关于华鑫鑫国2号集合资产管理计划资产管理合同变更的征询意见函及临时开放期设置公告

尊敬的投资者：

由华鑫证券有限责任公司（以下简称“我司”）管理的“华鑫鑫国2号集合资产管理计划”成立于2020年3月3日。为给投资者提供更专业的资产管理服务，我司拟对《华鑫鑫国2号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXXG-2020第1-1号）的“重要提示部分、声明与承诺、管理人托管人权利与义务、产品存续期限、产品参与退出与转让、投资限制及投资程序、越权交易的处理程序、利益冲突及关联交易、投资经理的指定与变更、估值条款、收益分配的执行、风险揭示、合同的变更、终止与清算”等部分条款及事项进行变更和说明，《华鑫鑫国2号集合资产管理计划说明书》、《华鑫鑫国2号集合资产管理计划风险揭示书》作为主合同的组成部分同步作变更，并按照合同约定向全体投资者征询意见。

我司确认并承诺更新或修改的内容不违反法律法规和中国证监会的有关规定，不损害投资者利益。我司与托管人(广发银行股份有限公司)协商确认，通过签署《华鑫鑫国2号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXXG-2020第1-1号-2023）（以下简称《资管合同》）的方式对《华鑫鑫国2号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXXG-2020第1-1号）内容进行更新或修改。

一、 主要变更事项的说明

（一）华鑫鑫国2号集合资产管理计划资产管理合同（合同编号：HXXG-2020第1-1号-2023）

本次合同变更主要内容如下，详细修订内容详见“第二章、华鑫鑫国2号集合资产管理计划资产管理合同修订前后款对照表”：

1、 修改投资限制、投资程序条款；

2、 修改关于存续期规模上限的表述；

3、 修改关于估值条款；

4、修改管理人以自有资金参与计划条款；

5、修改投资经理的的指定与变更的表述；

6、修改托管人、管理人的权利义务相关表述；

7、修改利益冲突及关联交易条款；

8、修改合同的变更、终止与清算条款；

9、修改收益分配的执行条款；

10、修改风险揭示条款；

11、修改越权交易的处理程序条款。

修改后的资产管理合同请参见华鑫鑫国2号集合资产管理计划资产管理合同(合同编号:HXXG-2020 第1-1号-2023).

（二）华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划说明书

《华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划说明书》对相应资产管理合同同步变更。

（三）华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划风险揭示书

《华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划风险揭示书》对应资产管理合同同步变更。

二、华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划资产管理合同修订前后款对照表

变更前的条款	变更后的条款
华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划资产管理合同 （编号：HXXG-2020 第 1-1 号）	华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划资产管理合同 （编号：HXXG-2020 第 1-1 号-2023）
重要提示	
特别约定：《华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以中登电子签名方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者（华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以中登电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。 投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以中登电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。管理人同意向托管人提供中国证券登记结算公司电子合同签署有关投资者信息，供托管人完成电子合同签署的相关流程。 本合同及管理人公告中的业绩报酬计提基准并不是管理人向客户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。在集合计划资产出现极端损失情况下，投资者可能面临无法取得收益乃至投资本金受损的风险。	特别约定：《华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以纸质或电子签名方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者（华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以纸质或电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。托管人可通过中国证券登记结算有限责任公司系统或者管理人指定的专线进行电子数据相关传输。 投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者通过销售机构认可的有效身份验证措施登录相关网络系统后，以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。管理人同意向托管人提供中国证券登记结算公司电子合同签署有关投资者信息或者向托管人提供管理人指定注册登记机构提供的电子合同签署有关投资者信息，供托管人完成电子合同签署的相关流程。 本合同及管理人公告中的业绩报酬计提基准（如有）并不是管理人向客户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。在集合计划资产出现极端损失情况下，投资者可能面临无法取得收益乃至投资本金受损的风险。
第二节、 释 义	
《运作管理规定》 指 2018 年 10 月 22 日中国证监会公布并于公布之日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》。	**《运作规定》** 指 2018 年 10 月 22 日中国证监会公布并于公布之日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规

	定》。
投资者/合格投资者 合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。 （一）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。 （二）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。 （三）金融管理部门视为合格投资者的其他情形。 依法设立并受监管的各类集合投资产品视为单一合格投资者。	**投资者/合格投资者** 指签订本合同且根据本合同及相关文件合法取得本计划份额的、符合《指导意见》和《运作规定》规定条件的合格投资者。
集合计划存续期、管理期限 集合计划从成立到集合计划终止的时期。本集合计划管理期限 3 年，集合计划份额管理期限请参见集合计划销售公告或开放公告。	**集合计划存续期、管理期限** 集合计划从成立到集合计划终止的时期。本集合计划管理期限 10 年，集合计划份额管理期限请参见集合计划销售公告或开放公告。
不可抗力 指遭受不可抗力事件一方不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化、注册登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易、中国人民银行以及其他机构结算系统发生故障、非因管理人或托管人自身原因导致的技术系统异常事故以及政策、法律、法规、监督规则的修改或监管要求调整等（包括但不限于监管/主管部门或自律组织出台与本合同项下业务相关的任何书面或口头的规则、规范、政策、通知、指令、指引、备忘录、意见或问答等）。	**不可抗力** 指不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，包括但不限于地震、台风、水灾、火灾、战争、暴乱、流行病、政府行为、罢工、停工、停电、通讯失败等，非因管理人、托管人自身原因导致的技术系统异常事故、法律法规、监管政策调整等情形。因交易所、银行、登记结算机构的交易、结算系统出现故障导致的交易、结算无法进行的情形，因电信服务商原因导致资金划付的网络中断、无法使用的情形，亦构成不可抗力事件。
第三节、声明与承诺	
投资者声明： 签署本集合计划管理合同即表明投资者承认已为满足《指导意见》规定的投资者风险匹配要求： 合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。 （一）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。 （二）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。 （三）金融管理部门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集合投资产品视为单一合格投资者，若本计划投资者为投资产品的，不得通过拆分转让资产管理计划份额或其收益权、为投资者直接或间接提供短期借贷等方式，变相突破合格投资者标准。	**投资者声明：** 签署本集合计划管理合同即表明投资者承认已为满足《指导意见》、《运作规定》规定的投资者风险匹配要求： 合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本计划的金额不低于【30】万元且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织： （一）具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一的自然人：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。 （二）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位； （三）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登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、 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； （四）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； （五）基本养老金、社会保障基金、企业年金基金 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）； （六）中国证监会视为合格投资者的其他情形。 法律法规、监管机构、自律组织对于合格投资者认定将来另有规定的，从其规定。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集合投资产品视为单一合格投资者，若本计划投资者为投资产品的，不得通过拆分转让资产管理计划份额或其收益权、为投资者直接或间接提供短期借贷等方式，变相突破合格投资者标准。
投资者承诺： 1.符合《运作规定》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.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。 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。 4.投资者承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构报告涉嫌恐怖融资的可疑交易管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》等相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺出示真实有效的身份证明文件及相关账户信息，积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动，配合管理人开展非居民金融账户涉税信息尽职调查，提供因监管机构或国家有权机关调查所需客户账户相关信息。	**投资者承诺：** 1.符合《运作规定》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.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。 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。 4.投资者知悉并确认，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。投资者在此同意，如果此或有事件发生，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转让给上述的从事资产管理业务的公司，并无需就此项变更取得投资者同意，也无需和投资者另行签订协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告投资者。管理人保障投资者退出本集合计划的权利，并在届时的通告中对相关事项做出合理安排。 5.投资者承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构报告涉嫌恐怖融资的可疑交易管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》等相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺出示真实有效的身份证明文件及相关账户信息，积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动，配合管理人开展非居民金融账户涉税信息

	尽职调查，提供因监管机构或国家有权机关调查所需客户账户相关信息。
第四节、当事人的权利与义务	
一、投资者、管理人和托管人的基本情况 管理人 管理人名称：华鑫证券有限责任公司 法定代表人：俞洋 住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元 联系地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元 联系人：王毓霆 联系电话：021-54967779 传真：0755-83025029 托管人 托管人名称：广发银行股份有限公司 负责人： 尹兆君 住所：北京市西城区菜市口大街1号院2号楼信托大厦11层 联系地址：北京市西城区菜市口大街1号院2号楼信托大厦11层 联系人：卢晓晨 联系电话：010-65169644	**一、投资者、管理人和托管人的基本情况** 管理人 管理人名称：华鑫证券有限责任公司 法定代表人：俞洋 住所:深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道7888号东海国际中心一期A栋2301A 联系地址：上海市徐汇区肇嘉浜路750号华鑫证券 联系人：刘帆 联系电话：021-54967795 传真：0755-83025029 托管人 托管人名称：广发银行股份有限公司 负责人： 王凯 住所：北京市东城区东长安街甲2号广发银行大厦 联系地址:北京市东城区东长安街甲2号广发银行大厦 联系人： 李萌 联系电话：010-65169086
三、管理人的权利和义务 （一）管理人的权利 1、根据本合同及《说明书》的约定，独立管理和运用资产管理计划财产。 2、根据本合同及《说明书》的约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬。 3、按照本合同及《说明书》的约定，停止办理集合计划的参与，暂停办理集合计划的退出事宜。 4、根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作。 5、按照法律法规和本合同及《说明书》的约定，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。 6、按照法律法规和本合同及《说明书》的约定，行使因资产管理计划财产投资所产生的权利。 7、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	**三、管理人的权利和义务** （一）管理人的权利 1、根据本合同及《说明书》的约定，独立管理和运用资产管理计划财产。 2、根据本合同及《说明书》的约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬。 3、按照本合同及《说明书》的约定，停止办理集合计划的参与，暂停办理集合计划的退出事宜。 4、根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作。 5、按照法律法规和本合同及《说明书》的约定，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。 6、按照法律法规和本合同及《说明书》的约定，行使因资产管理计划财产投资所产生的权利。 7、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

查。 8、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。 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、有权获得投资顾问（如有）的投资建议服务，并对其提供的投资建议有审议、修改和最终的决策权。 11、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。	监督和检查。 8、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。 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、有权获得投资顾问（如有）的投资建议服务，并对其提供的投资建议有审议、修改和最终的决策权。 11、选择、更换律师、审计师或其他为计划提供服务的外部机构。 12、有权按照《个人信息保护法》及相关法律法规的规定处理投资者的个人信息，遵循合法、正当、必要和诚信原则。根据个人信息的处理目的、处理方式、个人信息的种类以及对个人权益的影响、可能存在的安全风险等，采取必要措施确保个人信息处理活动符合法律、行政法规的规定，防止未经授权的访问以及个人信息泄露、篡改、丢失。 13、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。
（二）管理人的义务 17、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，向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。	**（二）管理人的义务** 17、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。
（二）管理人的义务 28、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及时向投资者和托管人报告。	**（二）管理人的义务** 28、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并及时向投资者和托管人报告。
四、托管人的权利和义务 （一）托管人的权利 1、按照本合同和托管协议的约定依法托管集合计划的资产。 2、按照本合同和托管协议的约定按时、足额收取托管费。 3、监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定或者本合同、托管协议约定的，有权要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行。 4、查询集合计划的经营运作情况。 5、法律法规、中国证监会有关规定及本合同《托管协议》约定的其他权利。	**四、托管人的权利和义务** （一）托管人的权利 1、按照本合同和托管协议的约定依法托管集合计划的资产。 2、按照本合同和托管协议的约定按时、足额收取托管费。 3、监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定或者本合同、托管协议约定的，有权要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行。 4、查询集合计划的经营运作情况。 5、托管人自资产管理计划财产进入托管账户之日起履行保管职责。非因托管人原因造成的处于托管人实际控制之外账户中的资产，托管人不承担保管责任； 6、托管人对委托财产的保管，并非对收回投资本金或取得收益的保证或承诺，托管人不承担任何投资风险； 7、托管人的职责不包含：(一)投资者的适当性管理；(二)审核项目及交易信息真实性；(三)审查保管产品以及委托资产资金来源的合法合规性；(四)对委托资产本金及收益提供保证或承诺；(五)对已划出保管账户以及处于托管人实

