

关于第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划 合同变更的公告

尊敬的委托人：

由我司作为管理人，兴业银行股份有限公司杭州分行作为托管人的第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2022 年 1 月 27 日成立，现拟对《第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划资产管理合同》、《第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划说明书》、《第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划风险揭示书》进行变更。详细内容见本公告附件。

为保证委托人的利益，本计划变更事宜已经获得托管人的书面同意确认。委托人不同意本次合同变更的应在 2023 年 3 月 24 日提出退出申请。未提出退出申请的，视同委托人已经同意本次合同变更。为维护委托人的利益，2023 年 3 月 24 日提出退出申请的，不收取退出费用。截止 2023 年 3 月 24 日，若同意合同变更的委托人数量不少于 2 人（含 2 人），则我司约定 2023 年 3 月 28 日为合同变更生效日；若同意合同变更的客户数量少于 2 人，则本计划将终止。

特此公告。

附件 1：第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划资产管理合同
变更明细表

附件 2：第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划说明书变更明
细表

附件 3：第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划风险揭示书变
更明细表

第一创业证券股份有限公司
二〇二三年三月二十三日



附件 1：第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划资产管理合同变更明细表

序号	位置	原合同	变更后合同
1	一、前言	2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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“《运作管理规定》”）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指	2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《中华人民共和国期货和衍生品法》（以下简称“《期货和衍生品法》”）、《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“《运作管理规定》”）、《关于规范金融机构资

	<p>导意见》”）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称“《合同指引》”）等法律、行政法规以及中国人民银行、中国证监会和中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）的有关规定。</p> <p>3、订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护本合同各方当事人的合法权益。</p> <p>（二）对于本计划的设立、变更、展期、终止、清算等安排，管理人将按照中国证监会和基金业协会的要求向基金业协会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出机构。</p>	<p>产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称“《合同指引》”）等法律、行政法规以及中国人民银行、中国证监会和中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）的有关规定。</p> <p>3、订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护本合同各方当事人的合法权益。</p> <p>（二）对于本计划的设立、变更、展期、终止、清算等安排，管理人将按照中国证监会和基金业协会的要求向基金业协会备案或报送管理人住所地中国证监会派出机构，具体以监管机构要求为准。</p>
2	<p>二、释义</p> <p>6、《管理办法》：指 2018 年 10 月 22 日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其不时做出的修订和补充；</p> <p>7、《运作管理规定》：指 2018 年 10 月 22 日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其不时做出的修订和补充；</p> <p>……</p> <p>16、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且符合</p>	<p>6、《管理办法》：指中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其不时做出的修订和补充；</p> <p>7、《运作管理规定》：指中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其不时做出的修订和补充；</p> <p>……</p> <p>16、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且符合下列条件的自然人、法人或者其他组</p>

	<p>下列条件的自然人、法人或者其他组织：</p> <p>（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>（二）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；</p> <p>（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>（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>（五）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>（六）中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p>	<p>织：</p> <p>（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>（二）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；</p> <p>（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；</p> <p>（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>（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）；</p> <p>（六）中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p>
3	<p>四、当事人</p> <p>（三）托管人</p> <p>机构名称：兴业银行股份有限公司杭州分行</p>	<p>（三）托管人</p> <p>机构名称：兴业银行股份有限公司杭州分行</p>

<p>及 权 利 义 务</p>	<p>负责人：苏军良</p> <p>(六) 管理人的权利与义务</p> <p>1、管理人的权利</p> <p>(4) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律法规规定、对本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，并报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会；</p> <p>2、管理人的义务</p> <p>(19) 按照法律法规与本合同的约定，编制向委托人披露的本计划季度、年度等定期报告，向基金业协会备案，并抄报管理人住所地中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准；</p> <p>……</p> <p>(24) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告管理人住所地中国证监会派出机构、基金业协会并通知托管人和委托人；</p> <p>(25) 管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务，并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，配合托管人履行反洗钱义务。</p> <p>(26) 除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传。</p> <p>(27) 召集本计划份额持有人大</p>	<p>负责人：俞裕辉</p> <p>(六) 管理人的权利与义务</p> <p>1、管理人的权利</p> <p>(4) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律法规规定、对本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，并报告管理人住所地中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准；</p> <p>2、管理人的义务</p> <p>(19) 按照法律法规与本合同的约定，编制向委托人披露的本计划季度、年度等定期报告；</p> <p>……</p> <p>(24) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告管理人住所地中国证监会派出机构并通知托管人和委托人；</p> <p>(25) 管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务，并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，配合托管人履行反洗钱义务。</p> <p>(26) 除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传。</p> <p>(27) 召集本计划份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除</p>
----------------------------------	--	---

