈1号集合资产管理计划
四、资产管理计划的投资	四、资产管理计划的投资
<p>（一）投资目标</p> <p>本资产管理计划以为投资者争取最大收益为目标，遵循定量分析和定性分析相结合的投资理念，在有效控制风险的基础上，通过精选投资逻辑清晰、管理能力优异、具有良好表现各类金融产品，力争委托资产的稳健增值。</p> <p>（二）主要投资方向</p> <p>1、银行存款、同业存单、国债、央行票据、地方政府债、金融债（含次级债、混合资本债）、公司债（含非公开发行）、企业债（含非公开发行）、项目收益债、专项债券、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、非公开定向债务融资工具、沪深交易所挂牌交易的资产支持证券（ABS）优先级（穿透至底层资产不得为产品）、资产支持票据（ABN）、可转债、分离交易可转债、可交换债、债券正回购、债券逆回购以及符合《指导意见》规定的其他标准化债权类资产；</p> <p>2、本资产管理计划可持有可转债转股、可交换债换股所得的股票，但不可直接从二级市场上买入股票。</p> <p>3、公开募集债券型基金和货币基金；</p> <p>4、商品及金融衍生品类资产：国债期货。</p> <p>（三）投资比例</p>	<p>（一）投资目标</p> <p>本资产管理计划以为投资者争取最大收益为目标，遵循定量分析和定性分析相结合的投资理念，在有效控制风险的基础上，力争委托资产的稳健增值。</p> <p>（二）主要投资方向</p> <p>1、银行存款（包括但不限于银行活期存款、银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、国债、央行票据、地方政府债、金融债（含次级债、混合资本债、政策性银行债）、公司债（含非公开发行）、企业债（含非公开发行）、项目收益债、专项债券、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、非公开定向债务融资工具、资产支持证券（ABS）优先级、资产支持票据（ABN）优先级、可转债、分离交易可转债、可交换债、永续债、债券正回购、债券逆回购以及符合《指导意见》规定的其他标准化债权类资产。</p> <p>2、本资产管理计划可持有可转债转股、可交换债换股所得的股票，但不可直接从二级市场上买入股票。</p> <p>3、公开募集债券型基金和货币基金。</p> <p>（三）投资比例</p>

<p>1、固定收益类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不低于80%；</p> <p>2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为0%~10%，持有可转债转股、可交换债换股所得的股票，转股后需在10个工作日内卖出。</p> <p>3、商品及金融衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过20%或衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的20%；</p> <p>4、资产管理计划投资于公募基金的市值占资产管理计划资产总值的比例不超过80%；</p> <p>.....</p> <p>(四)产品风险等级</p> <p>本资产管理计划属于R3(中风险)等级品种。</p>	<p>1、固定收益类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不低于80%；</p> <p>2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为0%~10%，持有可转债转股、可交换债换股所得的股票，转股/换股后需在其可交易之日起10个工作日内卖出；</p> <p>3、本资产管理计划投资于公募基金的市值占资产管理计划资产总值的比例不超过80%；</p> <p>.....</p> <p>(四)产品风险等级</p> <p>本资产管理计划属于R2(中低风险)等级品种。</p>
<p>五、资产管理计划的存续期限</p> <p>本资产管理计划存续期限为自资产管理计划成立之日起5年。当本资产管理计划非现金类资产全部变现时，管理人有权提前终止本资产管理计划。在到期之前经投资者同意后，并在符合法律法规、中国证监会相关规定以及本合同约定的前提下，本资产管理计划可展期。</p>	<p>五、资产管理计划的存续期限</p> <p>本资产管理计划存续期限为自资产管理计划成立之日起10年。当本资产管理计划非现金类资产全部变现时，管理人有权提前终止本资产管理计划。在到期之前经投资者同意后，并在符合法律法规、中国证监会相关规定以及本合同约定的前提下，本资产管理计划可展期。</p>
<p>九、资产管理计划的服务机构</p> <p>本资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务均由安信证券股份有限公司提供，不存在聘请外部服务机构的情形。</p>	<p>九、资产管理计划的服务机构</p> <p>本资产管理计划的服务机构为安信证券资产管理有限公司。</p> <p>安信证券股份有限公司为安信证券资产管理有限公司提供投资运营管理、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务和支持，管理人应当承担的责任不因安信证券股份有限公司提供上述运营服务和支持而免除，对本资产管理合同各方当事人权利义务也不产生影响。管理人与安信证券股份有限公司之间产生的纠纷，由管理人负责解决。</p>
<p><b>第6部分 资产管理计划的募集</b></p>	
<p>一、资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限</p> <p>(一)募集对象</p> <p>本资产管理计划面向符合条件的合格投资者募集。本资产管理计划适合向专业投资者及风险承受能力为C3(稳健型)、C4(积极型)、C5(激进型)的普通合格投资者募集。.....</p> <p>.....</p> <p>参与本资产管理计划的投资者如属于上述第4类“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”的，该资产管理产品的投资者中不得存在其他私募资产管理产品。该资产管理产品的管理人应当如实配合向本资产管理计划的销售机构、管理人提供投资者明细，否则，销售机构、管理人有权拒绝其参与本资产管理计划。该资产管理产品的投资者提供信息有误、造成本资产管理计划的销售机构、管理人损失的，应向销售机构、管理人赔偿损失。若前述投资者信息发生实质性变更，该资产管理产品的管理人承诺将及时告知本资管计划的管理人，并承诺不会出现导致本资管计划发生多层嵌套的情形。</p> <p>(二)募集方式</p> <p>本资产管理计划通过安信证券股份有限公司及其他符合条件的销售机构(以管理人公告为准)进行募集。.....</p>	<p>一、资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限</p> <p>(一)募集对象</p> <p>本资产管理计划面向符合条件的合格投资者募集。本资产管理计划适合向专业投资者及风险承受能力为C2(谨慎型)、C3(稳健型)、C4(积极型)、C5(激进型)的普通合格投资者募集。.....</p> <p>.....</p> <p>参与本资产管理计划的投资者如属于上述第4类“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”的，该资产管理产品的投资者中不得存在其他私募资产管理产品。该资产管理产品的管理人应当如实配合向本资产管理计划的销售机构、管理人提供投资者明细，否则，销售机构、管理人有权拒绝其参与本资产管理计划。该资产管理产品的管理人提供信息有误、造成本资产管理计划的销售机构、管理人损失的，应向销售机构、管理人赔偿损失。若前述投资者信息发生实质性变更，该资产管理产品的管理人承诺将及时告知本资管计划的管理人，并承诺不会出现导致本资管计划发生多层嵌套的情形。</p> <p>(二)募集方式</p> <p>本资产管理计划通过安信证券股份有限公司、安信证券资产管理有限公司及其他符合条件的销售机构(以管理人公告为准)进行募集。.....</p>
<p><b>第8部分 资产管理计划的参与、退出与转让</b></p>	
<p>一、参与和退出的场所</p> <p>本资产管理计划参与和退出的场所为安信证券股份有限公司及其他符合条件的销售机构(以管理人公告为准)。</p>	<p>一、参与和退出的场所</p> <p>本资产管理计划参与和退出的场所为安信证券股份有限公司、安信证券资产管理有限公司及其他符合条件的销售机构(以管理人公告为准)。投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的参与和退出。</p>
<p>二、参与和退出的开放日和/时间</p> <p>本资产管理计划自成立之日起，以每12个月为一个运作周期，每个运作周期内最后5个工作日为开放期，开放期内均可以办理参与业务，但仅第一个开放日(T日)可办理退出业务。</p>	<p>二、参与和退出的开放日和/时间</p> <p>自《安信资管周周盈1号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)生效之日起，本资产管理计划进入首个参与开放期，首个参与开放期为本合同生效之日(含)起连续3个交易日，届时以管理人公告为准。</p> <p>首个参与开放期结束后，本资产管理计划于每【周三】开放，若【周三】为法定节假日，则顺延至下一周的【周三】，投资者可以在开放期内办理参与和退出业务。</p> <p>管理人可根据资产配置安排和资产管理计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。</p> <p>风险提示：除开放期、法律法规、监管规定另有规定或本合同另有约定外，投资者存在无法退出本资产管理计划的风险。</p>
<p>五、参与和退出的金额限制</p> <p>.....</p> <p>本资产管理计划在退出开放期无退出次数限制。</p>	<p>五、参与和退出的金额限制</p> <p>.....</p> <p>本资产管理计划在开放期无退出次数限制。</p>
<p>九、巨额退出或连续巨额退出</p> <p>(一)巨额退出</p> <p>.....</p> <p>2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>.....</p> <p>部分顺延退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者的退出申请可能对资产管理计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不</p>	<p>九、巨额退出或连续巨额退出</p> <p>(一)巨额退出</p> <p>.....</p> <p>2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>.....</p> <p>部分顺延退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者的退出申请可能对资产管理计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出</p>