	际控制之外的资产的保管责任；(六)对未兑付保管产品后续资金的追偿；(七)主会计方未接受保管人的复核意见进行信息披露产生的相应责任；(八)因不可抗力，以及由于第三方(包括但不限于证券交易所、期货交易所、中国证券登记结算公司、中国期货市场监控中心等)发送或提供的数据错误及合理信赖上述信息操作给保管资产造成的损失；(九)提供保证或其他形式的担保；(十)自身应尽职责之外的连带责任，包括对管理人的行为的连带责任。” 8、法律法规、中国证监会有关规定及本合同《托管协议》约定的其他权利。
（二）托管人的义务 6、监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同、以及托管协议约定的，应当要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行，并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会。	**（二）托管人的义务** 6、监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同、以及托管协议约定的，应当要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行，并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构。
第五节、资产管理计划的基本情况	
五、投资范围和投资组合设计 （二）本计划的投资比例和投资限制 2、投资限制（占集合计划资产总值） （1）投资标准信用债债项评级为AA（含）以上（资产支持证券（票据）、可转债和可交换债除外），若无债项评级，主体评级或担保机构评级需为AA（含）以上，且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考； （2）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，所申报的金额不得超过集合计划总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量； （3）本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过200%。计算单个资产管理计划的总资产按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。 （4）按照穿透原则合并计算，投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产80%； （5）本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的25%；资产管理人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。 （6）本计划不得投资于资产支持证券次级，仅限投资在交易所和银行间的资产支持证券。投资标的遵循法律法规对产品嵌套的要求。 （7）法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。 3、投资禁止行为 本计划财产禁止从事下列行为：	**五、投资范围和投资组合设计** （二）本计划的投资比例和投资限制 2、投资限制（占集合计划资产总值） （1）投资标准信用债债项评级为AA（含）以上（资产支持证券（票据）、可转债和可交换债除外），若无债项评级，主体评级或担保机构评级需为AA（含）以上，且对中债资信评估有限公司，以及惠誉、标普等境外评级信息不予参考； （2）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，所申报的金额不得超过集合计划总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量； （3）本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过200%。计算单个资产管理计划的总资产按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。 （4）按照穿透原则合并计算，投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产80%； （5）本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的25%；资产管理人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。 （6）本计划不得投资于资产支持证券次级，仅限投资在交易所和银行间的资产支持证券，其基础资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产。投资标的遵循法律法规对产品嵌套的要求。 （7）法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。

不得承销证券； 不得将计划资产用于对外担保等用途； 不得将计划资产用于可能承担无限责任的投资； 不得从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动； 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他活动。 托管人对管理人投资行为监督的具体内容和标准按照本合同附件投资监督事项表（附件五）执行，若本合同第十一章节第四点、第五点的内容与投资监督事项表（附件五）不一致的，以投资监督事项表（附件五）为准。 4、在本集合计划成立之日起六个月内，可不受上述比例限制，但应当符合本集合计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本计划投资比例超标的，管理人应自可交易之日起的 15 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。 5、【本计划存续期间，为规避特定风险并经全体投资者同意的，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%，管理人应详细列明上述相关特定风险。】 投资者在此同意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承销期内承销的证券或者从事其他重大关联关系，将遵循客户利益优先原则，交易完成 5 个工作日内，管理人应当书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者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，并采取切实有效的措施，防范利益冲突，保护客户合法权益。管理人承诺不以本集合计划的资金，直接或通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、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提供或者变相提供融资，或与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。 在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告（如需），并通过本集合计划季报、年报等定期报告形式向投资者披露。 托管人仅依据法律法规或合同明确约定的投资范围、投资限制、投资禁止行为、管理人书面提供的关联方名单（若有）等内容进行投资监督。	3、投资禁止行为 本计划财产禁止从事下列行为： （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）使用集合计划资产进行不必要的交易； （7）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； （8）承销证券； （9）向他人贷款或融资提供担保； （10）利用产品为集合计划投资者之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送； （11）不得直接投资商业银行信贷资产；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； （12）不得直接或者间接投资法律、行政法规和国家产业政策、环保政策禁止投资的行业 或领域（证券市场投资除外）。包括但不限于： 1）投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录； 2）投资项目违反国家相关环境保护政策要求； 3）通过穿透核查，最终投向上述投资项目； （13）法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。 托管人对管理人投资行为监督的具体内容和标准按照本合同附件投资监督事项表（附件五）执行，若本合同第十一章节第四点、第五点的内容与投资监督事项表（附件五）不一致的，以投资监督事项表（附件五）为准。 4、在本集合计划成立之日起六个月内，可不受上述比例限制，但应当符合本集合计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本计划投资比例超标的，管理人应自可交易之日起的 20 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。 5、【本计划存续期间，为规避特定风险并经全体投资者同意的，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%，管理人应详细列明上述相关特定风险。】 投资者在此同意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承销期内承销的证券或者从事其他关联交易，将遵循客户利益优先原则，交易完成5个工作日内，管理人应当书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者中国证监会相关派出机构报告，并采取切实有效的措施，防范利益冲突，保护客户合法权益。管理人承诺不以本集合计划的资金，直接或通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、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提供或者变相提供融资，或与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。 在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告（如需），并通过本集合计划季报、年报等定期报告形式向投资者披露。 托管人仅依据法律法规或合同明确约定的投资范围、投资限制、投资禁止行为、管理人书面提供的关联方名单（若有）等内容进行投资监督。
六、管理期限 本集合计划管理期限自成立之日起【三年】，符合一定条件下可展期（具体参见第二十九节展期条款）。 管理人可根据本集合实际运作情况，经与托管人协商一致，可以提前终止本集合计划，提前终止的，管理人应在管理人网站公告。若本集合计划管理权限届满或终止时投资标的未全部变现的，集合计划自动延期至投资标的全部变现之日，具体以管理人公告为准。	**六、管理期限** 本集合计划管理期限自成立之日起【十年】，符合一定条件下可展期（具体参见第二十四节展期条款）。 管理人可根据本集合实际运作情况，经与托管人协商一致，可以提前终止本集合计划，提前终止的，管理人应在管理人网站公告。若本集合计划管理权限届满或终止时投资标的未全部变现的，集合计划自动延期至投资标的全部变现之日，具体以管理人公告为准。
	新增： **十二、服务机构信息** 本计划的份额登记机构、估值与核算、信息技术服务机构为华鑫证券有限责任公司。管理人未委托其他服务机构代为办理本计划的估值与核算、信息技术服务。
第六节、资产管理计划的募集	
二、本集合计划的风险收益特征及适合销售对象 本资产管理计划属于【中低风险R2】风险投资品种，适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C2-C5】的普通投资者】。 投资者在此声明：签署本集合计划管理合同即表明投资者承认已为满足《指导意见》规定的投资者风险匹配要求： 合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。 （一）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。	**二、本集合计划的风险收益特征及适合销售对象** 本资产管理计划属于【中低风险R2】风险投资品种，适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C2-C5】的普通投资者】。 投资者在此声明：签署本集合计划管理合同即表明投资者承认已为满足《指导意见》、《运作规定》规定的投资者风险匹配要求。

（二）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。 （三）金融管理部门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集合投资产品视为单一合格投资者，若本计划投资者为投资产品的，不得通过拆分转让资产管理计划份额或其收益权、为投资者直接或间接提供短期借贷等方式，变相突破合格投资者标准。	
三、参与本集合计划的最低金额 投资者首次参与的最低金额为人民币【30】万元，追加参与的最低金额为人民币【1】万元，具体参与最低金额以管理人公告为准。	**三、参与本集合计划的最低金额** 投资者首次参与的最低金额为人民币【30】万元，不含参与费，追加参与的最低金额为人民币【1】万元，具体参与最低金额以管理人公告为准。
四、本集合计划的销售 （一）销售机构：华鑫证券有限责任公司以及管理人认可并与其签署相关协议的的其他销售机构。 管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本集合计划，管理人新增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，管理人网站公告后即生效，管理人无需就增加或变更销售机构事宜征求投资者意见或与投资者另行签订协议。	**四、本集合计划的销售** （一）销售机构：本计划将通过管理人的直销渠道/销售机构向特定客户进行销售。本计划销售机构为【华鑫证券有限责任公司直销渠道、华鑫证券有限责任公司以及管理人认可并与其签署相关协议的其他销售机构】。管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的销售机构销售本集合计划，管理人新增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，管理人网站公告后即生效，管理人无需就增加或变更销售机构事宜征求投资者意见或与投资者另行签订协议。 投资者认购本计划，必须与管理人和托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。投资者认购的具体金额和本计划份额以注册登记机构的确认结果为准。
六、募集结算专用账户披露渠道和查询方式 本计划募集结算专用账户将以账户信息告知书的方式向投资者进行披露，投资者可在管理人处查询；销售机构委托募集账户（如有）由销售机构向投资者进行披露，投资者可在销售机构处查询。	**六、初始认购资金的管理及利息处理方式** 管理人应将本计划募集期间客户的资金存放于本计划募集结算专用账户，在本计划初始募集行为结束前，任何个人和机构不得动用。募集结算专用账户信息如下： 户名：华鑫证券有限责任公司 账号：98300153400000075 开户行：上海浦东发展银行徐汇支行 认购资金在初始募集期间发生的利息收入按银行同期活期存款利率计算。投资者的认购参与款项（不含认购费用）加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。利息的计算采用四舍五入法保留到小数点后 2 位，差额部分计入本计划财产。
	新增： **七、募集账户** 本集合计划管理人募集结算专用账户信息见上述第六条“初始认购资金的管理及利息处理方式 ”。直销柜台募集结算账户将以管理人官网披露的方式向投资者进行披露，投资者可在管理人处查询。其他销售机构委托募集账户信息

