

《东方财富证券双享FOF集合资产管理计划资产管理合同》

变更公告

尊敬的投资者：

由东方财富证券股份有限公司（以下简称“我公司”）担任管理人、宁波银行股份有限公司担任托管人的东方财富证券双享FOF集合资产管理计划（以下简称“本计划”）自成立以来，坚持规范运作，稳健运营。根据中国证监会2023年1月13日修订并将于2023年3月1日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（简称“管理办法”）及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（简称“运作规定”）、中国证券投资基金业协会2022年12月30日发布并将于2023年3月31日起施行的《关于固定收益品种的估值处理标准》等相关法律法规及有关规定的变化，我公司拟对《东方财富证券双享FOF集合资产管理合同》进行变更，具体变更内容见附件《东方财富证券双享FOF集合资产管理计划资产管理合同变更对照表》。

根据《东方财富证券双享FOF集合资产管理计划资产管理合同》第二十四部分第（一）款“资产管理合同的变更”相关约定，我公司与托管人已对资产管理合同变更内容协商一致，现对合同变更内容向全体投资者公告。本次变更内容将于2023年3月1日起生效。投资者对合同变更内容有异议的，可在本合同变更生效前的最近一次退出开放日（即2023年2月28日）申请退出本计划。

投资者可通过本公司官网（www.18.cn）或本集合计划推广营业部网点了解本次公告情况。如有任何疑问，请咨询本集合计划推广机构网点工作人员。

衷心感谢您一直以来对我司产品的大力支持。

特此公告。



附件：《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划资产管理合同变更对照表》

东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划

资产管理合同变更对照表

根据中国证监会 2023 年 1 月 13 日修订并将于 2023 年 3 月 1 日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(简称“管理办法”)及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(简称“运作规定”)、中国证券投资基金业协会 2022 年 12 月 30 日发布并将于 2023 年 3 月 31 日起施行的《关于固定收益品种的估值处理标准》等相关法律法规及有关变化,《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称《资产管理合同》)本次合同变更内容对照如下:

1、对《资产管理合同》全文相关表述作如下调整:

变更前	变更后
委托财产/委托资产/委托资金	受托财产/受托资产/参与资金
委托人	投资者
基金销售资格	公开募集证券投资基金销售资格
商品及金融衍生品	期货和衍生品
具有证券相关业务资格的会计师事务所	符合《证券法》规定的会计师事务所
国务院同意设立的交易场所	依法设立的交易场所

2、对《资产管理合同》项下第 1 部分“前言”第一段、第五段作如下变更:

变更前	变更后
<p>为规范东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划(以下简称“本计划”或“本集合计划”)运作,明确《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国电子签名法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《基金募集机构投资者适当性管理实施指引(试行)》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作规定》,与前述《管理办法》合并简称《资管细则》)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式</p>	<p>为规范东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划(以下简称“本计划”或“本集合计划”)运作,明确《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国期货和衍生品法》、《中华人民共和国电子签名法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引(试行)》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作规定》,与前述《管理办法》合并简称《资管细则》)、《集合资产管理计划</p>

<p>指引（试行）》等法律法规、中国人民银行、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定，委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照上述法律法规的相关规定、《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划说明书》（以下简称说明书）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p>	<p>资产管理合同内容与格式指引（试行）》等法律法规、中国人民银行、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定，投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照上述法律法规的相关规定、《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划说明书》（以下简称说明书）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p>
<p>管理人对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为按要求向证券投资基金业协会进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。</p>	<p>管理人对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为按要求向证券投资基金业协会进行备案。</p>

3、对《资产管理合同》项下第 2 部分“释义”的“风险揭示书”、“投资者”、“7 个工作日可变现资产”释义作如下变更：

变更前	变更后
<p>风险揭示书：指《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划风险揭示书》。</p>	<p>风险揭示书：指《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划风险揭示书》。风险揭示书应当作为本合同附件交由投资者签字确认。</p>
<p>投资者：指依据本合同参与本计划的合格投资者。即具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额（金额按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等现行有效的相关法律法规要求确定）且符合下列条件的自然人、法人或其他组织：（一）具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：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（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；（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</p>	<p>投资者：指依据本合同参与本计划的合格投资者。即具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额（金额按照《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等现行有效的相关法律法规要求确定）且符合下列条件的自然人、法人或其他组织：（一）具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：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、基金公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、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；</p>

<p>金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；（六）中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p>	<p>（五）基本养老金、社会保障基金、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。</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>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、期货及标准化期权合约和同业存单，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>

4、对《资产管理合同》项下第 5 部分第（五）款第 2 条“投资比例”作如下变更：

变更前	变更后
<p>2、投资比例：</p> <p>（1）按照穿透原则合并计算，投资于固定收益类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 80%；</p> <p>（2）按照穿透原则合并计算，投资于权益类类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 80%；</p> <p>（3）按照穿透原则合并计算，投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不超过资产管理计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%；</p> <p>（4）投资于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合计不低于 80%；</p> <p>（5）本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%。本集合计划投资于资产管理产品时，计算本集合计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。</p> <p>（6）本集合计划投资于除公募基金外的资产管理产品时，本集合计划按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合法律法规、监管规则的相关规定。</p> <p>因证券市场波动、上市公司合并、本计划规模变动等资产管理人之外的因素致使本计划投资不符合上述规定的比例，资产管理人应当在 15 个工作日内调整完毕。</p>	<p>2、投资比例：</p> <p>（1）按照穿透原则合并计算，投资于固定收益类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 80%；</p> <p>（2）按照穿透原则合并计算，投资于权益类类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 80%；</p> <p>（3）按照穿透原则合并计算，投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例不超过资产管理计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%；</p> <p>（4）投资于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合计不低于 80%；</p> <p>（5）本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%。本集合计划投资于资产管理产品时，计算本集合计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产；</p> <p>（6）若本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过本计划净资产 50%，本计划的总资产不得超过本计划净资产的 120%；本计划投资于国债、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不受前述规定限制；</p> <p>（7）本集合计划投资于除公募基金外的资产管理产品时，本集合计划按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合法律法规、监管规则的相关规定。</p>

	如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等非证券公司主观因素,造成集合计划投资比例突破上述比例限制的,管理人应在突破比例限制之日起,在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的20个交易日内将投资比例调整至符合要求,确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的,资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。
--	---

5、对《资产管理合同》项下第5部分第(十三)款第(3)条“临时开放期”作如下变更:

变更前	变更后
<p>(3) 临时开放期: 本计划管理人自有资金参与比例超标或本合同发生变更(或展期)时,管理人有权设置临时开放期,退出管理人自有资金使其参与比例符合本合同约定,保障合同变更异议投资者退出的权利,临时开放期的设置以届时管理人发布的公告为准。</p>	<p>(3) 临时开放期: 当发生如下情形时,管理人有权设置临时开放期: ①本计划管理人自有资金参与比例超标时,设置临时开放期供管理人自有资金退出使其参与比例符合本合同约定; ②本合同发生变更(或展期)时,设置临时开放期保障合同变更异议投资者退出的权利; ③发生符合本合同约定的其它情形时,设置临时开放期保障投资者退出的权利。临时开放期的退出份额不受锁定期限制。临时开放期的具体设置以届时管理人发布的公告为准,管理人在管理人网站发布公告即视为履行了告知义务。</p>

6、对《资产管理合同》项下第6部分第(三)款第2条“管理人的义务”作如下变更:

变更前	变更后
<p>2、管理人的义务</p> <p>(1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜;</p> <p>(2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息;</p> <p>(3) 在集合计划投资管理活动中恪尽职守,履行诚实信用、谨慎勤勉的义务,以专业技能管理集合计划的资产,为委托人的最大利益服务,依法保护委托人的财产权益;</p> <p>(4) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估,向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金;</p> <p>(5) 制作风险揭示书,向投资者充分揭示相关风险;</p> <p>(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产;</p>	<p>2、管理人的义务</p> <p>(1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜;</p> <p>(2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息;</p> <p>(3) 在集合计划投资管理活动中恪尽职守,履行诚实信用、谨慎勤勉的义务,以专业技能管理集合计划的资产,为投资者的最大利益服务,依法保护投资者的财产权益;</p> <p>(4) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估,向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金;</p> <p>(5) 制作风险揭示书,向投资者充分揭示相关风险;</p> <p>(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产;</p>

<p>(7) 建立健全的内部管理制度, 保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立, 对所管理的不同财产分别管理, 分别记账, 分别投资; 聘请投资顾问的, 应制定相应利益冲突防范机制;</p> <p>(8) 除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外, 不得为管理人及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人运作资产管理计划财产;</p> <p>(9) 本集合资产管理计划采用银行结算模式, 管理人负责集合资产管理计划会计核算业务, 编制集合资产管理计划财务报告, 并接受托管人的复核;</p> <p>(10) 公平对待所管理的不同财产, 不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动; 在与关联方发生交易行为时, 保证对关联方及非关联方公平对待;</p> <p>(11) 除规定情形或符合规定条件外, 不得为管理人、托管人及其关联方提供融资;</p> <p>(12) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督;</p> <p>(13) 按本合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值;</p> <p>(14) 按约定出具管理报告, 保证委托人能够及时了解有关集合计划资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息;</p> <p>(15) 保守集合计划的商业秘密, 在集合计划有关信息向委托人披露前, 不泄露集合计划的投资安排、投资意向等信息(法律、行政法规、中国证监会另有规定或相关司法部门、监管机构另有要求的除外);</p> <p>(16) 按照本合同及说明书约定确定收益分配方案, 及时向委托人分配集合计划的收益;</p> <p>(17) 按照有关法律、行政法规、中国证监会有关规定、本合同及说明书的约定, 指定注册与过户登记人办理集合计划的开户登记事务及其他与注册登记相关的手续;</p> <p>(18) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及说明书的约定, 及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项;</p> <p>(19) 妥善保存与集合计划有关的合</p>	<p>(7) 建立健全的内部管理制度, 保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立, 对所管理的不同财产分别管理, 分别记账, 分别投资; 聘请投资顾问的, 应制定相应利益冲突防范机制;</p> <p>(8) 除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外, 不得为管理人及任何第三人谋取利益, 不得委托第三人运作资产管理计划财产;</p> <p>(9) 本集合资产管理计划采用银行结算模式, 管理人负责集合资产管理计划会计核算业务, 编制集合资产管理计划财务报告, 并接受托管人的复核;</p> <p>(10) 公平对待所管理的不同财产, 不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动; 在与关联方发生交易行为时, 保证对关联方及非关联方公平对待;</p> <p>(11) 除规定情形或符合规定条件外, 不得为管理人、托管人及其关联方提供融资;</p> <p>(12) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督;</p> <p>(13) 按本合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值;</p> <p>(14) 按约定出具管理报告, 保证投资者能够及时了解有关集合计划资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息;</p> <p>(15) 保守集合计划的商业秘密, 在集合计划有关信息向投资者披露前, 不泄露集合计划的投资安排、投资意向等信息(法律、行政法规、中国证监会另有规定或相关司法部门、监管机构另有要求的除外);</p> <p>(16) 按照本合同及说明书约定确定收益分配方案, 及时向投资者分配集合计划的收益;</p> <p>(17) 按照有关法律、行政法规、中国证监会有关规定、本合同及说明书的约定, 指定注册与过户登记人办理集合计划的开户登记事务及其他与注册登记相关的手续;</p> <p>(18) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及说明书的约定, 及时向申请退出集合计划的投资者支付退出款项;</p> <p>(19) 妥善保存与集合计划有关的合</p>
--	--

<p>同、协议、推介文件、客户资料、交易记录、会计账册等文件、资料和数据，保存期不少于20年；</p> <p>(20) 在集合计划终止或因其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；</p> <p>(21) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；</p> <p>(22) 因管理人违反本合同导致集合计划财产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；</p> <p>(23) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；</p> <p>(24) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；</p> <p>(25) 管理人如接受其股东、实际控制人或其他与管理人具有关联方关系的自然人、法人或者组织为本计划委托人的，管理人按照管理人内部的有关制度规定，对上述客户的账户进行监控，并对客户身份、合同编号、委托资产净值、委托期限、累计收益率等信息进行集中保管；</p> <p>(26) 经委托人同意，管理人可以将委托资产投资于管理人、托管人及其控股股东、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，并应当事后将相关信息告知投资者和托管人，但托管人未能事前就其关联方名单及相关证券名单明确告知管理人致使本计划发生违规投资行为的，管理人不承担任何责任。</p> <p>(27) 召集资产管理计划份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；</p> <p>(28) 对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；</p> <p>(29) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；</p> <p>(30) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；</p> <p>(31) 根据法律法规与资产管理合同的</p>	<p>同、协议、推介文件、客户资料、交易记录、会计账册等文件、资料和数据，保存期不少于20年；</p> <p>(20) 在集合计划终止或因其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和投资者资金的返还事宜；</p> <p>(21) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；</p> <p>(22) 因管理人违反本合同导致集合计划财产损失或损害投资者合法权益时，应承担赔偿责任；</p> <p>(23) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；</p> <p>(24) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；</p> <p>(25) 管理人如接受其股东、实际控制人或其他与管理人具有关联方关系的自然人、法人或者组织为本计划投资者的，管理人按照管理人内部的有关制度规定，对上述客户的账户进行监控，并对客户身份、合同编号、受托资产净值、期限、累计收益率等信息进行集中保管；</p> <p>(26) 经投资者同意，管理人可以将受托资产投资于管理人、托管人及其控股股东、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，并应当事后将相关信息告知投资者和托管人，但托管人未能事前就其关联方名单及相关证券名单明确告知管理人致使本计划发生违规投资行为的，管理人不承担任何责任。</p> <p>(27) 召集资产管理计划份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；</p> <p>(28) 对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；</p> <p>(29) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；</p> <p>(30) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；</p> <p>(31) 根据法律法规与资产管理合同的</p>
--	---