<p>低于上一日资产管理计划总份额的10%的前提下,对其余退出申请延期办理。……</p>	<p>比例不低于上一日资产管理计划总份额的10%的前提下,可以对其余退出申请延期办理。……</p>
<p>十一、拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式 (二)拒绝或暂停退出的情形及处理方式 …… 发生上述情形之一的,已接受的退出申请,管理人将足额支付;如暂时不能支付的,可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人,未支付部分由管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付,但最长不超过正常支付时间20个工作日,并通过管理人网站或投资者认可的方式报告给投资者。</p>	<p>十一、拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式 (二)拒绝或暂停退出的情形及处理方式 …… 发生上述情形之一的,已接受的退出申请,管理人将足额支付;如暂时不能支付的,可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人,未支付部分由管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付,但最长不超过正常支付时间20个工作日,并通过管理人网站或投资者认可的方式告知投资者。</p>
<p>十四、管理人自有资金参与及退出 (一)管理人不以自有资金参与本资产管理计划。</p>	<p>十四、管理人自有资金参与及退出 (一)自有资金参与 1、自有资金参与的条件 管理人可在募集期和存续期以自有资金参与本资产管理计划,应符合本合同、《意见》、《管理办法》、《运作管理规定》和中国证监会及证券投资基金业协会的相关规定。 2、自有资金参与的方式 管理人自有资金持有的份额与其他投资者持有的份额享有同等权益、承担同等风险。管理人自有资金不对投资者的本金和收益进行赔付。参与时,管理人应当提前5个工作日告知投资者和托管人。 3、自有资金参与的金额和比例 (1)如管理人及其附属机构以自有资金参与本资产管理计划的,管理人自有资金参与资产管理计划的份额不超过资产管理计划总份额的15%,管理人及其附属机构以自有资金参与资产管理计划的份额合计不得超过资产管理计划总份额的50%。 (2)本资产管理计划份额增加时,管理人有权增加自有资金参与份额,但参与比例不能超过上述第(1)条的限制。 (3)本资产管理计划因规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与本资产管理计划比例被动超过法律、法规及本合同规定的上限时,管理人应及时退出自有资金持有的超限部分资产管理计划份额。 (二)自有资金退出 资产管理计划存续期间,管理人自有资金参与资产管理计划的持有期限不少于6个月时,可以退出资产管理计划。退出时,管理人应当提前5个工作日告知投资者和托管人。 (三)为应对资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险,或者中国证监会认可的其他情形,在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下,管理人及其附属机构以自有资金参与及后续退出集合资产管理计划可不受上述第(一)、(二)条的限制,但应当及时告知投资者和托管人,并向中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会报告。 (四)若法律法规关于管理人自有资金投资比例和退出条件等规定发生变化,管理人可参照最新法律法规要求,按规定履行合同变更程序后,变更相关条款。 (五)风险提示:管理人自有资金退出后,本资产管理计划可能遭遇流动性风险,从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责,关注计划规模变动情况,控制流动性风险。</p>
<p><b>第10部分 资产管理计划份额的登记</b></p>	
<p>二、本资产管理计划的注册登记机构为安信证券股份有限公司。</p>	<p>二、本资产管理计划的注册登记机构为安信证券资产管理有限公司。</p>
<p><b>第11部分 资产管理计划的投资</b></p>	
<p>一、投资目标 以为投资者争取最大收益为目标,遵循定量分析和定性分析相结合的投资理念,在有效控制风险的基础上,通过精选投资逻辑清晰、管理能力优异、具有良好表现的各类金融产品,力争投资资产的稳健增值。</p>	<p>一、投资目标 以为投资者争取最大收益为目标,遵循定量分析和定性分析相结合的投资理念,在有效控制风险的基础上,力争投资资产的稳健增值。</p>
<p>二、投资范围及比例 (一)投资范围 1、银行存款、同业存单、国债、央行票据、地方政府债、金融债(含次级债、混合资本债)、公司债(含非公开发行)、企业债(含非公开发行)、项目收益债、专项债券、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、非公开定向债务融资工具、沪深交易所挂牌交易的资产支持证券(ABS)优先级(穿透至底层资产不得为产品)、资产支持票据(ABN)、可转债、分离交易可转债、可交换债、债券正回购、债券逆回购以及符合《指导意见》规定的其他标准化债权类资产; 2、本资产管理计划可持有可转债转股、可交换债换股所得的股票,但不可直接从二级市场上买入股票。 3、公开募集债券型基金和货币基金; 4、商品及金融衍生品类资产:国债期货。 (二)投资比例 1、固定收益类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不低于80%; 2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为0%~10%,持有可转债转股、可交换债换股所得的股票,转股/换股后需在10个工作日内卖出。 3、商品及金融衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过20%或衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的20%;</p>	<p>二、投资范围及比例 (一)投资范围 1、银行存款(包括但不限于银行活期存款、银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款)、同业存单、国债、央行票据、地方政府债、金融债(含次级债、混合资本债、政策性银行债)、公司债(含非公开发行)、企业债(含非公开发行)、项目收益债、专项债券、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、非公开定向债务融资工具、资产支持证券(ABS)优先级、资产支持票据(ABN)优先级、可转债、分离交易可转债、可交换债、永续债、债券正回购、债券逆回购以及符合《指导意见》规定的其他标准化债权类资产。 2、本资产管理计划可持有可转债转股、可交换债换股所得的股票,但不可直接从二级市场上买入股票。 3、公开募集债券型基金和货币基金。 (二)投资比例 1、固定收益类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不低于80%; 2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为0%~10%,持有可转债转股、可交换债换股所得的股票,转股/换股后需在其可交易之日起10个工作日内卖出; 3、本资产管理计划投资于公募基金的市值占资产管理计划资产总值的比例不超过80%;</p>

<p>4、资产管理计划投资于公募基金的市值占资产管理计划资产总值的比例不超过80%；</p> <p>.....</p>	<p>.....</p>
<p>六、投资策略</p> <p>(二) 资产管理计划的投资策略程序</p> <p>严格的投资管理制度和程序可以保证投资理念的正确执行，避免发生重大风险。本资产管理计划采取公司资产管理业务投资决策委员会和资产管理部投资决策小组领导下的投资经理负责制。管理人另设立风险控制小组，对集合资产管理计划进行绩效分析和风险评估。</p> <p>1、研究分析</p> <p>宏观策略分析师和行业分析师在借鉴外部研究成果的基础上，开展宏观经济及政策分析、债券市场分析、行业及上市公司分析；定量分析师负责量化策略的研究、模型的构建、检验、维护和运行结果的报告。通过以上研究工作，为投资决策委员会、<b>投资决策小组</b>以及投资经理提供独立、统一的投资决策支持。</p> <p>2、投资决策</p> <p>资产管理部投资决策小组定期和不定期召开会议，对宏观经济形势、利率趋势、证券市场走势等进行综合分析，确定资产管理计划下一阶段的资产配置；<b>审核</b>投资经理提交的投资计划以及其他涉及资产管理计划投资管理的重大问题。</p> <p>3、组合构建</p> <p>投资经理在投资决策小组给定的资产配置比例范围内，结合资产管理计划有关投资品种、投资限制等规定完成投资组合的构建。</p> <p>.....</p> <p>5、风险与绩效评估</p> <p>风险控制小组对资产管理计划的投资行为进行合规性监控，对投资过程中存在的风险隐患进行风险提示，并就投资组合提出风险管理建议；定期和不定期对资产管理计划进行风险和绩效评估，对投资组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略提供相关报告。</p>	<p>六、投资策略</p> <p>(二) 资产管理计划的投资策略程序</p> <p>严格的投资管理制度和程序可以保证投资理念的正确执行，避免发生重大风险。本资产管理计划采取<b>投资决策委员会</b>领导下的<b>投资经理负责制</b>。管理人另设立<b>风险部</b>，对集合资产管理计划进行绩效分析和风险评估。</p> <p>1、研究分析</p> <p>宏观策略分析师和行业分析师在借鉴外部研究成果的基础上，开展宏观经济及政策分析、债券市场分析、行业及上市公司分析；定量分析师负责量化策略的研究、模型的构建、检验、维护和运行结果的报告。通过以上研究工作，为投资决策委员会及投资经理提供独立、统一的投资决策支持。</p> <p>2、投资决策</p> <p>投资决策委员会不定期召开会议，对宏观经济形势、利率趋势、证券市场走势等进行综合分析，确定资产管理计划下一阶段的资产配置；<b>审议</b>投资经理提交的投资计划以及其他涉及资产管理计划投资管理的重大问题。</p> <p>3、组合构建</p> <p>投资经理在投资决策委员会给定的资产配置比例范围内，结合资产管理计划有关投资品种、投资限制等规定完成投资组合的构建。</p> <p>.....</p> <p>5、风险与绩效评估</p> <p><b>风控部</b>对资产管理计划的投资行为进行合规性监控，对投资过程中存在的风险隐患进行风险提示，并就投资组合提出风险管理建议；定期和不定期对资产管理计划进行风险和绩效评估，对投资组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略提供相关报告。</p>
<p>六、投资策略</p> <p>(三) 投资管理的方法和标准</p> <p>2、公司债投资策略</p> <p>本资产管理计划利用安信证券的宏观经济分析框架和内部信用评级系统，.....</p>	<p>六、投资策略</p> <p>(三) 投资管理的方法和标准</p> <p>2、公司债投资策略</p> <p>本资产管理计划利用安信资管宏观经济分析框架和内部信用评级系统，.....</p>
<p>六、投资策略</p> <p>(三) 投资管理的方法和标准</p> <p><b>删除：</b></p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>国债期货可用于对债券组合久期进行管理，调整组合风险暴露。国债期货也可用来进行套保、期现、跨期、陡平等套利交易。</p>	
<p>七、投资限制</p> <p>为维护投资者的合法权益，本资产管理计划投资的投资限制为：</p> <p>.....</p> <p>(二) 权益类资产占总资产比例为0%~10%，持有可转债转股、可交换债换股所得的股票，转股后需在10个工作日内卖出。</p> <p><b>删除，并相应调整序号：</b></p> <p>(三) 商品及金融衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过20%或衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的20%；</p>	<p>七、投资限制</p> <p>为维护投资者的合法权益，本资产管理计划投资的投资限制为：</p> <p>.....</p> <p>(二) 权益类资产占总资产比例为0%~10%，持有可转债转股、可交换债换股所得的股票，转股/换股后需在其可交易之日起10个工作日内卖出。</p> <p><b>新增，并相应调整序号：</b></p> <p>(三)本资产管理计划投资于非公开发行公司债券市值合计不得超过资产管理计划资产总值的50%。</p> <p>(八)本资产管理计划所投资的资产支持证券和资产支持票据的优先级，须为银行间或沪深交易所挂牌交易，且基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权。</p>
<p>十、投资者在此同意并授权管理人在计划存续期间，为规避特定风险，经全体投资者同意后，投资于固定收益类资产的比例可以低于资产管理计划总资产80%，但不得持续6个月低于资产管理计划总资产80%。</p> <p>特定风险包括市场趋势性下跌风险、发生巨额或连续巨额退出、投资标的流动性风险等。</p>	<p>十、投资者在此同意并授权管理人在计划存续期间，为规避特定风险，投资于固定收益类资产的比例可以低于资产管理计划总资产80%，但不得持续6个月低于资产管理计划总资产80%。</p> <p>特定风险<b>主要指</b>市场趋势性风险(如管理人基于对股市、债市、衍生品市场风险的判断，调整资产配置比例)等。</p>
<p>十一、投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配</p> <p>本资产管理计划退出开放期内，其资产组合中7个工作日可变现资产的价值不低于本资产管理计划资产净值的10%。</p> <p>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、期货及期权合约以及同业存单，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。</p> <p>管理人通过综合考量本资产管理计划的收益及资产的流动性，根据本资产管理计划的开放期设置，动态调整高流动性资产的比例，应对投资者的退出申请。</p>	<p>十一、投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配</p> <p>本资产管理计划退出开放期内，其资产组合中7个工作日可变现资产的价值不低于本资产管理计划资产净值的10%，其<b>主动</b>投资于流动性受限资产的市值在退出开放期内合计不得超过本资产管理计划资产净值的20%。</p> <p>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、期货及期权合约以及同业存单，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。<b>流动性受限资产</b>，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)、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、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>