	（如有）由销售机构向投资者进行披露，投资者可在销售机构处查询。 华鑫证券有限责任公司作为运营服务机构，为【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户提供管理服务，对【管理人直销渠道】募集结算资金实施监督。各方确认：管理人委托的运营服务机构（华鑫证券有限责任公司）不对其直销渠道以外的募集账户承担监管义务。
第七节、集合计划的成立与备案	
一、集合计划成立的条件和日期 集合计划的参与资金总额不低于 1,000 万元人民币且其投资者的人数为 2 人（含）以上且不超过 200 人，并募集金额缴足之日起 10 个工作日内，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，管理人通过管理人网站宣布本集合计划成立。 管理人在本集合计划成立之日起 5 个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报送证券投资基金业协会备案，并抄送中国证监会相关派出机构。 本集合计划完成备案前，投资者的参与资金不得开展投资活动，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。	**一、集合计划成立的条件和日期** 集合计划的参与资金总额不低于 1,000 万元人民币且其投资者的人数为 2 人（含）以上且不超过 200 人，并募集金额缴足之日起 10 个工作日内，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，管理人通过管理人网站宣布本集合计划成立。 管理人在本集合计划成立之日起 5 个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报送证券投资基金业协会备案。 本集合计划完成备案前，投资者的参与资金不得开展投资活动，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。
第八节、资产管理计划的参与、退出与转让	
一、集合计划的参与 **（一）参与的办理时间** 2、开放期参与 本集合计划原则上定期开放，本计划成立之日起 6 个月为封闭期，封闭期后的自然月的 17 日、18 日为首个开放参与期，上个周期的到期日（T 日）为开放日的第一日，之后每满 6 个月开放一次，开放期为 2 个工作日（遇法定节假日顺延）。开放期内可办理参与、退出业务，办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间，遇法定节假日顺延。具体开放期以管理人公告为准，集合计划按规定限制或暂停退出的情况除外。 例如，本计划的成立日为 2020 年 2 月 24 日，则 2020 年 8 月 17 日为首个封闭期的到期日，封闭期为 2020 年 2 月 24 日至 2020 年 8 月 16 日。下个封闭期的开放日为 2020 年 8 月 17 日和 2020 年 8 月 18 日，下期封闭期的到期日为 2021 年 2 月 17 日，以此类推。 集合计划每个计息周期为：（1）集合计划成立日（含）至到期日（含）的期间；（2）集合计划每个开放日的次一个工作日（含）至集合计划下一个到期日（含）的期间，以此类推。 当发生本合同变更或因客观原因导致自有资金参与本集合计划被动超过法律法规和本合同约定的比例等或管理人认为必	**一、集合计划的参与** **（一）参与的办理时间** 2、开放期参与 本集合计划原则上定期开放，本计划成立之日起 6 个月为封闭期，封闭期后的自然月的 17 日、18 日为首个开放参与期，上个周期的到期日（T 日）为开放日的第一日，之后每满 6 个月开放一次，开放期为 2 个工作日（遇法定节假日顺延）。开放期内可办理参与、退出业务，办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间，遇法定节假日顺延。具体开放期以管理人公告为准，集合计划按规定限制或暂停退出的情况除外。 例如，本计划的成立日为 2020 年 2 月 24 日，则 2020 年 8 月 17 日为首个封闭期的到期日，封闭期为 2020 年 2 月 24 日至 2020 年 8 月 16 日。下个封闭期的开放日为 2020 年 8 月 17 日和 2020 年 8 月 18 日，下期封闭期的到期日为 2021 年 2 月 17 日，以此类推。 集合计划每个计息周期为：（1）集合计划成立日（含）至到期日（含）的期间；（2）集合计划每个开放日的次一个工作日（含）至集合计划下一个到期日（含）的期间，以此类推。 管理人可以根据业务实际情况，设置临时开放日。管理

要时可提前 1-5 个工作日通过指定网站公告增加集合计划份额的临时开放日。 临时开放日适用于： （1）因集合计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与集合计划被动超限的，管理人通过设置临时开放期办理超出份额的退出手续； （2）在合同的补充、修改与变更后，管理人通过设置临时开放日的方式，合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利； （3）因无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障、金融市场危机、行业竞争、代销机构违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险或不可抗力因素的出现，导致集合计划资产无法正常运作或出现损失或投资者利益受损的情况，为合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利，可设置临时开放日。 管理人不得利用临时开放期变更开放募集，从而突破《运作规定》对于开放次数的限制。	人应提前至少 1 个工作日在管理人网站公告具体安排。 临时开放日适用于： （1）因集合计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与集合计划被动超限的，管理人通过设置临时开放期办理超出份额的退出手续； （2）在合同的补充、修改与变更后，管理人通过设置临时开放日的方式，合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利； （3）因无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障、金融市场危机、行业竞争、代销机构违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险或不可抗力因素的出现，导致集合计划资产无法正常运作或出现损失或投资者利益受损的情况，为合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利，可设置临时开放日。 管理人不得利用临时开放期变更开放募集，从而突破《运作规定》对于开放次数的限制。
（二）参与的原则 1、合格投资者资格要求请详见本合同第三节“承诺与说明”中的相关约定。 2、投资者采用电子签名方式的，需到集合计划销售机构指定营业网点或登陆销售机构指定网络系统签署电子合同。合同在管理人、托管人、投资者三方完成签署，且投资者按合同约定将参与资金划入指定账户并经注册登记机构确认有效后生效。投资者应当如实提供与签署合同相关的信息和资料，管理人和其他销售机构应当按照有关规定对投资者提供的信息和资料进行审查并如实记录。投资者保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。 3、“金额参与”原则，即参与时以金额申请。本集合计划的单个投资者首次参与的最低金额为 30 万元，超过部分按 1 万及 1 万整数倍递增，追加参与的最低金额为 1 万元，超过部分按 1 万元整数倍递增。首次参与指提出参与申请的投资者在参与之前未持有本计划份额的情形。 4、在销售期内，投资者以集合计划的面值（1.0000 元/份额）参与；开放期内，投资者参与价格为开放期受理申请当日集合计划份额的单位净值。 5、投资者可以多次参与本集合计划，当日参与申请只能在当日交易时间结束之前撤销。 6、如本集合计划在销售期，销售机构当日的参与申请全部确认后使得本集合计划的募集规模超过募集上限或客户数达到 200 户以上，则对该日有效参与申请采用“时间优先，时间相同情况下金额优先”的原则给与部分确认，未确认部分的参与款项退还给投资者；如本集合计划在任一开放期，销售机构当日的参与申请全部确认后规模超过每次开放公告确定的规模上限或客户数达到 200 户以上，则对该日有效参与申请采用“时间	**（二）参与的原则** 1、合格投资者资格要求请详见本合同第三节“承诺与说明”中的相关约定。 2、投资者采用电子签名方式的，需到集合计划销售机构指定营业网点或登陆销售机构指定网络系统签署电子合同。合同在管理人、托管人、投资者三方完成签署，且投资者按合同约定将参与资金划入指定账户并经注册登记机构确认有效后生效。投资者应当如实提供与签署合同相关的信息和资料，管理人和其他销售机构应当按照有关规定对投资者提供的信息和资料进行审查并如实记录。投资者保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。 3、“金额参与”原则，即参与时以金额申请。本集合计划的单个投资者首次参与的最低金额为 30 万元（不含参与费），超过部分按 1 万及 1 万整数倍递增，追加参与的最低金额为 1 万元，超过部分按 1 万元整数倍递增。首次参与指提出参与申请的投资者在参与之前未持有本计划份额的情形。 4、在销售期内，投资者以集合计划的面值（1.0000 元/份额）参与；开放期内，投资者参与价格为开放期受理申请当日集合计划份额的单位净值。 5、投资者可以多次参与本集合计划，当日参与申请只能在当日交易时间结束之前撤销。 6、如本集合计划在销售期，销售机构当日的参与申请全部确认后使得本集合计划的募集规模超过募集上限或客户数达到 200 户以上，则对该日有效参与申请采用“时间优先，时间相同情况下金额优先”的原则给与部分确认，未确认部分的参与款项退还给投资者；如本集合计划在任一开放

优先，时间相同情况下金额优先”的原则给与部分确认，未确认部分的参与款项退还给投资者。 7、投资者的参与资金在集合计划成立之前所产生的利息折成集合计划份额，归投资者所有，具体份额以注册与过户登记人的记录为准。	期，销售机构当日的参与申请全部确认后规模超过每次开放公告确定的规模上限或客户数达到 200 户以上，则对该日有效参与申请采用“时间优先，时间相同情况下金额优先”的原则给与部分确认，未确认部分的参与款项退还给投资者。 7、投资者的参与资金在集合计划成立之前所产生的利息折成集合计划份额，归投资者所有，具体份额以注册与过户登记人的记录为准。
	新增： **五、管理人以自有资金参与本计划** （一）自有资金参与的条件和方式 在本集合计划初始募集期起始日至集合计划终止日内，管理人可以以自有资金参与本集合计划。管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《管理办法》、《运作规定》和监管机构的相关规定。投资者及托管人签署本合同，即视为同意管理人可以以自有资金参与、退出本集合计划，管理人无需就自有资金参与、退出本集合计划另行取得投资者及托管人同意，但管理人应当根据本合同的约定进行披露。 （二）自有资金参与的份额比例 自有资金参与的份额不得超过本计划总份额的 16%。管理人及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过计划总份额的 50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，不视为管理人违反此项约定，但在客观条件允许的情况下，管理人及其子公司应当在超标情况发生后的 10 个交易日内调整自有资金参与份额，并在调整后 5 个工作日内通过管理人网站公告告知全体投资者和托管机构，确保符合前述约定。 （三）自有资金的收益分配和责任承担方式 管理人自有资金所持的集合资产管理计划份额，应当与投资者所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。 （四）自有资金的退出 管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。自有资金参与、退出时，应提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人，法律法规、监管规定或自律规则另有规定的除外。集合计划存续期间，管理人有权部分或全部退出自有资金持有份额。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过法律、法规规定比例的，管理人在合理期限内安排自有资金的退出，可不受上述限制。 管理人自有资金参与部分在出现以下情况之一时，可以退出本集合计划： （1）管理人自有资金参与份额，满足参与时间不少于相关法律法规、监管机构或自律组织规定的期限时，可与其他投资者同样办理退出业务。 （2）管理人自有资金参与本集合计划的份额及对应的资产净值，均不得超过相关法律法规、监管机构规定的比例。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

	划的比例被动达到相关法律法规、监管机构规定的预警标准或者不符合规定标准的，管理人应当将部分自有资金参与份额在本集合计划开放期办理退出业务或非开放期间办理份额强制退出，以使自有资金比例在相关法律法规规定的时限内符合法规要求。法律法规另有规定的，从其规定。 （3）法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。 为应对本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，管理人自有资金的参与、退出可不受前述比例和持有期限限制，但应及时告知投资者和托管人，并向相关证监会派出机构报告。
第十一节、资产管理计划的投资	
五、投资范围和投资组合设计 **（二）本计划的投资比例和投资限制** 2、投资限制（占集合计划资产总值） （1）投资标准信用债债项评级为AA（含）以上（资产支持证券（票据）、可转债和可交换债除外），若无债项评级，主体评级或担保机构评级需为AA（含）以上，且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考； （2）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，所申报的金额不得超过集合计划总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量； （3）本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过200%。计算单个资产管理计划的总资产按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。 （4）按照穿透原则合并计算，投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产80%； （5）本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的25%;资产管理人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。 （6）本计划不得投资于资产支持证券次级，仅限投资在交易所和银行间的资产支持证券。投资标的遵循法律法规对产品嵌套的要求。 （7）法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。 3、投资禁止行为 本计划财产禁止从事下列行为： 不得承销证券； 不得将计划资产用于对外担保等用途； 不得将计划资产用于可能承担无限责任的投资； 不得从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证	**五、投资范围和投资组合设计** **（二）本计划的投资比例和投资限制** 2、投资限制（占集合计划资产总值） （1）投资标准信用债债项评级为AA（含）以上（资产支持证券（票据）、可转债和可交换债除外），若无债项评级，主体评级或担保机构评级需为AA（含）以上，且对中债资信评估有限公司，以及惠誉、标普等境外评级信息不予参考； （2）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，所申报的金额不得超过集合计划总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量； （3）本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过200%。计算单个资产管理计划的总资产按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。 （4）按照穿透原则合并计算，投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产80%； （5）本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的25%；资产管理人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。 （6）本计划不得投资于资产支持证券次级，仅限投资在交易所和银行间的资产支持证券。投资标的遵循法律法规对产品嵌套的要求，其基础资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产。 （7）法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。 3、投资禁止行为 本计划财产禁止从事下列行为： （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；