<p>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;</p> <p>(32) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项;</p> <p>(33) 建立并保存投资者名单;</p> <p>(34) 组织并参加资产管理计划财产清算小组,参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配;</p> <p>(35) 管理人应当按照《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》等相关规定向托管人提供本计划最高额度相关信息。</p> <p>(36) 法律法规、中国证监会有关规定和本合同及说明书约定的其他义务。</p>	<p>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;</p> <p>(32) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项;</p> <p>(33) 建立并保存投资者名单;</p> <p>(34) 组织并参加资产管理计划财产清算小组,参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配;</p> <p>(35) 管理人应当按照《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》等相关规定向托管人提供本计划最高额度相关信息。</p> <p>(36) 保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户;</p> <p>(37) 法律法规、中国证监会有关规定和本合同及说明书约定的其他义务。</p>
--	---

7、对《资产管理合同》项下第6部分第(四)款第1条“托管人的权利”第(3)点作如下变更:

变更前	变更后
<p>(3) 按照法律法规及本合同的约定监督管理人的投资行为,发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规和其他有关规定的,或违反本合同约定的,应当拒绝执行,并向管理人注册地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告;</p>	<p>(3) 按照法律法规及本合同的约定监督管理人的投资行为,发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规和其他有关规定的,或违反本合同约定的,应当拒绝执行,并向管理人注册地中国证监会派出机构报告;</p>

8、对《资产管理合同》项下第6部分第(四)款第2条“托管人的义务”第(14)、(15)点作如下变更:

变更前	变更后
<p>(14) 监督管理人的投资运作,发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的,应当拒绝执行,立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和中国证券投资基金业协会;</p>	<p>(14) 监督管理人的投资运作,发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的,应当拒绝执行,立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构;</p>
<p>(15) 投资于《管理办法》第三十七条第(五)项规定资产时,准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责,并向投资者充分揭示;</p>	<p>(15) 投资于《管理办法》第三十八条第(五)项规定资产时,准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责,并向投资者充分揭示;</p>

9、对《资产管理合同》项下第7部分第(一)款第2至7段:

变更前	变更后
<p>合格投资者指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额（金额按照《指导意见》等现行相关法律法规要求确定）且符合下列条件的自然人、法人或其他组织：</p> <p>1、具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：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；</p> <p>2、最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；</p> <p>3、依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>4、基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；</p> <p>5、中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p>	<p>合格投资者指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额（金额按照《指导意见》等现行相关法律法规要求确定）且符合下列条件的自然人、法人或其他组织：</p> <p>1、具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：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；</p> <p>2、最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；</p> <p>3、依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、商业保理子公司、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；</p> <p>4、基本养老金、社会保障基金、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）；</p> <p>5、中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p>

10、对《资产管理合同》项下第8部分第（一）款第（4）条“临时开放期的触发条件、程序及披露等安排”作如下变更：

变更前	变更后
<p>(4) 临时开放期的触发条件、程序及披露等安排</p> <p>当本计划管理人自有资金参与比例超标或本合同发生变更（或展期）时，管理人有权设置临时开放期，退出管理人自有资金使其参与比例符合本合同约定，保障合同变更异议投资者退出的权利，临时开放期的设置以届时管理人发布的公告为准。</p>	<p>(4) 临时开放期的触发条件、程序及披露等安排</p> <p>当发生如下情形时，管理人有权设置临时开放期：①本计划管理人自有资金参与比例超标时，设置临时开放期供管理人自有资金退出使其参与比例符合本合同约定；②本合同发生变更（或展期）时，设置临时开放期保障合同变更异议投资者退出的权利；③发生符合本合同约定的其它情形时，设置临时开放期保障投资者退出的权利。临时开放期的具体设置以届时管理人发布的公告为准，管理人在管理人网站发布公告即视为履</p>

行了告知义务。

11、对《资产管理合同》项下第9部分“管理人及其附属机构自有资金参与情况”第(二)、(三)款作如下变更、删除第(五)款内容并入第(二)款：

变更前	变更后
<p>(二) 管理人自有资金参与、退出的条件和期限</p> <p>在同时满足以下条件时，管理人自有资金可以参与、退出本集合计划：</p> <p>1、管理人以自有资金参与集合计划的份额持有期限不得少于6个月；</p> <p>2、管理人在存续期内以自有资金参与、退出集合计划时，应当提前5个工作日告知委托人和资产托管机构。</p> <p>但为应对巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，但需事后及时告知委托人和托管人。</p>	<p>(二) 管理人自有资金参与、退出的条件和期限</p> <p>1、在同时满足以下条件时，管理人自有资金可以参与、退出本集合计划：</p> <p>(1) 管理人以自有资金参与和退出本集合计划时，应当提前5个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意；</p> <p>(2) 管理人以自有资金参与集合计划的份额持有期限不得少于6个月。</p> <p>2、管理人以自有资金参与和退出本集合计划时，需应当提前5个工作日以邮件方式征询托管人，并通过在管理人网站向投资者发出征询公告。如果投资者和托管人未在征询公告后的3个工作日内提出异议的，应视为投资者和托管人同意管理人自有资金参与和退出本集合计划的安排。若投资者不同意，管理人保障其退出本集合计划的权利。不同意的投资者可在公告日起至管理人自有资金参与和退出本集合计划日(含)之间的开放期退出本集合计划。如在公告日起至管理人自有资金参与和退出本集合计划日(含)之间无退出开放日，则管理人将设置临时开放期，临时开放期设置以管理人届时公告为准。未在前述时间回复意见，以及未在开放期内退出的投资者，均视为同意管理人自有资金的参与和退出安排。</p> <p>投资者明确表示不同意管理人以自有资金参与和退出本集合计划的，有权在管理人发出征询公告时规定的开放期内提出退出申请。投资者承诺，若其未提出退出申请，则视为同意管理人以自有资金参与和退出本计划的安排。</p> <p>3、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，管理人及其子公司以自有资金参与及其后续退出本计划可不受上述限制，但应及时告知投资者和托管人，并向管理人所在地中国证监会派出机构报告。</p>