	管理人通过综合考量本资产管理计划的收益及资产的流动性，根据本资产管理计划的开放期设置，动态调整高流动性资产的比例，应对投资者的退出申请。
<b>第 14 部分 利益冲突及关联交易</b>	
<p>一、资产管理计划存在或可能存在利益冲突的情形</p> <p>全体投资者充分知悉并理解，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本资产管理计划在投资和运作过程中可能仍会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本资产管理计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本资产管理计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本资产管理计划，也可能使本资产管理计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。全体份额持有人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。</p> <p>此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本资产管理计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本资产管理计划的投资运作。全体份额持有人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。</p>	<p>一、资产管理计划存在或可能存在利益冲突的情形</p> <p>(一) 将资产管理计划资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、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或者其他关联交易事项；</p> <p>(二) 管理人及其附属机构以自有资金参与本资产管理计划；</p> <p>(三) 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资产管理计划；</p> <p>(三) 其他可能产生利益冲突的情形。</p> <p>全体投资者充分知悉、理解、同意并认可管理人开展上述事项并自愿承担相关投资风险。</p>
<p>二、利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容及披露频率</p> <p>(一) 利益冲突的处理方式</p> <p>.....</p> <p>管理人制定了利益冲突管理制度，按照内外部管控要求识别、报告、评估、解决利益冲突事项，包括采取相应的措施防范产生利益冲突；采取相应措施以确保管理人、管理人关联方及其员工不得因自己的利益导致投资者损失或使投资者处于不利地位。管理人运用受托资产从事上述利益冲突交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会、证券投资基金业协会的规定和合同约定的投资目标、投资策略，并遵循投资者利益优先原则，防范利益冲突。</p> <p>(二) 利益冲突的披露方式、披露内容以及披露频率</p> <p>管理人运用受托管理资产从事上述法律法规、监管规定允许的利​​益冲突交易的，将在交易发生后五个工作日内以公告的方式，及时、全面、客观地向托管人和投资者披露，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当向证券期货交易所报告。</p>	<p>二、利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容及披露频率</p> <p>(一) 利益冲突的处理方式</p> <p>.....</p> <p>管理人制定了内部控制和风险管理合规管理制度，按照内外部管控要求识别、报告、评估、解决利益冲突事项。管理人运用受托资产从事上述利益冲突交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会、证券投资基金业协会的规定和合同约定的投资目标、投资策略，并遵循投资者利益优先原则，防范利益冲突。</p> <p>(二) 利益冲突的披露方式、披露内容以及披露频率</p> <p>管理人运用受托管理资产从事上述法律法规、监管规定允许的利​​益冲突交易的，将在交易发生后及时以公告的方式，及时、全面、客观地向托管人和投资者披露，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，投资于证券期货还应当当向证券期货交易所报告。</p>
<p>三、资产管理计划的关联交易</p> <p>.....</p> <p>(二) 管理人已建立健全的关联交易审批机制和评估机制，运用受托管理资产从事关联交易的，应遵循投资者利益优先原则，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益；事后及时、全面、客观地向投资者和托管人进行披露。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。</p> <p>(三) 托管人承诺在本资产管理计划开始投资运作前向管理人提交托管人关联方名单，如本资产管理计划存续期内前述关联方名单发生变化的，托管人承诺及时书面告知管理人，托管人应对其提交的关联方名单的真实性、准确性、完整性等负责。管理人将按照托管人提交的关联方名单及其变化情况进行关联交易的控制，但管理人无义务对托管人提供的关联方名单的真实性、准确性、完整性等进行复核，亦无须承担责任。</p>	<p>三、资产管理计划的关联交易</p> <p>.....</p> <p>(二) 运用受托管理资产从事关联交易的，应遵循投资者利益优先原则，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益；事后及时、全面、客观地向投资者和托管人进行披露。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。</p> <p>(三) 托管人承诺在本资产管理计划开始投资运作前向管理人提交托管人关联方名单与关联证券（如有），如本资产管理计划存续期内前述关联方名单与关联证券（如有）发生变化的，托管人承诺及时书面告知管理人，托管人应对其提交的关联方名单与关联证券（如有）的真实性、准确性、完整性等负责。管理人将按照托管人提交的关联方名单与关联证券（如有）及其变化情况进行关联交易的控制，但管理人无义务对托管人提供的关联方名单的真实性、准确性、完整性等进行复核，亦无须承担责任。</p>
<b>第 15 部分 投资经理的制定与变更</b>	
<p>一、投资经理的指定</p> <p>本资产管理计划的投资经理由管理人指定；管理人确认本资产管理计划之投资经理不兼任管理人所管理的单一资产管理业务的投资经理。</p> <p>本资产管理计划的投资经理：张亚非，对外经济贸易大学金融学硕士，10年以上固定收益从业经验，2005年至今先后供职于北京农村商业银行、平安银行、安信证券从事固定收益投资交易工作。现任安信证券资产管理部固定收益投资总监。</p> <p>本资产管理计划的投资经理已取得基金从业资格，本资产管理计划的投资经理最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p>	<p>一、投资经理的指定</p> <p>本资产管理计划的投资经理由管理人指定。</p> <p>本资产管理计划的投资经理：竺印。</p> <p>竺印：中南财经政法大学会计学硕士，中国注册会计师，历任安信证券资产管理部债券交易员、信用研究员，多年债券研究与交易经验，现任安信证券资产管理有限公司投资经理。</p> <p>本资产管理计划的投资经理已取得基金从业资格，本资产管理计划的投资经理最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p>
<p>二、投资经理的变更</p> <p>管理人在更换投资经理时需提前 10 个工作日以公告等书面形式通知投资者。</p>	<p>二、投资经理的变更</p> <p>管理人在更换投资经理时需提前 1 个工作日以公告等书面形式通知投资者。</p>
<p>三、投资经理变更的，管理人应当对其进行离任审查，并自离任之日起三十个工作日内将审查报告报送中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会。</p>	<p>三、投资经理离任的，管理人应当对其进行离任审查，并自离任之日起三十个工作日内将审查报告报送中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会。</p>
<b>第 16 部分 资产管理计划的财产</b>	
	<p>一、资产管理计划财产的保管与处分</p> <p>增加：</p> <p>(五) 非因资产管理计划本身的债务或者法律法规规定的其他情形，不得查封、冻结、扣划或者强制执行资产管理计划财产。</p>
<p>二、资产管理计划财产相关账户的开立和管理</p> <p>(一) 资产管理计划托管账户、证券账户的开立</p> <p>托管人为本资产管理计划开立证券账户、托管账户以及其他相关账户。托管账户名称应当是“安信证券添添利 3 号集合资产管理计划”，证券账户名称应当是“安信证券—广发银行—安信证券添添利 3 号集合资产管理计划”（以实际开户名为准）。管理人应</p>	<p>二、资产管理计划财产相关账户的开立和管理</p> <p>(一) 资产管理计划托管账户、证券账户的开立</p> <p>托管人为本资产管理计划开立证券账户、托管账户以及其他相关账户。托管账户名称应当是“安信资管周周盈 1 号集合资产管理计划”，证券账户名称应当是“安信资管—广发银行—安信资管周周盈 1 号集合资产管理计划”（以实际开户名为准）。管</p>