券交易活动； 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他活动。 托管人对管理人投资行为监督的具体内容和标准按照本合同附件投资监督事项表（附件五）执行，若本合同第十一章节第四点、第五点的内容与投资监督事项表（附件五）不一致的，以投资监督事项表（附件五）为准。 4、在本集合计划成立之日起六个月内，可不受上述比例限制，但应当符合本集合计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本计划投资比例超标的，管理人应自可交易之日起的 15 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。 5、【本计划存续期间，为规避特定风险并经全体投资者同意的，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%，管理人应详细列明上述相关特定风险。】 投资者在此同意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承销期内承销的证券或者从事其他重大关联关系，将遵循客户利益优先原则，交易完成 5 个工作日内，管理人应当书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者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，并采取切实有效的措施，防范利益冲突，保护客户合法权益。管理人承诺不以本集合计划的资金，直接或通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、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提供或者变相提供融资，或与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。 在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告（如需），并通过本集合计划季报、年报等定期报告形式向投资者披露。 托管人仅依据法律法规或合同明确约定的投资范围、投资限制、投资禁止行为、管理人书面提供的关联方名单（若有）等内容进行投资监督。	（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）使用集合计划资产进行不必要的交易； （7）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； （8）承销证券； （9）向他人贷款或融资提供担保； （10）利用产品为集合计划投资者之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送； （11）不得直接投资商业银行信贷资产；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； （12）不得直接或者间接投资法律、行政法规和国家产业政策、环保政策禁止投资的行业或领域（证券市场投资除外）。包括但不限于： 1）投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录； 2）投资项目违反国家相关环境保护政策要求； 3）通过穿透核查，最终投向上述投资项目； （13）法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。 托管人对管理人投资行为监督的具体内容和标准按照本合同附件投资监督事项表（附件五）执行，若本合同第十一章节第四点、第五点的内容与投资监督事项表（附件五）不一致的，以投资监督事项表（附件五）为准。 4、在本集合计划成立之日起六个月内，可不受上述比例限制，但应当符合本集合计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本计划投资比例超标的，管理人应自可交易之日起的 20 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。 5、【本计划存续期间，为规避特定风险并经全体投资者同意的，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%，管理人应详细列明上述相关特定风险。】 投资者在此同意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承销期内承销的证券或者从事其他关联交易，将遵循客户利益优先原则，交易完成 5 个工作日内，管理人应当书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者中国证监会相关派出机构，并采取切实有效的措

	施，防范利益冲突，保护客户合法权益。管理人承诺不以本集合计划的资金，直接或通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、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提供或者变相提供融资，或与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。 在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告（如需），并通过本集合计划季报、年报等定期报告形式向投资者披露。 托管人仅依据法律法规或合同明确约定的投资范围、投资限制、投资禁止行为、管理人书面提供的关联方名单（若有）等内容进行投资监督。
七、投资决策与风险控制 （一）集合计划的决策依据 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，并以维护集合计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括： 1、《指导意见》、《管理办法》、《业务规范》、《资产管理合同》、《说明书》等有关法律文件； 2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势，这是本集合计划投资决策的基础； 3、投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本集合计划维护投资者利益的重要保障。 （二）投资程序 1、投资决策程序 公司资产管理业务投资管理实行分级授权管理制度，每一层级的投资决策主体在各自的授权范围内行使相应的职权。具体投资决策程序如下： 1）管理人资产管理业务委员会审定年度市场投资策略。 2）资产管理投资决策小组根据资产管理业务委员会授权，不定期召开会议，审定资产管理业务阶段性市场投资策略。 3）资产管理业务相关投资负责人组织各投资经理实施具体投资计划，投资经理定期将所管理产品的投资决策执行和投资运作情况报告投资决策小组。 2、投资交易程序 （1）投资方式：委托财产的具体管理与运用由管理人、投资顾问、托管行共同完成，并由各方根据资管计划文件和相关合同的规定履行各自的职责。管理人根据投资顾问的投资建议，通过管理人审查后，进行本资管计划的投资运作，管理人执行投资顾问提供的投资建议，所形成的损失由委托资产承担。 （2）具体的投资实施：管理人根据本合同中关于委托财产运用范围和投资比例的规定自行进行投资。	**七、投资决策与风险控制** （一）集合计划的决策依据 集合计划以国家有关法律、法规、管理人相关制度和本合同的有关规定为决策依据，并以维护集合计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括： 1、《指导意见》、《管理办法》、《业务规范》等有关法律法规、监管规定及管理人制度、《资产管理合同》、《说明书》等有关法律文件； 2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势，这是本集合计划投资决策的基础； 3、投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本集合计划维护投资者利益的重要保障。 （二）投资程序 1、投资决策程序 管理人资产管理业务投资管理实行分级授权管理制度，每一层级的投资决策主体在各自的授权范围内行使相应的职权。具体投资决策程序如下： 资产管理业务相关投资负责人组织各投资经理实施具体投资计划，投资经理定期将所管理产品的投资决策执行和投资运作情况报告私募资产管理业务投资决策小组以及资产管理业务投资决策委员会。 2、投资交易程序 （1）投资方式：委托财产的具体管理与运用由管理人、投资顾问、托管行共同完成，并由各方根据资管计划文件和相关合同的规定履行各自的职责。管理人根据投资顾问的投资建议，通过管理人审查后，进行本资管计划的投资运作，管理人执行投资顾问提供的投资建议，所形成的损失由委托资产承担。 （2）具体的投资实施：管理人根据本合同中关于委托财产运用范围和投资比例的规定自行进行投资。

（3）独立的执行：管理人设置独立的集中交易室，通过严格的交易制度和风险监控功能，保证投资主办人的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。 （四）风险控制 1、风险控制目标 强化管理人的内部管理，保障集合计划的规范运作，控制集合计划的运作风险，维护集合计划投资者、管理人及托管人的合法权益。 2、风险控制的原则 1）及时有效原则：对所取得的监控信息和数据应及时进行处理、分析、查证和报告，并发出风险提示和监控意见，有效预警和控制风险。 2）全面重点原则：在对系统各监控点进行日常监控的基础上，根据风险程度和工作需要，对有关监控点实施重点监控。 3）持续同步原则：根据被监控对象的业务发展，不断完善监控系统的功能，以确保系统功能与业务发展同步，保证非现场监控工作的持续有效开展。 4）授权责任原则：风险监控工作应遵循严格的授权制度，并建立明确的岗位责任制度。 3、风险控制组织架构 1）决策系统：风险控制委员会。公司风险管理的最高决策机构，负责制定公司总体风险管理政策。 2）实施系统：风控部门。公司风险管理的专职日常工作机构，组织实施风险管理的具体工作内容与任务，通过公司风控平台，对集合资产管理业务的运作状况进行监控、分析和评估。 3）监督系统：稽核部门和合规部门。稽核部门负责定期或不定期对集合资产管理业务的运作进行检查、评价。合规部门对集合资产管理业务和制度执行情况进行检查，发现违反法律、行政法规、中国证监会规定或者公司制度行为的，应当及时纠正处理，并向基金业协会及公司住所地证监会派出机构报告。 4）支持系统：包括研究部门、财务管理部门、运营管理部门、信息技术管理部门、人力资源管理部门等，对风险监控提供宏观经济与行业分析、预警信息和风险监管技术、财务资金监管、人员等支持。 5）公司实行公司风控部门和资产管理业务部门合规风控岗的二级风控体系，执行具体的风险管理制度，履行风险监管职能，包括风险监测和预警、提交风险报告和调整建议等。 4、投资风险管理程序 1）建立风险控制构架，完善风险控制制度和体系 在制度管理方面，除了公司的基本制度和内控规范外，针对资产管理业务还系统地制定了产品设计、投资管理、交易、营销和集中清算等制度，对资产管理业务的投资决策体系、投资管理流程、权限管理、交易工作流程、可投资标的库的建立及维护程序、产品开发流程、客户服务机制等都做出了具体的规定。	（3）独立的执行：管理人设置独立的集中交易室，通过严格的交易制度和风险监控功能，保证投资经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。

在组织构架方面，在公司层面，风控部门动态监控资产管理业务的运作、稽核部门检查内控制度的执行情况及负责审计监督、合规部门审查业务的合规性、运营管理部门对资产管理业务实行集中清算。在资产管理业务部门内部将市场营销、投资管理、交易执行、风险管理等岗位分设，通过职能分离形成制衡。

2）风险识别

公司对各类风险及各个风险点进行全面有效识别。公司已按照资产管理业务流程，对本集合计划的设计开发、合同签订、投资者开户、投资决策、投资执行、交易、清算、资金管理、客户管理等各环节风险点进行全面梳理。本集合资产管理计划的主要风险为市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险和管理风险等。

3）风险评估

公司风控部门定期或不定期评估集合资产管理业务的风险状况，范围包括所有可能对经营目标产生负面影响的内部和外部因素，评估这些因素对集合计划总体目标产生影响的程度及可能性，并将评估报告报公司领导及相关部门。

4）风险报告

公司风控部门对风险事件进行分析，制作定期或不定期风险管理报告，及时报送公司领导及相关部门。

5、外部风险监督

本集合计划在实行严格的内部风险控制的同时，也接受管理人以外的合作机构、监管机构以及投资者的监督。

1）托管人的监督

托管人监督管理人对集合计划的运作，发现管理人违反法律、法规和《集合资产管理合同》、托管协议的约定进行投资的，托管人有权对违反法律、法规和《集合资产管理合同》、托管协议的投资和资金清算指令不予执行，或采取有效措施防止损失扩大，并及时向投资者通报、向基金业协会及监管机构报告。托管人对本集合计划的清算估值进行复核、审查，按季编制集合计划托管报告，并报基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

2）上级监管机构的监管

中国证监会等监管机构将对集合计划销售、交易、投资运作相关的业务活动和财务会计资料进行定期或不定期的现场检查、稽核，并要求管理人和托管人就集合计划运作中遇到的重大问题作专项报告。