<p>(三) 自有资金参与的方式、比例与金额</p> <p>管理人可以自有资金参与本集合计划, 参与比例不得超过集合计划总份额(含管理人自有资金参与份额)的16%; 管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本计划总份额的50%。因集合计划规模变动等客观因素导致管理人以自有资金参与本集合计划的总份额被动超过集合计划总份额的16%, 或管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计被动超过本计划总份额的50%, 管理人或管理人及其附属机构应及时退出部分或全部参与份额直至符合中国证监会规定及本合同约定。</p>	<p>(三) 自有资金参与的方式、比例与金额</p> <p>管理人及其子公司以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本计划总份额的50%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的, 从其规定。因集合计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的, 管理人应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时调整达标。</p>
<p>(五) 信息披露</p> <p>管理人以自有资金参与和退出时, 管理人应当提前5个工作日在管理人网站向投资者及托管人披露。</p> <p>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, 管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出本计划可不受上述限制, 但应及时告知投资者和托管人, 并向管理人所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。</p>	<p>/</p>

12、对《资产管理合同》项下第13部分第(三)款第2条“投资比例”作如下变更:

变更前	变更后
<p>2、投资比例:</p> <p>(1) 按照穿透原则合并计算, 投资于固定收益类资产的比例不超过资产管理计划总资产的80%;</p> <p>(2) 按照穿透原则合并计算, 投资于权益类资产的比例不超过资产管理计划总资产的80%;</p> <p>(3) 按照穿透原则合并计算, 投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不超过资产管理计划总资产的80%, 或衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的20%;</p> <p>(4) 投资于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合计不低于80%;</p>	<p>2、投资比例:</p> <p>(1) 按照穿透原则合并计算, 投资于固定收益类资产的比例不超过资产管理计划总资产的80%;</p> <p>(2) 按照穿透原则合并计算, 投资于权益类资产的比例不超过资产管理计划总资产的80%;</p> <p>(3) 按照穿透原则合并计算, 投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例不超过资产管理计划总资产的80%, 或衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的20%;</p> <p>(4) 投资于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合计不低于80%;</p> <p>(5) 本集合计划的总资产不得超过净</p>

(5) 本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%。本集合计划投资于其他资产管理产品时,计算本集合计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

(6) 本集合计划投资于除公募基金外的资产管理产品时,本集合计划按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额,应当符合法律法规、监管规则的相关规定。

因证券市场波动、上市公司合并、本计划规模变动等资产管理人之外的因素致使本计划投资不符合上述规定的比例,资产管理人应当在 15 个工作日内调整完毕。

上述投资比例和投资限制,如涉及穿透核查或穿透合并计算的,管理人应当于每月初 5 个工作日内通过邮件方式(托管人的邮箱地址为 custody@nbc b. cn ; custody-audit@nbc b. cn) 向托管人提供本资产管理计划所投资其他资产管理产品的估值表和净值数据等核查信息,托管人仅根据管理人提供的数据进行复核,并根据管理人提供的数据按月进行投资监督。管理人应确保对所提供数据材料的真实性,准确性以及完整性负责。由于底层数据材料的提供频率、脱敏处理、可披露程度等原因导致托管人实际监督范围受限的,由此造成的后果由管理人承担。如本资产管理计划所投资其他资产管理产品披露组合的频率发生变化的,由托管人及管理人协商一致后进行调整。涉及证券投资基金穿透监控的,以最近 1 个季度证券投资基金定期披露的报告为准。

资产的 200%。本集合计划投资于资产管理产品时,计算本集合计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产;

(6) 若本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过本计划净资产 50%,本计划的总资产不得超过本计划净资产的 120%;本计划投资于国债、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不受前述规定限制;

(7) 本集合计划投资于除公募基金外的资产管理产品时,本集合计划按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额,应当符合法律法规、监管规则的相关规定。

如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等非证券公司主观因素,造成集合计划投资比例突破上述比例限制的,管理人应在突破比例限制之日起,在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个工作日内将投资比例调整至符合要求,确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的,资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

上述投资比例和投资限制,如涉及穿透核查或穿透合并计算的,管理人应当于每月初 5 个工作日内通过邮件方式(托管人的邮箱地址为 custody@nbc b. cn ; custody-audit@nbc b. cn) 向托管人提供本资产管理计划所投资其他资产管理产品的估值表和净值数据等核查信息,托管人仅根据管理人提供的数据进行复核,并根据管理人提供的数据按月进行投资监督。管理人应确保对所提供数据材料的真实性,准确性以及完整性负责。由于底层数据材料的提供频率、脱敏处理、可披露程度等原因导致托管人实际监督范围受限的,由此造成的后果由管理人承担。如本资产管理计划所投资其他资产管理产品披露组合的频率发生变化的,由托管人及管理人协商一致后进行调整。涉及证券投资基金穿透监控的,以最近 1 个季度证券投资基金定期披露的报告为准。

13、对《资产管理合同》项下第 13 部分第(四)款“投资限制”作如下变更:

变更前	变更后
<p>为维护集合计划委托人的合法权益，本计划的投资限制为：</p> <p>(1) 本集合计划投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。</p> <p>(2) 本集合不投资任何资产管理产品劣后级；</p> <p>(3) 本集合计划投资的资产管理产品不得投资于非标准化债权及非标准化股权类资产。</p> <p>(4) 本集合计划投资于同一资产（同一资产指单只股票/单只债券）的资金不超过本集合计划资产净值的 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>(5) 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，不超过该资产的 25%，投资于定制的私募资管产品（即该产品全部份额由母基金持有）的情况，可豁免此限制</p> <p>(6) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。</p>	<p>为维护集合计划投资者的合法权益，本计划的投资限制为：</p> <p>(1) 本集合计划投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。</p> <p>(2) 本集合不投资任何资产管理产品劣后级；</p> <p>(3) 本集合计划以及本集合计划投资的资产管理产品不得投资于《管理办法》第三十八条第（五）款规定的非标准化资产；</p> <p>(4) 本集合计划投资于同一资产（同一资产指单只股票/单只债券）的资金不超过本集合计划资产净值的 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>(5) 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，不超过该资产的 25%，投资于定制的私募资管产品（即该产品全部份额由母基金持有）的情况，可豁免此限制；</p> <p>(6) 本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，本计划所申报的金额原则上不得超过本计划的总资产，本计划所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行总量；</p> <p>(7) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。</p>

14、对《资产管理合同》项下第 13 部分第（五）款“禁止行为”作如下变更：

变更前	变更后
<p>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；</p> <p>2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；</p> <p>3、直接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域；</p> <p>4、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；</p> <p>5、挪用集合计划资产；</p> <p>6、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；</p> <p>7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；</p>	<p>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；</p> <p>2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；</p> <p>3、直接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域；</p> <p>4、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；</p> <p>5、挪用集合计划资产；</p> <p>6、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；</p> <p>7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；</p>