配合托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。	理人应配合托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。
<b>第 17 部分 投资指令的发送、确认与执行</b>	
<p>一、交易清算授权</p> <p>管理人应向托管人提供预留印鉴和有权人（“授权人”）签字样本，事先书面通知（以下称“授权通知”）托管人有权发送投资指令的人员名单（“被授权人”）。授权通知中应包括被授权人的名单、权限、预留印鉴和签字样本，并注明相应的交易权限，规定管理人向托管人发送指令时托管人确认有权发送人员身份的方法。……</p>	<p>一、交易清算授权</p> <p>管理人应向托管人提供预留印鉴和有权人（“授权人”）签字样本，事先书面通知（以下称“授权通知”）托管人有权发送投资指令的人员名单（“被授权人”）。授权通知书为管理人向托管人在同一托管人项下的所有资产管理计划出具的统一授权，授权通知中应包括被授权人的名单、权限、预留印鉴和签字样本，并注明相应的交易权限，规定管理人向托管人发送指令时托管人确认有权发送人员身份的方法。……</p>
<p>三、投资指令的发送、确认及执行的时间与程序</p> <p>指令由“授权通知”确定的被授权人代表管理人用传真方式或其他托管人和管理人认可的方式向托管人发送。管理人有义务在发送指令后与托管人以录音电话的方式进行确认。……</p> <p>……</p> <p>托管人收到管理人发送的指令后，应对投资指令进行形式审查，验证指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本表面一致性相符，复核无误后依据本合同约定在规定期限内及时执行，不得延误。若存在异议或不符合，托管人立即与管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。托管人可以要求管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。</p> <p>……</p>	<p>三、投资指令的发送、确认及执行的时间与程序</p> <p>指令由“授权通知”确定的被授权人代表管理人用传真方式或其他托管人和管理人认可的方式向托管人发送。管理人有义务在发送指令后与托管人以录音电话或其他托管人和管理人认可的方式进行确认。……</p> <p>……</p> <p>托管人收到管理人发送的指令后，应对投资指令进行审查，验证指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本表面一致性相符，复核无误后依据本合同约定在规定期限内及时执行，不得延误。若存在异议或不符合，托管人立即与管理人指定人员进行电话或其他托管人和管理人认可的方式联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。托管人可以要求管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料（如有），以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。</p> <p>……</p>
<p>六、更换投资指令被授权人的程序</p> <p>管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少一个交易日，使用传真方式或其他管理人和托管人认可的方式向托管人发出由授权人签字和盖章的被授权人变更通知，并提供新被授权人签字样本，同时电话通知托管人，托管人收到变更通知当日通过电话向管理人确认。被授权人变更通知须载明新授权生效日期。被授权人变更通知自通知载明的生效时间开始生效。托管人收到通知的日期晚于通知载明的生效日期的，通知自托管人收到该通知时生效。管理人在以电话告知后五日内将被授权人变更通知的正本送交托管人。被授权人变更通知生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或新被授权人员超权限发送的指令，管理人不承担责任。</p>	<p>六、更换投资指令被授权人的程序</p> <p>管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少一个交易日，使用传真方式或其他管理人和托管人认可的方式向托管人发出由授权人签字和盖章的被授权人变更通知，并提供新被授权人签字样本，同时以电话或其他托管人和管理人认可的方式通知托管人，托管人收到变更通知当日通过电话或其他托管人和管理人认可的方式向管理人确认。被授权人变更通知须载明新授权生效日期。被授权人变更通知自通知载明的生效时间开始生效。托管人收到通知的日期晚于通知载明的生效日期的，通知自托管人收到该通知时生效。管理人在以电话或其他托管人和管理人认可的方式告知后五日内将被授权人变更通知的正本送交托管人。被授权人变更通知生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或新被授权人员超权限发送的指令，管理人不承担责任。</p>
<p>八、其他相关责任</p> <p>托管人正确执行管理人符合本合同规定、合法合规的投资指令，资产管理计划财产发生损失的，托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的投资指令而导致资产管理计划财产受损的，托管人应承担相应的责任，但银行托管账户余额不足或托管人如遇到不可抗力的情况除外。</p> <p>……</p>	<p>八、其他相关责任</p> <p>托管人正确执行管理人符合本合同规定、合法合规的投资指令，资产管理计划财产发生损失的，托管人不承担任何形式的责任，由责任主体承担相应职责。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因托管人原因未能及时或正确执行符合本合同规定、合法合规的投资指令而导致资产管理计划财产受损的，托管人应承担相应的责任，但银行托管账户余额不足或托管人如遇到不可抗力的情况除外。</p> <p>……</p>
<b>第 18 部分 越权交易</b>	
<p>三、托管人对管理人投资运作的投资监督</p> <p>（一）托管人对管理人的投资行为行使监督权。托管人根据本合同有关资产管理计划财产投资政策的约定，承诺对本资产管理计划项下投资事项进行监督。</p>	<p>三、托管人对管理人投资运作的投资监督</p> <p>（一）托管人对管理人的投资行为行使监督权。托管人根据本合同附件一《投资监督事项表》的约定，承诺对本资产管理计划项下投资事项进行监督。</p>
<b>第 19 部分 资产管理计划财产的估值和会计核算</b>	
<p>三、估值方法</p> <p>……</p> <p>（一）基金产品估值方法</p> <p>1、场外公募基金（包括托管在场外的交易型指数基金ETF、上市型开放式基金LOF）产品定期披露单位净值的，以估值日基金产品单位净值估值（以公开披露的净值或管理人盖章版净值函为准）；估值日基金净值未公布的，则按基金产品最近披露的净值估值。</p> <p>2、交易所基金（包括封闭基金场内交易的交易型指数基金ETF、上市型开放式基金LOF）按照其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值。</p> <p>3、货币市场基金按成本估值，每天按公布的估值日万份收益计提收益。</p>	<p>三、估值方法</p> <p>……</p> <p>（一）基金产品估值方法</p> <p>1、场外公募基金（包括托管在场外的交易型指数基金ETF、上市型开放式基金LOF）产品定期披露单位净值的，以估值日前一日基金产品单位净值估值（以公开披露的净值或管理人盖章版净值函为准）；估值日前一日基金净值未公布的，则按基金产品最近披露的净值估值。</p> <p>2、交易所基金（包括封闭基金场内交易的交易型指数基金ETF、上市型开放式基金LOF）按照其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值。</p> <p>3、摊余成本法货币市场基金按成本估值，每天按公布的估值日前一日万份收益计提收益。</p>
<p>（二）股票估值方法</p> <p>1、上市流通股票的估值方法</p> <p>上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。</p> <p>上市流通股估值日无交易的，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>上市流通股估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种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，可参考停牌股票的估值方法，调整最近交易日收盘价，确</p>	<p>（二）股票估值方法</p> <p>1、上市流通股票的估值方法</p> <p>上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。</p> <p>上市流通股估值日无交易的，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>上市流通股估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种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，可参考停牌股票的估值方法，调整最近交易日收盘</p>