3）投资者的监督

投资者有权查询或查阅集合计划的资产管理情况和持有集合计划份额的变动情况，以及审计机构、上级监管机构披露的各种审查报告。

（四）预警、止损机制

本计划不设置【预警线、止损线】

-	**新增：** **九、预警、止损机制** 本计划不设置【预警线、止损线】
-	**新增：** **十、投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配** 本计划投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配。本计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值不低于计划资产净值的 10%。
第十四节、利益冲突及关联交易	
本资产管理计划的资产可以投资于管理人、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或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。 投资者在此同意授权管理人可以将资产管理计划的资产投资于管理人、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或承销期内承销的证券，管理人应当遵循投资者利益优先原则，交易完成 5 个自然日内，管理人应书面通知托管人，并书面告知投资者关联交易的投资标的等相关内容，并根据法律、行政法规规定，向监管机构报告。除前款规定外，管理人不得将本资产管理计划资产，直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。 投资者在此同意授权管理人可以将资产管理计划的资产从事重大关联交易，管理人应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，遵循投资者利益优先原则，交易完成 5 个自然日内，管理人应书面通知托管人，并书面告知投资者关联交易的投资标的等相关内容，并向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告，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。 管理人与托管人应提供各自关联方名单，在合同期限内根据变化应及时更新关联方名单，并以书面形式告知。	（一）关联交易及利益冲突情形 投资者在此同意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承销期内承销的证券或者从事其他关联交易，将遵循客户利益优先原则，交易完成 5 个工作日内，管理人应当书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者并向中国证监会相关派出机构报告，并采取切实有效的措施，防范利益冲突，保护客户合法权益。管理人承诺不以本集合计划的资金，直接或通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、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提供或者变相提供融资，或与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。投资者已明确知悉并愿意承担因上述关联交易可能导致的管理人/管理人关联方双重管理及收费等事项及风险。 本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：本计划可租用管理人关联方提供的证券交易单元；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。 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固有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、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计划的投资运作。 （二）关联交易及利益冲突的应对及处理 资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，管理人应当坚持投资者利益优先原则，从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生损害投资者利益的利益冲突时，管理人应当视具体利益冲突情形和重要程度选择在向投资者提供的定

	期报告或临时报告中进行披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对投资者利益的影响等。管理人承诺谨慎勤勉地管理资产管理计划财产、公平对待各投资组合。

第十五节、投资经理的指定与变更

一、投资主办的指定 （一）委托资产投资主办人由管理人负责指定。 （二）集合资产管理业务的投资主办人不得兼任其它资产管理业务或自营业务的投资主办人。 投资主办人简历 袁馨 投资经理，南京大学金融与保险学系学士、北京大学国家发展研究院金融学硕士，具有四年证券从业经验，曾先后就职于天风证券股份有限公司、东证融汇证券资产管理有限公司(原东北证券股份有限公司上海分公司)，历任自营交易、投资经理助理、投资主办人。 取得基金从业资格，最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。 赵睿 投资经理，利物浦大学金融数学学士，伦敦卡斯商学院数理金融与交易硕士，曾先后任职于浙江温州鹿城农商银行和华融证券固定收益部门，历任银行自营、资管投资经理和券商资管投资主办人，长期从事一线固收交易与投资工作，具有资深固定收益投资经验。 取得基金从业资格，最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。 **二、投资主办与变更** 集合计划存续期间，若负责集合资产管理业务的投资主办人员发生变更，管理人应当以管理人网站公告方式及时向客户披露，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。	**一、资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。** **二、本计划的投资经理的资料如下：** 本计划的投资经理由【朱婷】担任。 朱婷女士,现任华鑫证券资管固定收益部投资经理，南京大学经济学学士，南京大学产业经济学硕士。曾先后任职于万家共赢资产管理有限公司和天风证券股份有限公司上海证券资产管理分公司，历任基金子公司产品项目经理、券商资管 ABS 团队高级项目经理、券商资管固收产品投资主办人。拥有 7 年资管行业从业经验，对各类资管产品具有深刻的理解，拥有丰富的固定收益投资经验。 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。 **三、投资经理与变更** 在本集合计划存续期间内，管理人可以根据需要变更投资经理。投资经理变更后，资产管理人应及时通知投资者。资产管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者通知的义务投资经理的选任与变更情况应报中国证券投资基金业协会备案。

第十六节、资产管理计划的财产

一、集合计划账户的开立 管理人或托管人按照规定开立集合计划的托管资金账户、证券账户和基金账户等投资所需账户。证券账户和基金账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。开立的上述集合计划账户与集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划募集机构和集合计划份额登记机构自有的财产账户以及其他财产账户相互独立。 托管人应为集合计划在其营业机构开立托管资金账户，资金账户名称为“资产管理计划名称”，具体账户名称以实际开立账户为准。托管人根据有关规定为委托资产开立专门用于保管货币形式存在的委托资金及清算交收的银行账户，账户预留印鉴按托管人要求办理。该账户应遵循托管人的《单位银行结	**一、集合计划账户的开立** 管理人或托管人按照规定开立集合计划的托管资金账户、证券账户和基金账户等投资所需账户。证券账户和基金账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。开立的上述集合计划账户与集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划募集机构和集合计划份额登记机构自有的财产账户以及其他财产账户相互独立。 托管人应为集合计划在其营业机构开立托管资金账户，资金账户名称为“资产管理计划名称”，具体账户名称以实际开立账户为准。托管人根据有关规定为委托资产开立专门用于保管货币形式存在的委托资金及清算交收的银行账户，账户预留印鉴按托管人要求办理。该账户应遵循托管人的

算账户管理协议》规定。集合资产管理合同签订后并以此名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司开立集合计划专用证券账户，证券账户名称应当为“管理人名称-托管人名称-资产管理计划名称”，具体账户名称以实际开立账户为准。 集合计划专用证券账户的开立由托管人负责，账户资金的管理和运用由管理人负责。 托管人按照规定开立集合计划的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益，均需通过托管账户进行。托管账户的开立和使用，仅限于满足本集合计划开展业务的需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行账户，亦不得使用本集合计划的任何银行账户进行本集合计划业务以外的活动。 因业务发展而需要开立的其他账户，应由托管人或管理人根据有关法律法规的规定开立、管理和使用。如该账户是由管理人负责开立的，管理人应保证该账户专款专用。相应的投资回款及收益，也由管理人负责及时原路划回托管账户。管理人开立此类账户后需及时通知托管人。 集合计划账户、专用交易单元由管理人报证券交易所、证券登记结算机构以及证券公司住所所在地中国证监会派出机构及中国证券业协会指定的中证资本市场发展监测中心有限责任公司或其他机构备案。 委托资产投资银行存款，管理人应与存款机构签订定期存款协议，该协议作为划款指令附件，其预留印鉴至少有一枚托管人印章，该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书、存单不得以任何方式被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书、存单后，由托管人保管证实书、存单正本。管理人应该在合理的时间内进行银行存款的投资和支取事宜。	《单位银行结算账户管理协议》规定。集合资产管理合同签订后并以此名义在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司、北京分公司开立集合计划专用证券账户，证券账户名称应当为“管理人名称-托管人名称-资产管理计划名称”，具体账户名称以实际开立账户为准。 集合计划专用证券账户的开立由托管人负责，账户资金的管理和运用由管理人负责。 托管人按照规定开立集合计划的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益，均需通过托管账户进行。托管账户的开立和使用，仅限于满足本集合计划开展业务的需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立其他任何银行账户，亦不得使用本集合计划的任何银行账户进行本集合计划业务以外的活动。 因业务发展而需要开立的其他账户，应由托管人或管理人根据有关法律法规的规定开立、管理和使用。如该账户是由管理人负责开立的，管理人应保证该账户专款专用。相应的投资回款及收益，也由管理人负责及时原路划回托管账户。管理人开立此类账户后需及时通知托管人。 集合计划账户、专用交易单元由管理人报证券交易所、证券登记结算机构以及证券公司住所所在地中国证监会派出机构及中国证券业协会指定的中证资本市场发展监测中心有限责任公司或其他机构备案。 委托资产投资银行存款，管理人应与存款机构签订定期存款协议，该协议作为划款指令附件，其预留印鉴至少有一枚托管人印章，该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书、存单不得以任何方式被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书、存单后，由托管人保管证实书、存单正本。管理人应该在合理的时间内进行银行存款的投资和支取事宜。
第十七节、投资指令的发送、确认和执行	
三、投资指令的发送、确认、执行的程序 投资指令由授权通知确定的指令发送人员代表管理人用传真、邮件的方式或托管人和管理人认可的其他方式向托管人发送（管理人的传真号码为 021-54967280，邮箱地址为 qiuwq@cfsc.com.cn、niqin@cfsc.com.cm、luowj@cfsc.com.cn、lilt@cfsc.com.cn、zangxy@cfsc.com.cn，托管人只接受此传真号码/邮箱的划款指令。若管理人传真号码/邮箱地址变更，应提前一个工作日以邮件或其他形式告知托管银行，并且获得托管行确认开始生效）。管理人有义务在发送指令后及时与托管	**三、投资指令的发送、确认、执行的程序** 投资指令由授权通知确定的指令发送人员代表管理人用传真、邮件的方式或托管人和管理人认可的其他方式向托管人发送(管理人的传真号码为 021-54967280，邮箱地址为 qiuwq@cfsc.com.cn、gaoxy@cfsc.com.cm、luowj@cfsc.com.cn、lilt@cfsc.com.cn、zhaoqian@cfsc.com.cn，托管人只接受此传真号码/邮箱的划款指令。若管理人传真号码/邮箱地址变更，应提前一个工作日以邮件或其他形式告知托管银行，并且获得托管行确

人进行电话确认，托管人确认该投资指令已成功接收之时视为送达托管人。因管理人未能及时与托管人进行投资指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，由过错方承担。托管人根据授权通知，对投资指令的预留印鉴、签字/章样本等真实性审核无误后，方可执行投资指令。	认开始生效)。管理人有义务在发送指令后及时与托管人进行电话确认，托管人确认该投资指令已成功接收之时视为送达托管人。因管理人未能及时与托管人进行投资指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，由过错方承担。托管人根据授权通知，对投资指令的预留印鉴、签字/章样本等真实性审核无误后，方可执行投资指令。
第十八节、越权交易的界定	
二、越权交易的处理程序 （一）管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权报告管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会。 （二）托管人发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同、以及托管协议约定的，应当要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行，并有权及时报告管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会。 （三）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财产所有。	**二、越权交易的处理程序** （一）违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为 托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权报告监管机构。 托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并有权报告监管机构。 管理人应向投资者和托管人主动报告越权交易。在限期内，投资者和托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对投资者和托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告监管机构。 （二）越权交易的例外 非因管理人主动投资行为导致的下列不符合投资政策的情形不构成本章所述越权交易，应当属于被动超标： （1）由于管理人之外的原因导致的投资比例出现不符合本合同约定的投资政策的情形（包括但不限于证券市场波动、上市公司或发行人合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到监管机关处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等，视投资政策中的具体约定而确定），为被动超标，不属于越权交易。发生上述情形时，管理人应在发生超标涉及的相关资产可出售、可转让或可交易之日起的20个交易日内进行调整，以达到投资政策的要求，法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。 （三）越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本计划财产所有。
	新增： **三、托管人对管理人投资运作的监督** （一）托管人对管理人投资行为监督的具体内容和标准按照本合同附件投资监督事项表（附件五）执行，若本合同第十一章节第四点、第五点的内容与投资监督事项表（附件五）不一致的，以投资监督事项表（附件五）为准。 （二）托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内，对本计划的直接投资履行监督职能。