<p>8、使用集合计划资产进行不必要的交易；</p> <p>9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；</p> <p>10、为其他机构、个人或者的资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道服务；</p> <p>11、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>	<p>8、使用集合计划资产进行不必要的交易；</p> <p>9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；</p> <p>10、为其他机构、个人或者的资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道服务；</p> <p>11、通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、托管人、投资顾问（如有）及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；</p> <p>12、为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；</p> <p>13、通过投资其他资产管理产品变相扩大投资范围或者规避监管要求；</p> <p>14、开展明股实债投资；</p> <p>15、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>
---	---

15、对《资产管理合同》项下第 13 部分第（六）款“投资比例超限的处理方式及流程”作如下变更：

变更前	变更后
<p>（六）投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，证券期货经营机构应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，证券期货经营机构应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p> <p>资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。</p>	<p>（六）投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，证券期货经营机构应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，证券期货经营机构应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。</p>

16、对《资产管理合同》项下第 14 部分“利益冲突及关联交易”第（一）、（二）款作如下变更：

变更前	变更后
<p>（一）集合计划存在或可能存在的利益</p>	<p>（一）集合计划存在或可能存在的利益</p>

<p>冲突情形</p> <p>本集合计划存在或可能存在利益冲突情形包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人或将本计划资产投资于管理人、托管人及其控股股东、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，或者从事其他重大关联交易； 2、管理人或将本计划资产投资于管理人、管理人关联方所设立的资产管理产品； 3、管理人及其附属机构有权以自有资金参与本计划； 4、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或其他关联方均有权参与本计划； 5、管理人或将本计划资产投资于由管理人、托管人提供专业服务（包括但不限于作为投资顾问、财务顾问等）的金融产品； 6、其他可能产生利益冲突的情形。 	<p>冲突情形</p> <p>本集合计划存在或可能存在利益冲突情形包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人或将本计划资产投资于管理人、托管人及其控股股东、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，或者从事其他重大关联交易； 2、管理人或将本计划资产投资于管理人、管理人关联方所设立的资产管理产品； 3、管理人及其子公司有权以自有资金参与本计划； 4、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或其他关联方均有权参与本计划； 5、管理人或将本计划资产投资于由管理人、托管人提供专业服务（包括但不限于作为投资顾问、财务顾问等）的金融产品； 6、其他可能产生关联交易或利益冲突的情形。
<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>管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，采取有效措施，做好充分的信息披露和利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范和管控可能的利益冲突。公平对待全体投资者，实现在公司、股东和员工个人的利益与投资者利益发生冲突时，优先保障投资者的利益，不同投资者之间的利益发生冲突时，公平对待不同投资者。</p> <p>如发生利益冲突，管理人将按照内部规定处理，确保公平对待投资者，不损害投资者权益并及时向投资者披露。管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。</p> <p>投资者在此同意并授权管理人可以将本合同项下的本计划财产投资于管理人、托管人及其控股股东、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，或者从事其他重大关联交易。管理人应于交易完成后5个工作日内通过管理人网站以公告方式告知委托人和托管人，并及时将关</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>管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，采取有效措施，做好充分的信息披露和利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范和管控可能的利益冲突。公平对待全体投资者，实现在公司、股东和员工个人的利益与投资者利益发生冲突时，优先保障投资者的利益，不同投资者之间的利益发生冲突时，公平对待不同投资者。</p> <p>如发生利益冲突，管理人将按照内部规定处理，确保公平对待投资者，不损害投资者权益并及时向投资者披露。管理人以资产管理计划资产从事关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，事先取得投资者的同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>投资者在此同意管理人可以将本计划财产投资于管理人、托管人及其控股股东、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，或者从事其他重大关联交易。管理人应于交易完成后5日内通</p>

<p>联交易结果向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。但因托管人未按本合同约定向管理人提供其关联方名单以及相关的证券名单而导致管理人未向委托人履行告知和披露义务的，管理人不承担任何责任。</p> <p>特别的，投资者在此同意并授权管理人可以将本合同项下的本计划财产部分或全部投资于由管理人、托管人、及其关联方（及其子公司等关联方）发行的金融产品，以及由管理人、托管人提供专业服务（包括但不限于作为投资顾问、财务顾问等）的金融产品。同时，投资者知晓并同意本资产管理计划投资的金融产品可能投资于管理人、托管人承销的各类证券。</p>	<p>过管理人网站以公告方式向投资者和托管人披露，并向中国证监会相关派出机构报告。但因托管人未按本合同约定向管理人提供其关联方名单以及相关的证券名单而导致管理人未向投资者履行告知和披露义务的，管理人不承担任何责任。管理人应事前将其关联方名单明确告知托管人，并在关联方名单更新时及时通知托管人。因管理人未及时提供关联方名单导致托管人监控不及时的，托管人不承担责任。</p> <p>投资者在此同意管理人可以将本计划资产投资于管理人、管理人关联方所设立的资产管理产品，或从事其他关联交易。管理人应于交易完成后的5个工作日内通过管理人网站以公告方式向投资者和托管人披露，并向中国证监会相关派出机构报告。</p>
--	---

17、对《资产管理合同》项下第 18 部分第（三）款第 1 条作如下变更：

变更前	变更后
<p>1. 集合计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。</p>	<p>1. 集合计划财产为信托财产，其债务由资产管理计划财产本身承担，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。</p>

18、对《资产管理合同》项下第 20 部分第（三）款第 1 条第（2）、（3）、（4）点作如下变更：

变更前	变更后
<p>(2) 投资比例</p> <p>1) 按照穿透原则合并计算，投资于固定收益类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 80%；</p> <p>2) 按照穿透原则合并计算，投资于权益类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 80%；</p> <p>3) 按照穿透原则合并计算，投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不超过资产管理计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%；</p> <p>4) 投资于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合计不低于 80%；</p> <p>5) 本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%。本集合计划投资于其他资产管</p>	<p>(2) 投资比例</p> <p>1) 按照穿透原则合并计算，投资于固定收益类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 80%；</p> <p>2) 按照穿透原则合并计算，投资于权益类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 80%；</p> <p>3) 按照穿透原则合并计算，投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例不超过资产管理计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%；</p> <p>4) 投资于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合计不低于 80%；</p> <p>5) 本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%。本集合计划投资于资产管理产品时，计算本集合计划的总资产时按照穿透</p>