<p>定公允价值进行估值。</p> <p>1、未上市股票的估值方法 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。 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股票的收盘价进行估值。 2、流通受限股票的估值方法 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值。 <math>FV=S \times (1-LoMD)</math> 其中： FV：估值日该流通受限股票的价值 S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值 LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣，折扣系数由中债公司提供。</p> <p>3、停牌股票的估值方法 停牌股票采用指数收益法估值，把停牌期间行业指数的涨跌幅视为停牌股的涨跌幅以确定当前公允价值，即参考两交易所的行业指数对停牌股票进行估值。 4、港股通投资上市流通的股票按估值日在港交所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。 港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等主要货币对人民币汇率的，原则上以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币中间价为准。</p>	<p>价，确定公允价值进行估值。</p> <p>停牌股票采用指数收益法估值，把停牌期间行业指数的涨跌幅视为停牌股的涨跌幅以确定当前公允价值，即参考两交易所的行业指数对停牌股票进行估值。 2、未上市股票的估值方法 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。 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股票的收盘价进行估值。 3、流通受限股票的估值方法 流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值。 <math>FV=S \times (1-LoMD)</math> 其中： FV：估值日该流通受限股票的价值 S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值 LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣，折扣系数由中债公司提供。</p>
<p>(三) 债券估值方法</p> <p>1、在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理： 对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权债券，选取中证指数行情提供的相应品种当日的估值净价。 对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权债券，选取中证指数行情提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。 对于在交易所市场上市交易的公募可转换债券、公募可交换债，选取每日收盘价作为估值全价。 对于在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定其公允价值。估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。 对于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计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值按成本估值。</p> <p>2、银行间市场交易的债券，按如下估值方式处理： 对于在银行间市场上不含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的估值净价。 对于在银行间市场上含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。对于含投资人回售权的债券，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。 对于银行间市场未上市，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>(三) 债券估值方法</p> <p>1、在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理： 对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权债券，选取中证指数行情提供的相应品种当日的估值净价。 对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权债券，选取中证指数行情提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。 对于在交易所上市的公募类实行全价交易的可转债、可交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。 对于在交易所市场上市净价交易的公募可交换债，选取每日收盘价作为估值净价。 对于在交易所市场挂牌转让的非公开发行债券，采用第三方机构（此处指中证指数有限公司）提供的估值价格确定公允价值；第三方机构无法提供估值价格时，采用估值技术确定公允价值。 对于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计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。 2、银行间市场交易的债券，按如下估值方式处理： 对于在银行间市场上不含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的估值净价。 对于在银行间市场上含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。对于含投资人回售权的债券，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。 对于银行间市场未上市，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，采用估值技术确定公允价值。 3、对于银行间市场发行的资产支持证券按中央国债登记结算公司提供的估值价进行估值。对于在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用第三方机构（此处指中证指数有限公司）提供的估值价格确定公允价值；第三方机构无法提供估值价格时，采用估值技术确定公允价值。 4、交易所违约债的估值按中证提供的特殊证券估值方法进行估值，银行间的违约债按中债提供的特殊证券估值方法进行估值。</p>
<p>删除： (九) 国债期货的估值 国债期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。</p>	
<p>五、估值程序 ..... 由于证券期货交易所、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。</p>	<p>五、估值程序 ..... 由于证券期货交易所、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，由证券期货交易所、注册登记机构承担相应职责。</p>
<p>第20部分 资产管理计划的费用与税收</p>	

<p>三、管理人提取业绩报酬</p> <p>(一) 业绩报酬的计提原则</p> <p>若符合业绩报酬提取条件, 管理人于本资产管理计划分红日、投资者退出日和资产管理计划终止日提取业绩报酬。如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率小于或等于业绩报酬计提基准X%, 管理人提取业绩报酬; 如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率大于业绩报酬计提基准X%, 管理人将对超过部分的收益提取60%作为业绩报酬。</p> <p>管理人于每个开放期前公布下一个运作周期的业绩报酬计提基准X%具体数值。资产管理计划第一个运作周期内的业绩报酬计提基准X%具体数值以管理人发行公告为准。</p> <p>业绩报酬计提基准不是预期收益和保证收益率, 不构成管理人对委托财产的任何承诺或担保, 投资者仍可能面临实际收益率达不到业绩报酬计提基准甚至本金受损的风险。</p>	<p>三、管理人提取业绩报酬</p> <p>(一) 业绩报酬的计提原则</p> <p>若符合业绩报酬提取条件, 管理人于本资产管理计划分红日、投资者退出日和资产管理计划终止日提取业绩报酬。如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率小于业绩报酬计提基准【X】%, 管理人提取业绩报酬; 如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率等于或大于业绩报酬计提基准【X】%, 管理人将对超过部分的收益提取50%作为业绩报酬。</p> <p>全体投资者知悉并认可: 管理人将于本合同生效日之前通过公告形式披露业绩报酬计提基准【X】%具体数值; 本资产管理计划运作期间, 管理人有权根据运作情况于开放期前调整业绩报酬计提基准, 如投资者不同意调整业绩报酬计提基准, 可在开放期选择退出; 如投资者未在开放期选择退出, 则视为投资者同意以管理人公告的业绩报酬计提基准作为新的业绩报酬计提基准。届时以管理人公告为准。</p>
<p>(三) 业绩报酬的提取方法</p> <p>业绩报酬提取日为本资产管理计划分红日、投资者退出日或本资产管理计划终止日。以上一个发生业绩报酬提取的业绩报酬提取日(如上一个发生业绩报酬提取的业绩报酬提取日不存在, 则初始募集期参与的为本资产管理计划成立日、存续期参与的为参与当日)至本次业绩报酬提取日期间的年化收益率, 作为提取业绩报酬的基准。</p> <p>区间年化收益率计算公式为:</p> $R = \frac{V_1 - V_0}{V_0^*} \div A$ <p>R为区间年化收益率;</p> <p><math>V_1</math>为投资者本次业绩报酬提取日的份额累计净值;</p> <p><math>V_0</math>为投资者上一个业绩报酬提取日的份额累计净值;</p> <p><math>V_0^*</math>为投资者上一个业绩报酬提取日的份额净值;</p> <p>A为投资者上一个业绩报酬提取日到本次业绩报酬提取日的年限, 若上一个业绩报酬提取日到本次业绩报酬提取日的天数为T, 则<math>A = \frac{T}{365}</math>。</p> <p>业绩报酬比例计算方法如下:</p> $H = P \times (R - X\%) \times 60\% \times A$ <p>H为投资者每笔参与份额应提取的业绩报酬;</p> <p>P为每笔参与份额在上一个业绩报酬提取日的资产净值。</p> <p>管理人负责计算业绩报酬, 托管人不承担复核的责任, 管理人于每个业绩报酬提取日提取业绩报酬, 由托管人于业绩报酬提取日后5个工作日内按照管理人指令从本资产管理计划资产中一次性支取, 若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 支付日期顺延。</p> <p>风险提示: 管理人按照国家法律法规、监管规定及本合同的约定提取业绩报酬后, 即使投资者赎回时净值有所下跌, 则该部分已提取的业绩报酬将不退还投资者。</p>	<p>(三) 业绩报酬的提取方法</p> <p>业绩报酬提取日为本资产管理计划分红日、投资者退出日或本资产管理计划终止日。如果投资者在持有期内存在多个业绩报酬计提基准周期的, 则每个业绩报酬计提基准周期以各自对应的年化收益率计算业绩报酬, 并按照实际值累加计算, 作为实际计提的业绩报酬。</p> $H = \sum \left[ \left( \frac{V_1 - V_0}{V_0^*} \div A - X\% \right) \times 50\% \times A \times P \right]$ <p>H为应提取的业绩报酬;</p> <p><math>V_1</math>为投资者每个业绩报酬计提基准周期的期末份额累计净值;</p> <p><math>V_0</math>为投资者每个业绩报酬计提基准周期的期初份额累计净值。其中, 首个业绩报酬计提基准周期的期初日: 为上一个发生业绩报酬提取的业绩报酬提取日, 如上一个发生业绩报酬提取的业绩报酬提取日不存在, 则原“安信证券添利3号集合资产管理计划”的存量份额为本合同生效之日、存续期参与的为参与当日, 下同;</p> <p><math>V_0^*</math>为投资者每个业绩报酬计提基准周期的期初份额净值;</p> <p>A为投资者每个业绩报酬计提基准周期的的年限, 若该业绩报酬计提周期的天数为T, 则<math>A = \frac{T}{365}</math>;</p> <p>P为投资者在每个业绩报酬计提基准周期的期初资产净值。</p> <p>管理人负责计算业绩报酬, 托管人不承担复核的责任, 管理人于每个业绩报酬提取日提取业绩报酬, 由托管人于业绩报酬提取日后5个工作日内按照管理人指令从本资产管理计划资产中一次性支取, 若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 支付日期顺延。</p> <p>风险提示:</p> <p>(1) 业绩报酬计提基准不是预期收益和保证收益率, 不构成管理人对委托财产的任何承诺或担保, 投资者仍可能面临实际收益率达不到业绩报酬计提基准甚至本金受损的风险。</p> <p>(2) 管理人按照国家法律法规、监管规定及本合同的约定提取业绩报酬后, 即使投资者赎回时净值有所下跌, 则该部分已提取的业绩报酬将不退还投资者。</p>
<p>第 21 部分 资产管理计划的收益分配</p>	
<p>二、收益分配原则</p> <p>(一) 每一资产管理计划份额享有同等分配权;</p> <p>(二) 本资产管理计划收益分配方式为现金分红;</p> <p>.....</p>	<p>二、收益分配原则</p> <p>(一) 每一资产管理计划份额享有同等分配权;</p> <p>(二) 本资产管理计划收益分配方式为现金分红或红利再投资, 投资者未做选择默认现金分红, 投资者可以在权益登记日前修改分红方式。选择红利再投资方式的, 分红资金按除息日的单位净值转成相应的集合计划份额;</p> <p>.....</p>
<p>第 22 部分 信息披露与报告</p>	
<p>二、向投资者提供的报告</p> <p>(一) 资产管理计划份额净值报告</p> <p>披露方式: 通过管理人网站向本资产管理计划的份额持有人公告。</p>	<p>二、向投资者提供的报告</p> <p>(一) 资产管理计划份额净值报告</p> <p>披露方式: 通过管理人网站向本资产管理计划的份额持有人披露。</p>
<p>第 23 部分 风险揭示</p>	
<p>一、一般风险揭示</p> <p>(一) 本金损失风险</p> <p>.....</p> <p>本资产管理计划属于 R3 (中风险) 投资品种, 适合专业投资者及风险识别、评估、承受能力为 C3 (稳健型)、C4 (积极型)、C5 (激进型) 的普通合格投资者。</p>	<p>一、一般风险揭示</p> <p>(一) 本金损失风险</p> <p>.....</p> <p>本资产管理计划属于 R2 (中低风险) 投资品种, 适合专业投资者及风险识别、评估、承受能力为 C2 (谨慎型)、C3 (稳健型)、C4 (积极型)、C5 (激进型) 的普通合格投资者。</p>
<p>一、一般风险揭示</p> <p>(二) 市场风险</p> <p>删除:</p> <p>6、衍生品风险</p>	