	（三）管理人应当及时、准确、完整地向托管人提供履行投资监督所需的数据和信息，托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。 （四）如需托管人对本计划关联交易进行监督的，管理人应于合同生效前提供关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。若管理人没有及时提供关联方信息，导致托管人无法及时对关联方证券进行监督，由过错方承担相应责任。 （五）管理人与托管人应提供各自关联方名单，在合同期限内根据变化应及时更新关联方名单，并以书面形式告知。由于托管人或管理人未提供或未及时更新关联方名单导致资产管理计划遭受损失的，由过错方承担相应责任。 （六）托管人对“投资限制”中“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%”的监督仅限于管理人托管在托管人处的全部集合计划。 （七）如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的，各方除履行必要的合同变更流程外，还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。
第十九节、资产管理计划财产的估值和会计核算	
七、估值方法 估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、《证券公司金融工具估值指引》、《企业会计准则》、《指导意见》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定、资产管理计划净值计价及风险控制要求，确认和计量资产管理计划净值。 如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。 管理人应当定期对本集合计划的估值执行效果进行评估，必要时调整完善，保证公平、合理。 当有充分证据表明本集合计划相关资产的计量方法已不能真实公允反映其价值时，管理人应当与托管人进行协商，即使采用公允价值计量方法对资产管理计划净值进行调整。 （一）债券估值方法 1、在证券交易所市场挂牌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有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。 2、在证券交易所市场挂牌未实行净价交易的债券按估值日	**七、估值方法** 估值坚持公允价值计量，符合本合同、《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《指导意见》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定、资产管理计划净值计价及风险控制要求及其他法律、法规、自律组织的规定，应当按照《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》的规定，对以摊余成本计量的金融资产和分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产，以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。 估值的基本原则： (1)对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值。估值日无市价，但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的，应采用最近交易市价确定公允价值。如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化且证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，应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，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。 (2)对不存在活跃市场的投资品种，应采用市场参与者

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有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

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、在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据中债估值为主，同时参考中证估值、CFETS 估值和上清所估值等第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

5、在交易所挂牌转让的资产支持专项计划、资产支持证券，采用适当估值技术确定其公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。管理人应持续评估上述估值方法的适当性，并在情况发生变化时进行适宜的调整。

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。

7、商业银行理财计划、信托计划、保险公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、私募基金等按照最近公布的份额净值估值；如未公布产品份额净值，管理人将按照成本价估值。

（二）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。

2、持有的场外基金，估值日证券投资基金管理人提供单位净值的,按证券投资基金管理人提供的估值日单位净值估值;估值日证券投资基金管理人未提供单位净值,且从最近净值提供日到估值日整体市场环境及投资标的未发生重大变化的,可参考最近可获取的单位净值确定公允价值。

3、持有的货币市场基金，每日按基金公司公布的当日的每万份收益逐日计提收益；估值日无公布的，按最近交易日公布的每万份收益逐日计提收益估值。

4、私募投资基金，按估值日的份额净值估值，若估值日私募基金未公布份额净值，按最近公布的份额净值估值。

（三）银行定期存款或通知存款估值方法

银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日计提利息。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。

（四）逆回购以成本列示，按照预期收益率逐日计提利息。

（五）债券计提每日利息,股票红利按税后计算投资收益。

（六）如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。运用估值技术得出的结果，应反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。采用估值技术确定公允价值时，应尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数，并应通过定期校验，确保估值技术的有效性。

(3)有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，资产管理人应根据具体情况与托管人进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

（一）投资固定收益品种的估值方法

本节所指的固定收益品种，是指在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、商业银行金融债、可转换债券、中小企业私募债、证券公司短期债、资产支持证券、非公开定向债务融资工具、同业存单等债券品种。

1、交易所市场交易品种估值处理

（1）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日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；

（2）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

（3）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；

（4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券(票据)、私募债券、永续债、次级债、二级资本债，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；未公开发行上市的资产支持证券（票据）、私募债券、永续债、次级债、二级资本债，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，按成本法估值。

（5）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。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本法估值。

2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公

（七）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。 （八）当市场发生极端的流动性不足或者证券被停牌，合同终止无法变现的资产处理由合同各方根据相关法律法规，视具体情况就资产变现、估值等事宜协商解决。 （九）如管理人或托管人发现计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。 （十）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。本集合计划的会计责任方由管理人担任。	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。 3、银行间市场交易品种估值处理 （1）对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，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。 （2）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，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、基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方机构未提供估值价格的，按成本估值。 5、同一债券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； 6、货币市场基金估值方法 持有的货币市场基金，按基金管理公司公布前一估值日的每万份收益计算；估值日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值； 7、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息，在利息到账日以实收利息入账，如有差额，不做追溯调整； 8、管理人采用上述估值方法对固定收益品种进行估值，应被认为采用了适当的估值方法，但是如果管理人认为上述估值方法不能客观反应其公允价值的，管理人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形成的债券估值，管理人可以根据具体情况与托管人商定后，按最能反应其公允价值的价格估值。 相关法律法规以及监管部门有强制规定，从其规定，如有新增事项，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网站公告告知投资者； 当市场发生极端的流动性不足或者证券被停牌，合同终止无法变现的资产处理由合同各方根据相关法律法规，视具体情况就资产变现、估值等事宜协商解决。 如管理人或托管人发现集合估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益的时候，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。 根据相关法律法规，集合计划进行资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担，本集合计划的会计责任方由管理人承担，因此，就与本集合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。 暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其他原因暂停营业时，或因其他任何不可抗力致使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，管理人必须按规定完成估值工作。
第二十节、集合计划的费用与税收	
一、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式 （三）为维护集合计划财产的权利而发生的解决纠纷费用，包括但不限于诉讼费、律师费、仲裁费、诉讼差旅费、律师差率费等。	一、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式 （三）为维护集合计划财产的权利而发生的解决纠纷费用，包括但不限于诉讼费、律师费、仲裁费、诉讼差旅费、律师差旅费等。
第二十一节、资产管理计划的收益与分配	
五、收益分配的执行 资产管理计划托管人根据资产管理计划管理人的收益分配方案和提供的红利金额的数据，在收益分配日进行处理。 本集合计划的收益分配方式是红利再投资或现金分红方式。 分红资金按分红权益登记日的份额净值转成相应的集合计划单位。	**五、收益分配的执行** 资产管理计划托管人根据资产管理计划管理人的收益分配方案和提供的红利金额的数据，在收益分配日根据资产管理计划管理人的划款指令进行处理。 本集合计划的收益分配方式为投资者可选择红利再投资方式或现金分红方式。 投资者若未进行选择，则默认分红方式为：红利再投资。根据现有规则，投资者在同一销售机构处多次参与本集合计划且选择不同分红方式的，其所持有的在该销售机构处认购和申购的且未赎回的全部份额的分红方式以其最后选择的分红方式为准。 采取现金分红方式的，在该收益分配日之日起 2 个工作日内，将现金红利划转到投资者的交易账户；采取红利再投资方式的，分红资金按分红权益登记日的份额净值转成相应的集合计划单位。 收益分配由托管人将分红款划至管理人账户（管理人统一分配）。收益分配方案中需载明的内容包括但不限于收益范围、分配对象、分配原则、分配时间、分配方式等。托管人依据合同约定及管理人指令，对收益分配方案中的收益范围、分配方式、分配金额等要素进行核对。若划至管理人统一分配，托管人对于收益分配方案的复核内容仅限于对收益分配的总金额进行复核，对于在不同投资者之间分配的金额、分配顺序不承担复核义务，托管人不对向受益人划转资金本息的及时性、准确性负责。
第二十二节　　信息披露与报告	
一、定期报告 **（二）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提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。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	**一、定期报告** **（二）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提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。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。集合计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个

构。集合计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的，管理人、托管人可以不编制当期的季度报告。 报告内容需披露信息： 1、管理人履职报告； 2、托管人履职报告； 3、资产管理计划投资表现； 4、资产管理计划投资组合报告； 5、资产管理计划运用杠杆情况； 6、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式； 7、资产管理计划投资收益分配情况； 8、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； 9、中国证监会规定的其他事项。 **（三）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提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、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。集合计划成立不足3个月时，管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。 报告内容需披露信息： 1、管理人履职报告； 2、托管人履职报告； 3、资产管理计划投资表现； 4、资产管理计划投资组合报告； 5、资产管理计划运用杠杆情况； 6、资产管理计划财务会计报告； 7、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式； 8、资产管理计划投资收益分配情况； 9、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； 10、中国证监会规定的其他事项。 **（四）年度审计报告** 管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合资产管理计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向投资者披露，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。	月的，管理人、托管人可以不编制当期的季度报告。 报告内容需披露信息： 1、管理人履职报告； 2、托管人履职报告； 3、资产管理计划投资表现； 4、资产管理计划投资组合报告； 5、资产管理计划运用杠杆情况(如有)； 6、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式； 7、资产管理计划投资收益分配情况； 8、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； 9、中国证监会规定的其他事项。 **（三）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提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、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。集合计划成立不足3个月时，管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。 报告内容需披露信息： 1、管理人履职报告； 2、托管人履职报告； 3、资产管理计划投资表现； 4、资产管理计划投资组合报告； 5、资产管理计划运用杠杆情况（如有）； 6、资产管理计划财务会计报告； 7、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬等费用的计提基准、计提方式和支付方式； 8、资产管理计划投资收益分配情况； 9、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； 10、中国证监会规定的其他事项。 **（四）年度审计报告** 管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合资产管理计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向投资者披露。

二、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网站公告方式及时向客户披露，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。临时报告的情形包括但不限于： （一）集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的投资主办人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项。	**二、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网站公告方式及时向客户披露，并报送管理人住所地中国证监会派出机构。临时报告的情形包括但不限于： （一）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。
第二十三节、风险揭示	
二、一般风险： 8、合同变更风险 管理人经托管人同意后可以对本合同做出调整和补充。管理人将及时通过管理人网站或书面形式（由管理人决定）就合同变更内容向投资者征询意见。 本合同生效后，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进行变更并在管理人网站公告。投资者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 5 个工作日后生效。投资者对更新或修改的内容有异议，可在本集合计划最近一个临时开放期预约申请退出本集合计划，未在上述期间预约申请退出本集合计划的，视为同意，管理人不再另行通知。 除上述所述情形外需要变更合同的，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 个工作日内以邮件或者管理人网站公告方式（由管理人决定）向投资者发送合同变更征询意见函（或通知）。投资者应在征询意见函（或通知）指定的日期内（不得多于 5 个工作日）按指定形式回复意见。投资者不同意变更的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内即临时开放期内提出退出本集合计划的申请；投资者未在指定日期内即临时开放期内回复意见或未在指定日期内提出退出本集合计划申请的，视为投资者同意合同变更。如投资者同意变更，则变更事项自征询意见函（或通知）指定的日期届满的后一工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。	**二、一般风险：** 8、合同变更风险 管理人就合同变更征求投资者意见期间，未明确提出异议的投资者、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的投资者均视为同意合同变更。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方法或未能将变动后的联系方式及时通知管理人，从而无法及时获知合同变更事项，如投资者因上述情况未能及时退出本计划，可能会被视为同意合同变更。此外，由于监管规定调整、资管合同另有约定的情形发生时，合同亦可能变更，从而产生一定风险。
	二、一般风险： **13、投资标的风险** **新增：** （6）投资可交换债券的风险 A、可交换债券的收益波动风险 可交换债券与标的股票挂钩，其波动因素除利率风险、