<p>理产品时，计算本集合计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。</p> <p>6) 本集合计划投资于除公募基金外的资产管理产品时，本集合计划按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合法律法规、监管规则的相关规定。</p> <p>因证券市场波动、上市公司合并、本计划规模变动等资产管理人之外的因素致使本计划投资不符合上述规定的比例，资产管理人应当在 15 个工作日内调整完毕。</p> <p>上述投资比例和投资限制，如涉及穿透核查或穿透合并计算的，管理人应当于每月初 5 个工作日内通过邮件方式（托管人的邮箱地址为 custody@nbc.cn；custody-audit@nbc.cn）向托管人提供本资产管理计划所投资其他资产管理产品的估值表和净值数据等核查信息，托管人仅根据管理人提供的数据进行复核，并根据管理人提供的数据按月进行投资监督。管理人应确保对所提供数据材料的真实性、准确性以及完整性负责。由于底层数据材料的提供频率、脱敏处理、可披露程度等原因导致托管人实际监督范围受限的，由此造成的后果由管理人承担。如本资产管理计划所投资其他资产管理产品披露组合的频率发生变化的，由托管人及管理人协商一致后进行调整。涉及证券投资基金穿透监控的，以最近 1 个季度证券投资基金定期披露的报告为准。</p>	<p>原则合并计算所投资资产管理产品的总资产；</p> <p>6) 若本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过本计划净资产 50%，本计划的总资产不得超过本计划净资产的 120%；本计划投资于国债、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不受前述规定限制；</p> <p>7) 本集合计划投资于除公募基金外的资产管理产品时，本集合计划按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合法律法规、监管规则的相关规定。</p> <p>如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等非证券公司主观因素，造成集合计划投资比例突破上述比例限制的，管理人应在突破比例限制之日起，在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个工作日内将投资比例调整至符合要求，确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>上述投资比例和投资限制；如涉及穿透核查或穿透合并计算的，管理人应当于每月初 5 个工作日内通过邮件方式（托管人的邮箱地址为 custody@nbc.cn；custody-audit@nbc.cn）向托管人提供本资产管理计划所投资其他资产管理产品的估值表和净值数据等核查信息，托管人仅根据管理人提供的数据进行复核，并根据管理人提供的数据按月进行投资监督。管理人应确保对所提供数据材料的真实性、准确性以及完整性负责。由于底层数据材料的提供频率、脱敏处理、可披露程度等原因导致托管人实际监督范围受限的，由此造成的后果由管理人承担。如本资产管理计划所投资其他资产管理产品披露组合的频率发生变化的，由托管人及管理人协商一致后进行调整。涉及证券投资基金穿透监控的，以最近 1 个季度证券投资基金定期披露的报告为准。</p>
<p>(3) 投资限制</p> <p>1) 本集合计划投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。</p>	<p>(3) 投资限制</p> <p>1) 本集合计划投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。</p>

<p>2) 本集合不投资任何资产管理产品劣后级;</p> <p>3) 本集合计划投资的资产管理产品不得投资于非标准化债权及非标准化股权类资产。</p> <p>4) 本集合计划投资于同一资产(同一资产指单只股票/单只债券)的资金不超过本集合计划资产净值的25%,银行活期存款、国债、中央银行票据等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>5) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。</p>	<p>2) 本集合不投资任何资产管理产品劣后级;</p> <p>3) 本集合计划以及本集合计划投资的资产管理产品不得投资于《管理办法》第三十八条第(五)款规定的非标准化资产;</p> <p>4) 本集合计划投资于同一资产(同一资产指单只股票/单只债券)的资金不超过本集合计划资产净值的25%,银行活期存款、国债、中央银行票据等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>5) 本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时,本计划所申报的金额原则上不得超过本计划的总资产,本计划所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行总量。</p> <p>6) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。</p>
<p>(4) 禁止行为</p> <p>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;</p> <p>2) 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资;</p> <p>3) 直接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域;</p> <p>4) 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;</p> <p>5) 挪用集合计划资产;</p> <p>6) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营;</p> <p>7) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额;</p> <p>8) 使用集合计划资产进行不必要的交易;</p> <p>9) 内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为;</p> <p>10) 为其他机构、个人或者的资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道服务;</p> <p>11) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为;</p> <p>托管人发现管理人的投资运作不符合本合同约定的投资比例限制时,应当提示管理人及时纠正,管理人收到提示后应及时核</p>	<p>(4) 禁止行为</p> <p>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;</p> <p>2) 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资;</p> <p>3) 直接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域;</p> <p>4) 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;</p> <p>5) 挪用集合计划资产;</p> <p>6) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营;</p> <p>7) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额;</p> <p>8) 使用集合计划资产进行不必要的交易;</p> <p>9) 内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为;</p> <p>10) 为其他机构、个人或者的资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道服务;</p> <p>12) 通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式,违规为管理人、托管人、投资顾问(如有)及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资;</p>

<p>对，并以书面形式向托管人进行解释或举证。</p> <p>托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。对管理人的违规事项，托管人应报告管理人注册地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会。</p>	<p>13)为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；</p> <p>14)通过投资其他资产管理产品变相扩大投资范围或者规避监管要求；</p> <p>15)开展明股实债投资；</p> <p>16)法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为；</p> <p>托管人发现管理人的投资运作不符合本合同约定的投资比例限制时，应当提示管理人及时纠正，管理人收到提示后应及时核对，并以书面形式向托管人进行解释或举证。</p> <p>托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。对管理人的违规事项，托管人应报告管理人注册地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会。</p>
--	--

17、对《资产管理合同》项下第 23 部分第（七）款“估值方法”第 1、2 条作如下变更：

变更前	变更后
<p>1、固定收益品种的估值方法</p> <p>(1) 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。</p> <p>(2) 在证券交易所市场挂牌交易的债券，采用第三方估值机构（中证）提供的价格数据确定公允价值并进行估值。</p> <p>(3) 首次发行未上市债券，采用第三方估值机构（中证）提供的价格数据确定公允价值并进行估值，在第三方估值机构未能提供价格数据的情况下，采用估值技术确定的公允价值进行估值。</p> <p>(4) 在对银行间市场的固定收益品种，采用第三方估值机构（中债）提供的价格数据确定公允价值并进行估值。</p> <p>(5) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）—（4）小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第（1）—（4）小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产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，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p>	<p>1、固定收益品种的估值方法</p> <p>(1) 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。</p> <p>(2) 证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），选取第三方估值机构（中证）提供的价格数据确定公允价值并进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，采用相应估值技术确认公允价值。</p> <p>(3) 对在证券交易所市场上市交易的可转换债券，根据每日收盘价进行估值；估值日没有交易的，根据最近交易日债券收盘价进行估值。</p> <p>(4) 首次发行未上市债券，采用第三方估值机构（中证）提供的价格数据确定公允价值并进行估值，在第三方估值机构未能提供价格数据的情况下，采用估值技术确定的公允价值进行估值。</p> <p>(5) 在对银行间市场的固定收益品种，采用第三方估值机构（中债）提供的价格数据确定公允价值并进行估值。</p> <p>(6) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）—（5）小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第（1）—（5）小项规定的方法对计划资</p>