<p>(1) 无论管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资, 由于金融衍生品的高杠杆性等特征, 对金融衍生品的投资无论在何种情况下均具有较高的风险。</p> <p>(2) 管理人并非期货交易协会会员, 以期货交易协会会员(即期货经纪人)之客户的身份参与期货交易, 可能存在因期货经纪人违规经营、管理疏忽、资金能力出现问题等原因而导致本资产管理计划蒙受损失。</p> <p>(3) 期货交易所实行保证金制度、当日无负债结算制度、涨跌停板制度、持仓限额和大户持仓报告制度、风险准备金制度以及国务院期货监督管理机构规定的其他风险管理制度。本资产管理计划可能因保证金不足而被采取限制开仓、强制平仓, 进而可能给本资产管理计划造成重大损失; 本资产管理计划所委托的交易会员除接受本资产管理计划委托外, 还可能同时接受其他主体的委托, 本资产管理计划所委托的交易会员发生保证金不足时将被采取限制开仓、强制平仓等措施, 而这种不足不一定是本资产管理计划的保证金不足造成的, 还可能是上述交易所会员进行其他主体的委托操作所造成的, 但即便如此本资产管理计划也可能因此受到重大损失; 为及时缴纳保证金, 本资产管理计划可能紧急变现部分资产管理计划财产, 在上述情况下, 该部分资产管理计划财产的变现可能并非以最优价格进行, 从而造成本资产管理计划的损失。本资产管理计划及本资产管理计划所委托的交易会员可能被实行强制结算, 一旦本资产管理计划或本资产管理计划所委托的交易会员被强制结算、可能给本资产管理计划财产造成损失。</p> <p>(4) 金融衍生品具有高杠杆性的特征, 当出现不利行情时, 本资产管理计划所投资期货合约品种微小的变动就可能使本资产管理计划遭受较大损失。</p> <p>(5) 在市场剧烈变化的情况下, 管理人可能难以或无法将持有的未平仓合约平仓。这类情况将导致保证金有可能无法弥补全部损失, 本资产管理计划必须承担由此导致的全部损失。同时本资产管理计划将面临期货合约无法当天平仓而价格变动的风险。</p> <p>(6) 相关交易所可能对交易品种的套期保值或套利实行额度管理, 本资产管理计划如拟进行某交易品种的套期保值或套利交易的, 可能因无法申请额度或无法及时获得额度而不能开展相关交易。</p> <p>(7) 相比于其他交易品种, 金融衍生品的投资交易可能更加频繁, 频繁操作将可能增加管理人、期货经纪人等相关方操作失误的可能性, 存在操作风险。</p>	
<p>二、本资产管理计划特有风险</p> <p>(四) 无法退出风险</p> <p>本资产管理计划除开放期第一个工作日外, 存续期其余时间不办理退出业务, 投资者面临无法退出的风险。</p>	<p>二、本资产管理计划特有风险</p> <p>新增:</p> <p>(四) 资产管理计划运营事项涉及风险</p> <p>本资产管理计划由安信证券股份有限公司提供投资运营管理、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务和支持, 因安信证券股份有限公司经营风险、技术系统故障、操作失误等, 可能使资产管理计划运营事项发生差错, 从而为本集合资产管理计划的运营带来风险。</p> <p>(五) 委托募集和参与涉及风险</p> <p>管理人可委托在中国证监会取得基金销售业务资格的基金业协会会员机构代销本集合资产管理计划, 代销机构可能存在违法违规地向不特定对象宣传、商业贿赂、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作等行为, 导致投资者合法权益受损。</p>
<p>二、本资产管理计划特有风险</p> <p>(八) 本资产管理计划收取业绩报酬, 可能导致本资产管理计划投资者在退出或分红、或计划终止时实际获取的净值或分红金额低于公布的净值或分红金额。</p>	<p>二、本资产管理计划特有风险</p> <p>(六) 无法退出风险</p> <p>本资产管理计划除开放期和临时开放期外, 存续期其余时间不办理退出业务, 投资者面临无法退出的风险。</p> <p>(七) 强制退出风险</p> <p>投资者部分退出资产管理计划的, 单笔退出最低份额为 1 万份, 其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时, 需要退出资产管理计划的, 应当一次性全部退出。投资者没有一次性申请全部退出的, 管理人将在退出申请确认日对该投资者所持有的全部份额做退出确认, 投资者将面临全部份额被退出的风险。</p>
<p>二、本资产管理计划特有风险</p> <p>(八) 本资产管理计划收取业绩报酬, 可能导致本资产管理计划投资者在退出或分红、或计划终止时实际获取的净值或分红金额低于公布的净值或分红金额。</p>	<p>二、本资产管理计划特有风险</p> <p>(十一) 收取业绩报酬的风险</p> <p>本资产管理计划收取业绩报酬, 可能导致本资产管理计划投资者在退出或分红、或计划终止时实际获取的净值或分红金额低于公布的净值或分红金额。管理人按照国家法律法规、监管规定及本合同的约定提取业绩报酬后, 即使投资者赎回时净值有所下跌, 则该部分已提取的业绩报酬将不退还投资者。业绩报酬计提基准不是预期收益和保证收益率, 不构成管理人对委托财产的任何承诺或担保, 投资者仍可能面临实际收益率达不到业绩报酬计提基准甚至本金受损的风险。</p> <p>本资产管理计划运作期间, 管理人有权根据运作情况于开放期前调整业绩报酬计提基准, 如投资者不同意调整业绩报酬计提基准, 可在开放期选择退出; 如投资者未在开放期选择退出, 则视为投资者同意以管理人公告的业绩报酬计提基准作为新的业绩报酬计提基准。投资者面临业绩报酬计提基准调整的风险。</p> <p>(十二) 通过第三方销售平台投资开放式基金的风险</p> <p>本资产管理计划可以通过第三方销售平台投资开放式基金, 相关数据的取得均依</p>