	流动性风险外，还受换股价格、标的股票价格、赎回条款、向下修正条款、投资者的预期等诸多因素的影响。具有波动风险的收益包括：①持有期间获取利息，持有至到期被发行人以到期赎回价格赎回而获取的赎回收益，或在存续期内被发行人按照债券面值加应计利息赎回而获取的赎回收益；②当标的股票二级市场价格高于换股价时，通过交换股票获取二级市场价格与换股价之间差价；③在报价系统公司以高于票面价值转让的收益等。 B、股票质押担保风险 可交换债券可能采用股票质押担保方式，预备用于交换的股票及其孳息（包括送股、转股和现金红利）一并予以质押给受托管理人，用于对债券持有人交换股份和本期私募债券本息偿付提供担保；若标的股票价格大幅下跌，且发行人不对换股价格进行修正时，将影响到质押股票对债券本息偿付的最终保障效果。 C、换股风险 主要包括：①换股期内标的股票价格可能低于换股价格而影响投资收益的风险；②债券的赎回条款可能导致债券提前兑付或换股期缩短而影响投资收益的风险；③换股价格向下修正条款触发时，董事会未同意修正换股价格的风险；④预备可交换的股票被限售、冻结，或因标的股票重大事项导致暂停换股时间超过债券存续期等导致投资者无法换股的风险。 D、发行人资信风险 若由于发行人自身的相关风险或不可控制的因素，发行人的财务状况发生不利变化，导致不能按约定偿付贷款本息或在业务往来中发生严重违约行为，将可能使发行人资信状况恶化，发行人上述受限资产将可能用于对相关债权人的偿付，发行人的资产将会大幅减少，并面临集中偿付的巨大压力，届时发行人的偿债能力将严重下降，从而影响债券还本付息。 （7）可转换债券的投资风险 本资产管理计划投资于可转换公司债券（包含可分离交易可转债），无法完全规避发债主体特别是可转债、企业债和公司债的发债主体的信用质量变化造成的信用风险；如果债券市场出现整体下跌，将无法完全避免债券市场系统性风险；另外可转债的条款相对于普通债券和股票而言更为复杂，忽视这些条款导致的事件可能为本基金带来损失。例如，当可转债的价格明显高于其赎回价格时，若本资产管理计划未能在转债被赎回前转股或卖出，则可能产生不必要的损失。

二、一般风险： **17、其它风险** （三）突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划投资者利益受损。 其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形： 1、相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行。 2、无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。 3、管理人操作或者技术风险、电力故障等都可能对本集合计划的资产净值造成不利影响。 4、因集合计划业务快速发展而在人员配备、内控机制建立等方面不完善而产生的风险。 5、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险。 6、对主要业务人员如投资主办人的依赖而可能产生的风险。 7、因业务竞争压力而可能产生的风险。 8、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划投资者利益受损。 9、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致集合计划资产的损失。	**二、一般风险：** **17、其它风险** （三）突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划投资者利益受损。 其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形： 1、相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行。 2、无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。 3、管理人操作或者技术风险、电力故障等都可能对本集合计划的资产净值造成不利影响。 4、因集合计划业务快速发展而在人员配备、内控机制建立等方面不完善而产生的风险。 5、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险。 6、对主要业务人员如投资经理的依赖而可能产生的风险。 7、因业务竞争压力而可能产生的风险。 8、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划投资者利益受损。 9、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致集合计划资产的损失。
第二十四节、资产管理合同的变更、终止与清算	
一、合同的补充、修改与变更 （一）本合同生效后，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进行变更并在管理人网站公告。投资者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5个工作日后生效。投资者对更新或修改的内容有异议，可在本集合计划最近一个临时开放期预约申请退出本集合计划，未在上述期间预约申请退出本集合计划的，视为同意，管理人不再另行通知。 （二）除上述（一）所述情形外需要变更合同的，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个工作日内以邮件或者管理人网站公告方式（由管理人决定）向投资者发送合同变更征询意见函（或通知）。投资者应在征询意见函（或通知）指定的日期内（不得多于5个工作日）按指定形式回复意见。投资者不同意变更的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内即临时开放期内提出退出本集合	**一、资产管理合同的变更** 1、以下事项可由管理人自行决定变更，其中（1）、（2）两项管理人需于变更生效将变更公告提前发送托管人： （1）调低管理人的报酬标准； （2）调低参与费、退出费的费率； （3）投资经理的变更； 2、各方书面一致同意，以下事项可由管理人和托管人协商后变更： （1）调低托管人的报酬标准； （2）因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券投资基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订，或相关监管机构或自律组织对本集合计划备案补正意见的要求涉及到合同修改的，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，或根据相关监管机构或自律组织备案补正意见的要求对本合同及说明书进行修改，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五个工作日后生效；

计划的申请；投资者未在指定日期内即临时开放期内回复意见或未在指定日期内提出退出本集合计划申请的，视为投资者同意合同变更。如投资者同意变更，则变更事项自征询意见函（或通知）指定的日期开始生效，对合同各方均具有法律效力。 （三）全体投资者、管理人和托管人协商一致并签署补充协议后，也可对本合同内容进行变更。 （四）合同变更后，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。 （五）投资者、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。 （六）本合同对应的托管协议是指《华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划托管协议》（以实际签署为准）。本计划托管人为广发银行股份有限公司，托管人根据本合同和《托管协议》的约定履行托管职责。	（3）法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。 3、除前文第 1 项、第 2 项所述之外的其余事项如需发生变更的，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 个工作日内以管理人指定网站公告或邮寄等方式向投资者发送合同变更征询意见函。投资者不同意变更的，应在征询意见函发出后的最近一个开放期或管理人设置的合同变更临时开放期内（以下统称“指定开放期”）提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意合同变更。投资者不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排： 投资者不同意变更的，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投资者，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（退出价格为退出当日的计划份额净值）。 投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致后变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。 合同变更于指定开放期结束后的第一个工作日起生效，公告内容即成为本合同组成部分。 特别约定：在本集合计划投资者人数少于 3 名（含 3 名）的情况下，经全体投资者、管理人、托管人同意，也可通过签署补充协议的方式进行合同变更，采用该等方式变更合同的，可不受上述合同变更程序限制。 资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者和托管人同意，并履行合同变更程序。 4. 全体投资者、管理人和托管人协商一致并签署补充协议后，也可对本合同内容进行变更，但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。 5. 合同变更后，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。 6. 投资者、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。 本合同发生变更的，管理人应自合同变更之日起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案。
	新增： **二、集合计划的展期** （一）资产管理计划展期应符合以下条件： 1. 本计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定； 2. 本计划展期没有损害投资者利益的情形； 3. 中国证监会规定的其他条件。 （二）本计划展期的，应当符合本计划的成立条件。 （三）展期的程序与期限

	1．展期的公告 集合计划符合展期条件拟展期且管理人和托管人达成一致，管理人在管理人网站上公告，管理人将同时公告集合计划的具体展期方案。 2．投资者答复 投资者应根据管理人指定网站上公告要求在规定的期限内明确意见。若投资者明确回复同意本集合计划展期或未回复意见的，视为同意展期；投资者明确回复不同意本集合计划展期的，视为不同意展期。 3．投资者不同意展期的处理办法 若投资者明确回复不同意展期，投资者有权按照管理人公告内容在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续或按本合同规定办理集合计划份额转让手续；若投资者未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理本计划份额退出、转让手续，则由管理人决定对上述份额于存续期届满之日做自动退出处理。若投资者未回复意见或回复意见不明确的，并未在上述期限内办理转让或退出手续，视为不同意展期，管理人不再另行通知确认。 4．展期的实现 如果同意计划展期的投资者人数不少于 2 人，则本计划存续期将依法展期；如果同意计划展期的各投资者人数低于 2 人，则本计划到期终止，管理人将按照本合同约定办理计划到期终止和清算事宜。 5.展期情况备案 本集合计划展期后 5 个工作日内，管理人将展期情况公告并按照法律法规要求报相关监管机构或自律组织等备案（如需）。
三、集合计划的清算 （一）自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师组成。清算小组可以聘请必要的工作人员。集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算。 集合计划清算小组负责本集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划清算小组可以依法以集合计划的名义进行必要的民事活动。 （二）清算过程中有关重大事项应当及时公布。 （三）清算结束后 7 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分派给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。 （四）清算结束后 15 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果或书面通知投资者清算结果。管理人应当在清算结束后 5 日内将清算结果报监管机构备案。	**四、集合计划的清算** （一）自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人组成。清算小组可以聘请必要的工作人员。集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算。 集合计划清算小组负责本集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划清算小组可以依法以集合计划的名义进行必要的民事活动。 （二）清算过程中有关重大事项应当及时公布。 （三）清算结束后 7 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分派给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。 （四）清算结束后 15 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果或书面通知投资者清算结果。管理人应当在清算结束后 5 日内将清算报告报基金业协会备

（五）若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。 管理人应根据二次清算方案的规定，对该部分未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，将变现后的资产扣除相关费用后按照投资者拥有份额的比例，以货币形式全部分配给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。在进行二次清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。未返还投资者的计划资产照常计提管理费及托管费。 对于由计划交纳、注册登记机构收取的最低结算备付金和交易单元保证金，在注册登记机构对其进行调整交收日才能收回，届时，集合计划清算小组将及时按照投资者拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分配给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。 （六）管理人需向托管人提供清算分配所需资料，托管人据此复核。 （七）清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，由清算小组从集合计划资产中支付。 资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。	案。 （五）若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。 管理人应根据二次清算方案的规定，对该部分未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，将变现后的资产扣除相关费用后按照投资者拥有份额的比例，以货币形式全部分配给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。在进行二次清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。未返还投资者的计划资产照常计提管理费及托管费。 对于由计划交纳、注册登记机构收取的最低结算备付金和交易单元保证金，在注册登记机构对其进行调整交收日才能收回，届时，集合计划清算小组将及时按照投资者拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以货币资金的形式全部分配给投资者，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。 （六）管理人需向托管人提供清算分配所需资料，托管人据此复核。 （七）清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，由清算小组从集合计划资产中支付。 资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。
第二十六节、争议的处理	
争议的处理 因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商、调解解决，协商、调解不能解决的，则任何一方有权将争议提交本协议签署地（上海市徐汇区宛平南路）有管辖权的人民法院进行诉讼。争议处理期间，合同当事人仍应履行本合同规定的义务，维护资产投资者的合法权益。 诉讼费用由败诉方承担。	**争议的处理** 因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商、调解解决，协商、调解不能解决的，则任何一方有权将争议提交向上海国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁，以该会当时有效的仲裁规则为准，仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担；争议处理期间，合同当事人仍应履行本合同规定的义务，维护资产投资者的合法权益。
第二十八节、管理人自有资金参与集合计划	**本章节合并至 第八节、资产管理计划的参与、退出与转让 第五项：五、管理人以自有资金参与本计划**
第二十九节、集合计划的展期	**本章节合并至 第二十四节、资产管理合同的变更、终止与清算 第二项：二、集合计划的展期**