	<p>产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产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，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p>
<p>2、股票的估值</p> <p>(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。</p> <p>(2) 上市流通股票估值日无交易的，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>(3) 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。</p> <p>(4) 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的一股票的收盘价进行估值。</p> <p>(5) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的一股票的收盘价进行估值。</p> <p>(6) 通过非公开发行等其他方式获取且有明确锁定期的股票，按以下方法估值：</p> <p>a) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价低于非公开发行股票初始取得成本时，可采用在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价作为估值日该非公开发行股票的价值；</p> <p>b) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价高于非公开发行股票初始取得成本时，可按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：</p> $FV = C + (P - C) \times \frac{D_l - D_r}{D_l}$ <p>其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的初始取得成本；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价；为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。</p>	<p>2、股票的估值方法</p> <p>(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。</p> <p>(2) 上市流通股票估值日无交易的，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>(3) 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。</p> <p>(4) 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的一股票的收盘价进行估值。该日无交易的，以最近一日的市价(收盘价)估值。</p> <p>(5) 有明确锁定期或在发行时有明确限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的有明确限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。</p> <p>(6) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1) - (5) 小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第(1) - (5) 小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产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股票估值，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p>

c) 股票的锁定期起始日及估值起始日为上市公司发布公告日。

(7) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1) - (6)小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第(1) - (6)小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产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股票估值，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

19、对《资产管理合同》项下第24部分第(五)款第一段及第1条“管理人收取业绩报酬的规则”作如下变更：

变更前	变更后
<p>在管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）计提日，管理人有权收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”），管理人将根据委托人持有的每笔委托份额期间收益率（R）情况收取业绩报酬。存续期间经委托人及托管人同意，管理人可根据市场情况调整业绩报酬计提基准。业绩报酬提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的60%。</p>	<p>在管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）计提日，管理人有权收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”），管理人将根据投资者持有的每笔份额期间收益率（R）情况收取业绩报酬。存续期间经投资者及托管人同意，管理人可根据市场情况调整业绩报酬计提基准。</p>
<p>1、管理人收取业绩报酬的规则： (1) 符合业绩报酬计提标准时，在业绩报酬计提日计提业绩报酬，提取频率不超过每6个月一次。（因投资者退出资产管理计划，管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。） (2) 管理人将在以下三类业绩报酬计提日提取管理人业绩报酬：①集合计划分红日；②投资者退出日和计划终止日；③固定时点提取：每自然年度的6月10日为固定业绩报酬计提日（如遇法定节假日则顺延至下一个交易日，本计划的固定业绩报酬计提日非本计划的开放日）； (3) 集合计划分红日为业绩报酬的计提日，在集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。 (4) 投资者的退出日为业绩报酬的计提日，投资者退出（包括开放期退出和集合</p>	<p>1、管理人收取业绩报酬的规则： (1) 业绩报酬应当从分红资金、退出资金或清算资金中提取，从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次。 (2) 本计划业绩报酬计提日为本计划收益分配登记日、投资者份额退出日或本计划终止清算分配日。在收益分配登记日和本计划终止清算分配日，对本计划符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬；在投资者份额退出日，按照先进先出原则对退出份额中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬。 (3) 本计划收益分配登记日和本计划终止清算分配日符合业绩报酬计提条件的，管理人先计提业绩报酬，再分配收益或剩余资金。在投资者份额退出日符合业绩报酬计提条件的，管理人应先将投资者申请退出的份额所对应的业绩报酬从退出金额中扣除</p>

<p>计划终止时退出) 本计划时提取业绩报酬的, 业绩报酬从投资者退出资金或清算资金中扣除。</p> <p>(5) 固定时点为业绩报酬的计提日, 以扣减份额的方式提取, 管理人于业绩报酬计提日计算每一份额持有人每笔参与份额对应业绩报酬, 以业绩报酬计提日计划份额净值为基数, 折算得到需调减的投资者份额; 具体为: 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬对应的应扣减份额=本计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的业绩报酬÷本计提日基金份额单位净值</p> <p>(6) 业绩报酬收取对象为本计划的所有参与份额, 具体提取方法见下述“2、业绩报酬计提标准”。</p>	<p>后, 再向投资者分配退出款。</p> <p>(4) 业绩报酬提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的 60%。</p> <p>(5) 业绩报酬应当计入管理费。</p>
---	---

20、对《资产管理合同》项下第 27 部分“集合计划的信息披露”第(一)款第 2、3、4 点作如下变更:

变更前	变更后
<p>2、集合计划季度报告</p> <p>管理人、托管人在每季度向投资者提供一次准确、完整的季度报告, 披露报告期内资产管理计划运作情况, 包括但不限于: 管理人履职报告; 托管人履职报告; 资产管理计划投资表现; 资产管理计划投资组合报告; 资产管理计划运用杠杆情况(如有); 资产管理计划投资收益分配情况; 投资经理变更(如有)、投资管理人及管理人关联方管理的产品的情况(如有)、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项(如有); 资产管理计划支付的管理费、托管费、所投资资产管理产品产生的费用(如有)、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式; 中国证监会规定的其他事项。集合计划季度报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站公告, 并由管理人报送中国证券投资基金业协会及管理人中国证监会相关派出机构。管理人应当在上述信息披露时限内将当期管理报告提供给托管人复核, 并给托管人预留足够的复核时间, 同时托管人应当办理与资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的, 管理人和托管人可以不编制当期的季度报</p>	<p>2、集合计划季度报告</p> <p>管理人、托管人在每季度向投资者提供一次准确、完整的季度报告, 披露报告期内资产管理计划运作情况, 包括但不限于: 管理人履职报告; 托管人履职报告; 资产管理计划投资表现; 资产管理计划投资组合报告; 资产管理计划运用杠杆情况(如有); 资产管理计划投资收益分配情况; 投资经理变更(如有)、投资管理人及管理人关联方管理的产品的情况(如有)、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项(如有); 资产管理计划支付的管理费、托管费、所投资资产管理产品产生的费用(如有)、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式; 中国证监会规定的其他事项。集合计划季度报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站公告。管理人应当在上述信息披露时限内将当期管理报告提供给托管人复核, 并给托管人预留足够的复核时间, 同时托管人应当办理与资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的, 管理人和托管人可以不编制当期的季度报告。</p>