<p>二、本资产管理计划特有风险</p> <p>删除：</p> <p>（十四）国债期货投资风险</p> <p>1、基差风险</p> <p>标的价格与金融期货价格的差值被称为基差。在金融期货交易中因基差波动的不确定性而导致的风险被称为基差风险。若金融期货合约与现货合约价格差的波动超过正常范围，将可能导致该业务特定策略组合在部分时间点上价值产生不利方向的波动。另外，因存在基差风险，在进行金融期货合约展期的过程中，组合资产可能因金融期货合约之间价差的异常变动而遭受展期风险。</p> <p>2、合约品种差异造成的风险</p> <p>金融期货不同合约之间价格差的波动或超过正常范围，将可能导致该业务特定策略组合在部分时间点上价值产生不利方向的波动。</p> <p>3、金融期货交易中，标的物风险是由于投资组合与金融期货的标的结构不完全一致，导致投资组合特定风险无法完全锁定所带来的风险。</p> <p>4、流动性风险</p> <p>金融期货投资面临的流动性风险较大，主要包括流通量风险和无法缴足保证金的资金流动性风险：（1）流通量风险是指无法及时以合理价格建立或了结头寸的风险，这种风险在市况急剧走向某个极端或因进行了某种特殊交易但不能如愿处理资产时容易产生；（2）无法缴足保证金的资金流动性风险指当金融期货业务支付现金的义务大于投资组合现金头寸，且投资组合无力在规定时间内补足保证金而导致基金持有头寸面临强制平仓的风险。需要特别注意，国债期货采用梯度提高保证金的制度，越临近交割日，保证金比例要求越高。</p> <p>5、交易对手风险</p> <p>金融期货的对手方风险来自于两方面：（1）对手方风险：投资于金融期货，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝因所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金资产遭受损失。（2）连带风险：为资产管理计划资产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资人出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，资产管理计划资产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。</p> <p>6、交割风险</p> <p>目前中金所国债期货业务采用实物交割，其交割风险主要有：（1）对于国债期货交易的买方，在临近交割期由于融资成本提高而导致交割成本提高带来的损失。（2）对于国债期货交易的卖方，在临近交割期由于最便宜可交割券（以下简称“CTD”）流动性不足而导致CTD券价格升高或者被迫使用次优券交割带来的损失。（3）由于交割违约产生的损失。若国债期货的卖方未能在规定期限内如数交付可交割国债或者买方未能在规定期限内如数缴纳交割货款，就会构成交割违约，需按照中金所规定的标准支付补偿金和惩罚性违约金。</p> <p>7、杠杆风险：因期货采用保证金交易而存在杠杆，管理人在对委托财产的管理中充分利用了这一特性，委托财产可能因此产生更大的收益波动。</p> <p>8、盯市结算风险：期货采取保证金交易，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。如保证金不足，又未能在规定的时间内补足，按规定保证金账户将被强制平仓，从而导致超出预期的损失。</p> <p>9、极端市场风险：管理人虽然持有与保证金对等数量的现金用于防范因市场持续、快速下跌或剧烈波动而引发盯市结算风险，但在市场出现极端行情时，委托财产仍可能因此遭受损失。</p> <p>10、连带风险：为委托财产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资人出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，委托财产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。</p>	<p>限于第三方销售平台，可能存在第三方销售平台操作风险、委托财产被挪用、开放式基金认（申）购份额难以核对等风险。</p>
	<p>二、本资产管理计划特有风险</p> <p>新增：</p> <p>（十八）永续债投资风险</p> <p>1、永续债没有约定债务偿还期限且条款设置可能较为灵活，融资人有权无限递延偿还本金及利息。这一特点可能导致永续债流动性低从而增大变现难度，本资产管理计划如无法及时变现所投资的永续债，导致在开放期不足以支付投资者退出款项，投资者将可能面临无法及时退出的风险。</p> <p>2、永续债赋予发行人延期选择权及赎回选择权，同时还可设置利息递延支付条款，投资永续债面临本金及收益存在较大不确定性的风险。</p> <p>永续债一般设有利率重置条款，当债券行权日，如果发行人不赎回或是选择延期，债券票面利率往往会重置，如重置后带来票面利率的提升，将增加发行人财务负担，若发行人无法付息，投资者面临无法获得利息甚至收回本金的风险。</p>
<p>二、本资产管理计划特有风险</p> <p>（十八）资产支持证券/资产支持票据的投资风险</p> <p>1、主体和信用风险</p> <p>.....</p>	<p>二、本资产管理计划特有风险</p> <p>（十八）资产支持证券/资产支持票据的投资风险</p> <p>1、主体和信用风险</p> <p>.....</p>

<p>(3) 保证人信用风险</p> <p>若保证人未按相关担保协议的规定提供相应担保,则可能对优先级资产支持证券的本金和预期收益支付带来不利影响。</p> <p>2、与资产支持证券相关的风险</p> <p>(1) 评级风险</p> <p>评级机构对资产支持证券的评级不是购买、出售或持有资产支持证券的建议,而仅是对资产支持证券预期收益和/或本金偿付的可能性作出的判断,不能保证资产支持证券的评级将一直保持在该等级,评级机构可能会根据未来具体情况撤销资产支持证券的评级。评级机构撤销或降低资产支持证券的评级可能对其价值带来负面影响。</p> <p>(2) 专项计划提前终止的风险</p> <p>交易文件规定,专项计划进入加速清偿程序或发生违约事件的,资产支持证券提前到期的,原始权益人应按照《资产买卖协议》的约定回购剩余基础资产。专项计划的提前终止可能导致投资者所持有的优先级资产支持证券提前到期,给投资者带来风险。</p> <p>(3) 流动性风险</p> <p>资产支持证券将在深交所综合协议交易平台的技术支持下进行转让,若该交易系统不能满足投资者的活跃交易要求、或资产支持证券交易本身不够活跃,则资产支持证券存在因流动性不足而导致投资者无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券的风险。</p> <p>(4) 现金流分配机制风险</p> <p>专项计划如果采用了优先级/次级产品结构化分层的增信措施,在每期偿付的资金确认日,如果当期从监管账户收到的现金款项未能全额兑付优先级资产支持证券预期应付本金和收益时,由计划管理人使用专项计划账户中次级资产支持证券占有的现金流进行分级支持,如该支持无法成功实现,可能会对优先级资产支持证券预期应付本金和收益的兑付造成风险。</p> <p>3、与专项计划管理相关的风险</p> <p>(1) 计划管理人违规风险</p> <p>在专项计划存续期间,计划管理人如出现严重违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的行为,计划管理人可能会被取消资格,监管部门也可能对资产支持证券采取暂停和终止转让服务等处理措施,从而可能给投资者带来风险。</p> <p>(2) 监管人、托管人违规风险</p> <p>在专项计划存续期间,监管人对监管账户进行监督管理,并根据专项计划文件的约定负责将监管账户中的资金向专项计划账户中进行划转。若监管银行出现违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的行为,可能会影响资产支持证券投资者按时、足额获得本金和预期收益。</p>	<p>(3) 保证人信用风险</p> <p>若保证人未按相关担保协议的规定提供相应担保,则可能对优先级资产支持证券/资产支持票据的本金和预期收益支付带来不利影响。</p> <p>2、与资产支持证券相关的风险</p> <p>(1) 评级风险</p> <p>评级机构对资产支持证券/资产支持票据的评级不是购买、出售或持有资产支持证券/资产支持票据的建议,而仅是对资产支持证券/资产支持票据预期收益和/或本金偿付的可能性作出的判断,不能保证资产支持证券/资产支持票据的评级将一直保持在该等级,评级机构可能会根据未来具体情况撤销资产支持证券/资产支持票据的评级。评级机构撤销或降低资产支持证券/资产支持票据的评级可能对其价值带来负面影响。</p> <p>(2) 专项计划提前终止的风险</p> <p>交易文件规定,专项计划进入加速清偿程序或发生违约事件的,资产支持证券/资产支持票据提前到期的,原始权益人应按照《资产买卖协议》的约定回购剩余基础资产。专项计划的提前终止可能导致投资者所持有的优先级资产支持证券/资产支持票据提前到期,给投资者带来风险。</p> <p>(3) 流动性风险</p> <p>资产支持证券/资产支持票据将在各自所属的交易平台的技术支持下进行转让,若该交易系统不能满足投资者的活跃交易要求、或资产支持证券/资产支持票据交易本身不够活跃,则资产支持证券/资产支持票据存在因流动性不足而导致投资者无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券/资产支持票据的风险。</p> <p>(4) 现金流分配机制风险</p> <p>专项计划如果采用了优先级/次级产品结构化分层的增信措施,在每期偿付的资金确认日,如果当期从监管账户收到的现金款项未能全额兑付优先级资产支持证券/资产支持票据预期应付本金和收益时,由计划管理人使用专项计划账户中次级资产支持证券/资产支持票据占有的现金流进行分级支持,如该支持无法成功实现,可能会对优先级资产支持证券/资产支持票据预期应付本金和收益的兑付造成风险。</p> <p>3、与专项计划管理相关的风险</p> <p>(3) 计划管理人违规风险</p> <p>在专项计划存续期间,计划管理人如出现严重违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的行为,计划管理人可能会被取消资格,监管部门也可能对资产支持证券/资产支持票据采取暂停和终止转让服务等处理措施,从而可能给投资者带来风险。</p> <p>(4) 监管人、托管人违规风险</p> <p>在专项计划存续期间,监管人对监管账户进行监督管理,并根据专项计划文件的约定负责将监管账户中的资金向专项计划账户中进行划转。若监管银行出现违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的行为,可能会影响资产支持证券/资产支持票据投资者按时、足额获得本金和预期收益。</p>
<p><b>第 24 部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</b></p>	<p>二、本资产管理计划特有风险</p> <p>新增:</p> <p>(二十) 特定情形下投资固定收益类资产低于法定比例的风险</p> <p>在本资产管理计划存续期间,为规避特定风险,本资产管理计划投资于固定收益类资产的比例可以低于资产管理计划总资产 80%,但不得持续 6 个月低于上述比例。特定风险包括市场趋势性风险(如管理人基于对股市、债市、衍生品市场风险的判断等调整资产配置比例)等。</p>
<p>一、资产管理合同变更的情形</p> <p>(四) 本合同的变更满足法律法规要求的资产管理计划成立要件后,本合同变更生效。自合同变更生效之日起,变更后的内容即成为本合同组成部分。</p>	<p>二、资产管理合同变更的情形</p> <p>(四) 本合同的变更满足法律法规要求的,本合同变更生效。自合同变更生效之日起,变更后的内容即成为本合同组成部分。</p>
<p><b>第 25 部分 违约责任</b></p> <p>三、管理人对交给其他机构负责清算交收的资产管理计划资产及其收益,因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给资产管理计划资产造成的损失等。</p>	<p>三、管理人对交给其他机构负责清算交收的资产管理计划资产及其收益,因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给资产管理计划资产造成的损失等,由该等机构承担责任。</p>
<p><b>第 27 部分 资产管理合同的效力</b></p>	
<p>一、合同签署的方式</p> <p>资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人的,资产管理合同自投资者、管理人和托管人加盖公章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章/以电子合同、电子签名签署之日起成立;投资者为自然人的,资产管理合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章/以电子合同、电子签名签署之日起成立。</p>	<p>一、合同签署的方式</p> <p>资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人的,资产管理合同自投资者、管理人和托管人加盖公章/合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章/以电子合同、电子签名签署之日起成立;投资者为自然人的,资产管理合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章/合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章/以电子合同、电子签名签署之日起成立。</p>
<p>三、合同的有效期限</p> <p>本资产管理计划的存续期限为自资产管理计划成立之日起的 5 年,符合本合同约定的条件下,本合同可提前终止或展期。本资产管理计划终止,本合同终止,终止日以管理人公告为准但合同项下有关清算、违约责任、争议解决的条款仍然有效。</p> <p>四、合同的组成</p> <p>《安信证券添添利 3 号集合资产管理计划说明书》是管理人对本资产管理计划重要</p>	<p>三、合同的有效期限</p> <p>本资产管理计划的存续期限为自资产管理计划成立之日起的 10 年,符合本合同约定的条件下,本合同可提前终止或展期。本资产管理计划终止,本合同终止,终止日以管理人公告为准但合同项下有关清算、违约责任、争议解决的条款仍然有效。</p> <p>四、合同的组成</p> <p>《安信资管周周盈 1 号集合资产管理计划说明书》是管理人对本资产管理计划重</p>