第二十八节、其他事项

管理人、托管人确认，已向投资者明确说明集合计划的风险，不保证投资者资产本金不受损失或者取得最低收益；投资者确认，已充分理解本合同的内容，自行承担风险和损失。

本合同应由投资者本人签署，当投资者为机构时，应由法定代表人/负责人或者其授权代表签署。

本合同一式肆份，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，每份均有同等法律效力。投资者签署电子合同，电子合同与纸质合同具有同等法律效力。

一、本合同各方当事人应对签署和履行本合同过程中所接触和获取的其他方当事人的数据、信息和其它涉密信息承担保密义务，非经其他方当事人同意，不得以任何方式向第三人泄露或用于非本合同之目的（法律法规或司法监管部门要求的除外）。本保密义务不因合同终止而终止。

二、如将来监管部门对本合同的内容与格式有其他要求的，投资者、管理人和托管人应立即展开协商，根据监管相关要求修改本合同的内容和格式。

三、本合同一式肆份，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，每份均有同等法律效力。投资者签署电子合同，电子合同与纸质合同具有同等法律效力。

管理人、托管人确认，已向投资者明确说明集合计划的风险，不保证投资者资产本金不受损失或者取得最低收益；投资者确认，已充分理解本合同的内容，自行承担风险和损失。

本合同应由投资者本人签署，当投资者为机构时，应由法定代表人/负责人或者其授权代表签署。

（以下无正文）

附件二、管理人关联方名单

华鑫证券有限责任公司主要关联关系信息表

持有本公司5%以上股份的股东情况		
序号*	名称	营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构）/身份证号（个人）/护照号（外籍个人）
1	上海华鑫股份有限公司	9131000013220382XX
本公司的控股股东情况		
序号*	名称	营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构）/身份证号（个人）/护照号（外籍个人）
1	上海华鑫股份有限公司	9131000013220382XX
本公司的控股股东控制的其他子公司情况		
序号*	名称	营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构）

华鑫证券有限责任公司主要关联关系信息表

持有本公司5%以上股份的股东情况		
序号	名称	营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构）/身份证号（个人）/护照号（外籍个人）
1	上海华鑫股份有限公司	9131000013220382XX
本公司的控股股东情况		
1	上海华鑫股份有限公司	9131000013220382XX
本公司的控股股东控制的其他子公司情况		
序号	名称	营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构）
1	上海金欣联合发展有限公司	91310101132352737T
2	上海金陵投资有限公司	91310115132310625R
3	上海择励实业有限公司	91310230057678883Q

1	上海金欣联合发展有限公司	91310101132352737T
2	上海金陵投资有限公司	91310115132310625R
3	上海择励实业有限公司	91310230057678883Q
4	上海普林电路板有限公司	310104000015714
5	上海普林电子有限公司	310000400435444
6	上海鑫敦实业有限公司	9131023008009785XR
7	上海力敦行房地产经纪有限公司	91310115787820407L
8	华鑫思佰益融资租赁（上海）有限公司	91310000MA1FL02T7J
9	上海鑫之众投资管理有限公司	91310000MA1FL3EG5U
10	上海全创信息科技有限公司	91310104MA1FRJB1XP
11	烟台山基金小镇（烟台）运营管理有限公司	91370602MA3QWYREXU
12	天津东疆基金管理有限公司	91120118MA06EA4NX9

本公司的控股子公司及本公司能够实施重大影响的其他公司情况

序号*	名称	营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构）
1	华鑫期货有限公司	91310000132110746J
2	华鑫证券投资有限公司	913100000841449245
3	华鑫宽众投资有限公司	91310000351133569C
4	摩根士丹利华鑫证券有限责任公司（49%）	913100007178847982
5	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	91440300746637454W

4	上海普林电路板有限公司	310104000015714
5	上海普林电子有限公司	310000400435444
6	上海鑫敦实业有限公司	9131023008009785XR
7	上海力敦行房地产经纪有限公司	91310115787820407L
8	华鑫思佰益融资租赁（上海）有限公司	91310000MA1FL02T7J
9	上海鑫之众投资管理有限公司	91310000MA1FL3EG5U
10	上海全创信息科技有限公司	91310104MA1FRJB1XP
11	烟台山基金小镇（烟台）运营管理有限公司	91370602MA3QWYREXU
12	天津东疆基金管理有限公司	91120118MA06EA4NX9

本公司的控股子公司及本公司能够实施重大影响的其他公司情况

序号	名称	营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构）
1	华鑫期货有限公司	91310000132110746J
2	华鑫证券投资有限公司	913100000841449245
3	华鑫宽众投资有限公司	91310000351133569C
4	摩根士丹利证券（中国）有限公司	913100007178847982
5	摩根士丹利华鑫基金管理有限公司	91440300746637454W

附件三、托管人关联方名单

以下为前十大股东名单（关联方）：

序号	关联方名称
1	中国人寿保险股份有限公司
2	国网英大国际控股集团有限公司
3	中信信托有限责任公司
4	江西省高速公路投资集团有限责任公司
5	中航投资控股有限公司
6	广东粤财投资控股有限公司
7	华晨汽车集团控股有限公司
8	江苏苏钢集团有限公司
9	香江集团有限公司
10	北京能源集团有限责任公司

托管人详细关联方信息也可查询广发银行官方网站披露的年报。

以下为前十大股东名单（关联方）（关联方名单以托管人年报及托管人公告为准）：

广发银行最新关联方名单(2022 年)		
序号	关联方名称	关联关系
1	中国人寿保险股份有限公司	控股股东
2	中信信托有限责任公司	大股东
3	国网英大国际控股集团有限公司	主要股东
4	江西省高速公路投资集团有限责任公司	主要股东
5	财政部	主要股东
6	中航投资控股有限公司	股东
7	广东粤财投资控股有限公司	股东
8	华晨汽车集团控股有限公司	股东
9	江苏苏钢集团有限公司	股东
10	香江集团有限公司	股东
11	北京能源集团有限责任公司	股东
12	广银理财有限责任公司	全资子公司

附件四、预留印鉴授权书

华鑫证券有限责任公司（作为管理人）、广发银行股份有限公司（作为托管人）已签署编号为 HXXG-2020 第 1-1 号的《华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划资产管理合同》。以下为管理人的预留印鉴，该印鉴用于集合资产管理业务运作过程中用于业务往来确认所盖印章的预留印鉴。

华鑫证券有限责任公司（作为管理人）、广发银行股份有限公司（作为托管人）已签署编号为 HXXG-2020 第 1-1-2023 的《华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划资产管理合同》。以下为管理人的预留印鉴，该印鉴用于集合资产管理业务运作过程中用于业务往来确认所盖印章的预留印鉴。

附件五、投资监督事项表

（二）本计划的投资比例和投资限制

1、本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例如下所列：

现金类资产市值占集合计划总资产的 0-100%。

固定收益类资产市值占集合计划总资产的 80-100%。

债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的 0-100%。

2、投资限制（占集合计划资产总值）

（1）投资标准信用债债项评级为 AA（含）以上（资产支持证券（票据）、可转债和可交换债除外），若无债项评级，主体评级或担保机构评级需为 AA（含）以上，且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考；

（2）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，所申报的金额不得超过集合计划总资产，

（二）本计划的投资比例和投资限制

1、本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例如下所列：

现金类资产市值占集合计划总资产的 0-100%。

固定收益类资产市值占集合计划总资产的 80-100%。

债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的 0-100%。

2、投资限制（占集合计划资产总值）

（1）投资标准信用债债项评级为 AA（含）以上（资产支持证券（票据）、可转债和可交换债除外），若无债项评级，主体评级或担保机构评级需为 AA（含）以上，且对中债资信评估有限公司，以及惠誉、标普等境外评级信息不予参考；

（2）本计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司

所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量； （3）本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过 200%。计算单个资产管理计划的总资产按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。 （4）按照穿透原则合并计算，投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产 80%； （5）本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；资产管理人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。 （6）本计划不得投资于资产支持证券次级，仅限投资在交易所和银行间的资产支持证券。投资标的遵循法律法规对产品嵌套的要求。 （7）法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。	债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过集合计划总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量； （3）本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过 200%。计算单个资产管理计划的总资产按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。 （4）按照穿透原则合并计算，投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产 80%； （5）本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；资产管理人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。 （6）本计划不得投资于资产支持证券次级，仅限投资在交易所和银行间的资产支持证券。投资标的遵循法律法规对产品嵌套的要求，其基础资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产。 （7）法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。
三、投资禁止 本计划财产禁止从事下列行为： ① 不得承销证券； ② 不得将计划资产用于对外担保等用途； ③ 不得将计划资产用于可能承担无限责任的投资； ④ 不得从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动； ⑤ 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他活动。	**（三）投资禁止** （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，由管理人负责监控； （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，由管理人负责监控； （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，由管理人负责监控； （6）使用集合计划资产进行不必要的交易； （7）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； （8）承销证券； （9）向他人贷款或融资提供担保，由管理人负责监控； （10）利用产品为集合计划投资者之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送； （11）不得直接投资商业银行信贷资产；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； （12）不得直接或者间接投资法律、行政法规和国家产业政策、环保政策禁止投资的行业或领域（证券市场投资除外）。包括但不限于： 1）投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录； 2）投资项目违反国家相关环境保护政策要求； 3）通过穿透核查，最终投向上述投资项目； （13）法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

三、本计划托管人对本次合同变更的意见

托管人广发银行股份有限公司通过签署《华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXXG-2020 第 1-1 号-2023）同意本次合同变更事宜。

四、向全体投资者征询意见及后续安排

根据《华鑫鑫国 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号:HXXG-2019 第 1-1 号）第二十四节第一条第（二）项“（二）除上述（一）所述情形外需要变更合同的，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 个工作日内以邮件或者管理人网站公告方式（由管理人决定）向投资者发送合同变更征询意见函（或通知）。投资者应在征询意见函（或通知）指定的日期内（不得多于 5 个工作日）按指定形式回复意见。投资者不同意变更的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内即临时开放期内提出退出本集合计划的申请；投资者未在指定日期内即临时开放期内回复意见或未在指定日期内提出退出本集合计划申请的，视为投资者同意合同变更。如投资者同意变更，则变更事项自征询意见函（或通知）指定的日期开始生效，对合同各方均具有法律效力。”之约定。

本征询意见函及临时开放期设置公告将通过管理人网站公告向各投资者征询意见。我司将设置临时开放期合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利，临时开放期为【2023】年【2】月【17】日，共 1 个工作日。

投资者应在临时开放期内以邮件形式回复意见并发送至我司邮箱：zcglb@cfsc.com.cn

投资者不同意变更的，可在临时开放期内提出退出本集合计划的申请；投资者未在临时开放期内回复意见或未在临时开放期内提出退出本集合计划申请的，视为投资者同意合同变更。如投资者同意变更，则变更事项自征询意见函（或通知）指定的日期届满的后一工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。

五、合同变更的效力及生效时间

本征询意见函及临时开放期设置公告构成变更后合同的组成部分，变更后的合同将于【2023】年【2】月【20】日（含）正式生效。

如有疑问，请拨打客服热线：95323。

特此公告。

华鑫证券有限责任公司

2023 年 2 月 15 日