告。	
<p>3、集合计划年度报告。</p> <p>管理人、托管人在每年度向投资者提供一次准确、完整的年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况，包括但不限于：管理人履职报告；托管人履职报告；资产管理计划投资表现；资产管理计划投资组合报告；资产管理计划资产负债情况；资产管理计划财务会计报告；资产管理计划运用杠杆情况（如有）；资产管理计划投资收益分配情况；投资经理变更（如有）、投资管理人及管理人关联方管理的产品的情况（如有）、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项（如有）；资产管理计划支付的管理费、托管费、所投资资产管理产品产生的费用（如有）、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；中国证监会规定的其他事项。集合计划年度报告应于每年度结束之日起四个月内通过管理人网站公告，并由管理人报送中国证券投资基金业协会及管理人注册地中国证监会派出机构。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人和托管人可以不编制当期的年度报告。</p>	<p>3、集合计划年度报告。</p> <p>管理人、托管人在每年度向投资者提供一次准确、完整的年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况，包括但不限于：管理人履职报告；托管人履职报告；资产管理计划投资表现；资产管理计划投资组合报告；资产管理计划资产负债情况；资产管理计划财务会计报告；资产管理计划运用杠杆情况（如有）；资产管理计划投资收益分配情况；投资经理变更（如有）、投资管理人及管理人关联方管理的产品的情况（如有）、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项（如有）；资产管理计划支付的管理费、托管费、所投资资产管理产品产生的费用（如有）、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；中国证监会规定的其他事项。集合计划年度报告应于每年度结束之日起四个月内通过管理人网站公告。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人和托管人可以不编制当期的年度报告。</p>
<p>4、年度审计报告。</p> <p>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计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起四个月内将审计报告报送中国证券投资基金业协会及管理人注册地中国证监会派出机构。</p>	<p>4、年度审计报告。</p> <p>管理人应当聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对本计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起四个月内将审计报告对外披露。</p>

21、对《资产管理合同》项下第 27 部分“集合计划的信息披露”第（二）款作如下变更：

变更前	变更后
<p>（二）临时报告</p> <p>本计划在运作过程中发生下列法律法规规定或者本合同约定可能影响投资者利益的重大事项时，管理人应当在事项发生之日起五日内向投资者披露，披露方式可采用管理人网站披露或其他电子/书面形式的披露，并向管理人注册地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>1、集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资经理发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续</p>	<p>（二）临时报告</p> <p>1、本计划在运作过程中发生下列法律法规规定或者本合同约定可能影响投资者利益的重大事项时，管理人应当在事项发生之日起五日内向投资者披露，披露方式可采用管理人网站披露或其他电子/书面形式的披露，并向管理人注册地中国证监会派出机构。重大事项的情形包括但不限于：</p> <p>（1）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；</p> <p>（2）与资产管理计划有关的重大诉讼、仲裁、财产纠纷，以及出现延期兑付、投资</p>

<p>运作产生重大影响的事项；</p> <p>2、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>3、发生巨额退出并延期支付；</p> <p>4、集合计划终止和清算；</p> <p>5、集合计划资产的估值错误导致错误偏差达到计划资产净值的 0.5%；</p> <p>6、管理人以自有资金参与和退出；</p> <p>7、合同的补充、修改与变更；</p> <p>8、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>9、负责本计划的代理销售机构发生变更；</p> <p>10、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>11、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>12、其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。</p> <p>当本计划出现本合同“风险揭示及其相应风险防范措施”部分中的有关情形时，集合计划管理人必须按照法律、法规及中国证监会的有关规定，在知晓该情形之日起两个工作日内在管理人网站上公布。</p> <p>管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划，应向投资者充分披露。</p>	<p>标的重大违约等风险事件；</p> <p>(3) 资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延期清算；</p> <p>(4) 管理人、托管人因重大违法违规，被监管机构取消或认定不符合相关业务资格；</p> <p>(5) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>(6) 发生其他对持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件</p> <p>(7) 其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。</p> <p>2、当本计划出现本合同“风险揭示及其相应风险防范措施”部分中的有关情形时，集合计划管理人必须按照法律、法规及中国证监会的有关规定，在知晓该情形之日起两个工作日内在管理人网站上公布。</p> <p>3、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划，应向投资者充分披露，对本计划账户进行监控，并及时向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>4、根据法律法规、本合同约定应当向投资者披露的其它临时报告。</p>
--	--

22、新增《资产管理合同》项下第 27 部分“信息披露与报告”第（五）款：

变更前	变更后
/	<p>(五) 其他</p> <p>关于管理人向基金业协会、证监会及其相关派出机构等监管部门或自律组织的备案或报告工作，如遇有关法律、法规、监管文件作出调整且与本合同约定不一致时，由管理人依据新的规定执行。</p>

23、对《资产管理合同》项下第 29 部分第（三）款“集合计划的展期”作如下变更：

变更前	变更后
<p>(三) 展期情况备案</p> <p>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报送中国证券投资基金业协会及管理人注册地中国证监会派出机构。</p>	<p>(三) 展期情况备案</p> <p>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报送中国证券投资基金业协会。</p>

24、对《资产管理合同》项下第 30 部分第（二）款“集合计划应当终止的情形”最后一句

作如下变更：

变更前	变更后
管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报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 ，前述第 8 项约定的情形除外。	管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，前述第 8 项约定的情形除外。

25、对《资产管理合同》项下第 30 部分第（三）款“资产管理合同的清算”第 3、6 条作如下变更：

变更前	变更后
3、清算报告由管理人在清算结束后 5 个工作日内报告中国证券投资基金业协会备案， 同时抄送管理人注册地中国证监会派出机构 ，并在管理人网站公布清算报告；	3、清算报告由管理人在清算结束后 5 个工作日内报告中国证券投资基金业协会备案，并在管理人网站公布清算报告；
6、若本计划在终止之日有未能流通变现的证券，清算小组可对此制定二次清算方案，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，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给委托人。本计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和 证券投资基金业协会 报告。	6、若本计划在终止之日有未能流通变现的证券，清算小组可对此制定二次清算方案，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，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照投资者拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给投资者。本计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

26、对《资产管理合同》项下第 30 部分第（四）款“清算程序”第 3 条作如下变更：

变更前	变更后
3、将清算报告向中国证券投资基金业协会备案， 同时抄送管理人注册地中国证监会派出机构 ；	3、将清算报告向中国证券投资基金业协会备案；

27、对《资产管理合同》项下第 32 部分第（二）款第 9 条第（1）点“关联交易风险”作如下变更：

变更前	变更后
本计划可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、实际控制人或其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，也可以投资于管理人及管理人关联方所设立的资产管理产品。此种投资、交易行为构成关联交易，存在被监管层否定的政策风险和相应的关联交易风险。若本计划投资运作中发生此类关联交易，管理人应于交易完成后 5 个工作日内通	本计划可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、实际控制人或其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，也可以投资于管理人及管理人关联方所设立的资产管理产品。此种投资、交易行为构成关联交易，存在被监管层否定的政策风险和相应的关联交易风险。若本计划投资运作中发生此类关联交易，管理人应于交易完成后 5 个工作日内通

过管理人网站以公告方式告知投资者和托管人,并及时将关联交易结果向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告,投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。	过管理人网站以公告方式告知投资者和托管人,并及时将关联交易结果向中国证监会相关派出机构报告。
--	--

28、对《资产管理合同》项下第 34 部分“合同的补充、修改与变更”第 7 条作如下变更:

变更前	变更后
7、对本合同任何形式的变更、补充,管理人应当及时报中国证监会业协会备案,同时抄送管理人注册地中国证监会派出机构。	7、对本合同任何形式的变更、补充,管理人应当及时报中国证监会业协会备案。