事项的说明，是本合同重要附件，与合同具有同等法律效力。	要事项的说明，是本合同重要附件，与合同具有同等法律效力。									
<p>第 28 部分 或有事件</p>	<p><b>删除本章节：</b></p> <p>根据相关法律法规的规定，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公司。</p> <p>投资者、托管人在此同意，如果或有事件发生，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转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更与投资者、托管人另行签订专项协议。但管理人应及时将此项变更书面通知托管人，并以管理人网站公告的形式通告投资者。</p> <p>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。</p> <p>管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。</p>									
<p>第 28 部分 其他事项</p>	<p><b>增加：</b></p> <p>本合同正本壹式伍份，管理人、托管人各执壹份，其余按照有关监管部门的要求备案，经签署每份均具有同等法律效力。</p>									
<p>附件一：投资监督事项表</p>	<p><b>新增：</b></p>									
	<table border="1"> <thead> <tr> <th data-bbox="798 649 853 940">交易 监 控 合 规 表 序 号</th> <th data-bbox="853 649 933 940">项目</th> <th data-bbox="933 649 1439 940">监控内容</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td data-bbox="798 940 853 1321">1</td> <td data-bbox="853 940 933 1321">监控投资范围</td> <td data-bbox="933 940 1439 1321"> <p>(1) 固定收益类资产：银行存款（包括但不限于银行活期存款、银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、国债、央行票据、地方政府债、金融债（含次级债、混合资本债、政策性银行债）、公司债（含非公开发行）、企业债（含非公开发行）、项目收益债、专项债券、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、非公开定向债务融资工具、资产支持证券（ABS）优先级、资产支持票据（ABN）优先级、可转债、分离交易可转债、可交换债、永续债、债券正回购、债券逆回购以及符合《指导意见》规定的其他标准化债权类资产。</p> <p>(2) 权益类资产：本资产管理计划可持有可转债转股、可交换债换股所得的股票，但不可直接从二级市场上买入股票。</p> <p>(3) 公开募集证券投资基金：公开募集债券型证券投资基金和公开募集货币市场基金。</p> </td> </tr> <tr> <td data-bbox="798 1321 853 1962">2</td> <td data-bbox="853 1321 933 1962">监控比例及限制</td> <td data-bbox="933 1321 1439 1962"> <p>为维护投资者的合法权益，本资产管理计划投资的投资限制为：</p> <p>1、本资产管理计划投资固定收益类资产市值占资产管理计划总资产的比例不低于 80%。</p> <p>2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为 0%~10%，持有可转债转股、可交换债换股所得的股票，转股/换股后需在其可交易之日起 10 个工作日内卖出。</p> <p>3、本资产管理计划投资于公募基金的市值占资产管理计划资产总值的比例不超过 80%。</p> <p>4、本资产管理计划投资于非公开发行公司债券市值合计不得超过资产管理计划资产总值的 50%。</p> <p>5、本资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 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>6、本资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%。</p> <p>7、本资产管理计划不得投资于本机构管理的其他资产管理计划。</p> <p>8、本资产管理计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过资产管理计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>9、本资产管理计划所投资的资产支持证券和资产支持票据的优先级，须为银行间或沪深交易所挂牌交易，且基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权。</p> </td> </tr> </tbody> </table>	交易 监 控 合 规 表 序 号	项目	监控内容	1	监控投资范围	<p>(1) 固定收益类资产：银行存款（包括但不限于银行活期存款、银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、国债、央行票据、地方政府债、金融债（含次级债、混合资本债、政策性银行债）、公司债（含非公开发行）、企业债（含非公开发行）、项目收益债、专项债券、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、非公开定向债务融资工具、资产支持证券（ABS）优先级、资产支持票据（ABN）优先级、可转债、分离交易可转债、可交换债、永续债、债券正回购、债券逆回购以及符合《指导意见》规定的其他标准化债权类资产。</p> <p>(2) 权益类资产：本资产管理计划可持有可转债转股、可交换债换股所得的股票，但不可直接从二级市场上买入股票。</p> <p>(3) 公开募集证券投资基金：公开募集债券型证券投资基金和公开募集货币市场基金。</p>	2	监控比例及限制	<p>为维护投资者的合法权益，本资产管理计划投资的投资限制为：</p> <p>1、本资产管理计划投资固定收益类资产市值占资产管理计划总资产的比例不低于 80%。</p> <p>2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为 0%~10%，持有可转债转股、可交换债换股所得的股票，转股/换股后需在其可交易之日起 10 个工作日内卖出。</p> <p>3、本资产管理计划投资于公募基金的市值占资产管理计划资产总值的比例不超过 80%。</p> <p>4、本资产管理计划投资于非公开发行公司债券市值合计不得超过资产管理计划资产总值的 50%。</p> <p>5、本资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 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>6、本资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%。</p> <p>7、本资产管理计划不得投资于本机构管理的其他资产管理计划。</p> <p>8、本资产管理计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过资产管理计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>9、本资产管理计划所投资的资产支持证券和资产支持票据的优先级，须为银行间或沪深交易所挂牌交易，且基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权。</p>
交易 监 控 合 规 表 序 号	项目	监控内容								
1	监控投资范围	<p>(1) 固定收益类资产：银行存款（包括但不限于银行活期存款、银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、国债、央行票据、地方政府债、金融债（含次级债、混合资本债、政策性银行债）、公司债（含非公开发行）、企业债（含非公开发行）、项目收益债、专项债券、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、非公开定向债务融资工具、资产支持证券（ABS）优先级、资产支持票据（ABN）优先级、可转债、分离交易可转债、可交换债、永续债、债券正回购、债券逆回购以及符合《指导意见》规定的其他标准化债权类资产。</p> <p>(2) 权益类资产：本资产管理计划可持有可转债转股、可交换债换股所得的股票，但不可直接从二级市场上买入股票。</p> <p>(3) 公开募集证券投资基金：公开募集债券型证券投资基金和公开募集货币市场基金。</p>								
2	监控比例及限制	<p>为维护投资者的合法权益，本资产管理计划投资的投资限制为：</p> <p>1、本资产管理计划投资固定收益类资产市值占资产管理计划总资产的比例不低于 80%。</p> <p>2、权益类资产占资产管理计划总资产的比例为 0%~10%，持有可转债转股、可交换债换股所得的股票，转股/换股后需在其可交易之日起 10 个工作日内卖出。</p> <p>3、本资产管理计划投资于公募基金的市值占资产管理计划资产总值的比例不超过 80%。</p> <p>4、本资产管理计划投资于非公开发行公司债券市值合计不得超过资产管理计划资产总值的 50%。</p> <p>5、本资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 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>6、本资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%。</p> <p>7、本资产管理计划不得投资于本机构管理的其他资产管理计划。</p> <p>8、本资产管理计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过资产管理计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>9、本资产管理计划所投资的资产支持证券和资产支持票据的优先级，须为银行间或沪深交易所挂牌交易，且基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权。</p>								

附件二

## 关于安信证券添添利 3 号集合资产管理计划合同变更的 回复意见函

本委托人  同意 /  不同意安信证券资产管理有限公司于 2022 年 9 月 2 日发布的《关于安信证券添添利 3 号集合资产管理计划合同变更的公告》中有关安信证券添添利 3 号集合资产管理计划合同变更相关事项。

特此函复。

委托人：

证件号码：

手机号码：

日期：

注：委托人在签署完毕后，请拍照或扫描发送至邮箱：[axzg@essence.com.cn](mailto:axzg@essence.com.cn)。