	<p>会，份额持有人大会设立日常机构的除外；</p> <p>(28) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。</p> <p>(七) 托管人的权利与义务</p> <p>(9) 编制托管年度报告，并向基金业协会备案，抄报管理人所在地中国证监会派出机构；</p> <p>.....</p> <p>(13) 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本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会；</p>	<p>外；</p> <p>(28) 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>(29) 除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传。</p> <p>(30) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。</p> <p>(七) 托管人的权利与义务</p> <p>(9) 编制托管年度报告，报送管理人所在地中国证监会派出机构；</p> <p>.....</p> <p>(13) 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本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构；</p>
4	<p>五、资产管理计划的基本情况</p> <p>(四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例</p> <p>2、主要投资方向</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的以下资产：</p> <p>(1) 固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、地</p>	<p>(四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例</p> <p>2、主要投资方向</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的以下资产：</p> <p>(1) 固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、地</p>

<p>方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、同业存单、可转换债（含可分离交易的可转债）、可交换债（含可交换私募债）、资产支持证券（ABS）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、债券型证券投资基金，经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业集合票据、资产支持票据（ABN）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、非公开定向债务融资工具（PPN）等，国债逆回购；</p> <p>（2）现金类资产：包括现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金；</p> <p>（3）权益类资产：公开募集基础设施证券投资基金（REITs）（以下或简称“公募REITs”，如相关法律法规以及监管部门对所属资产类别有相关规定的，本计划将从其规定）。</p> <p>本计划不直接投资于股票，但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的权益资产。因上述原因持有的股</p>	<p>方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、同业存单、可转换债（含可分离交易的可转债）、可交换债（含可交换私募债）、资产支持证券（ABS）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权），经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业集合票据、资产支持票据（ABN）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、非公开定向债务融资工具（PPN）等，国债逆回购；</p> <p>（2）现金类资产：包括现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）；</p> <p>（3）资产管理产品：经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括货币市场基金、债券型证券投资基金、公开募集基础设施证券投资基金（REITs））、证券公司集合资产管理计划、信托公司集合资金信托计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划、在基金业协会备案的私</p>
--	---

	<p>票，本计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。</p> <p>3、投资比例</p> <p>本计划财产投向固定收益类资产和现金类资产合计的投资比例为资产总值的 80%（含）-100%（含）；投向权益类资产的投资比例为资产总值的 0%（含）-20%（不含）；参与证券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p>	<p>募基金管理人发行的私募证券投资基金、保险资产管理产品、银行理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品。</p> <p>本计划不直接投资于股票，但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的权益资产。因上述原因持有的股票，本计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。</p> <p>3、投资比例</p> <p>本计划财产投向固定收益类资产和现金类资产合计的投资比例为资产总值的 80%（含）-100%（含）；投向权益类资产的投资比例为资产总值的 0%（含）-20%（不含）；参与证券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>本计划投资于资产管理产品的，计算本计划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。本计划投资于其他私募资产管理产品的，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。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，并按照所投资资产管理产品的披露频率更新计算计划所投资资产的金额或比例。</p>
5	七、 (一) 资产管理计划成立的条件和	(一) 资产管理计划成立的条件和

	<p>日期</p> <p>初始募集期限届满时，本计划的初始募集规模不低于人民币 1000 万元且其委托人的人数为 2 人至 200 人（含管理人自有资金参与份额），募集过程符合法律法规和中国证监会的规定，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本计划进行验资并出具验资报告后，管理人公告本计划成立。</p> <p>（三）资产管理计划的成立和备案</p> <p>本计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告本计划成立。</p> <p>管理人应当在本计划成立之日起 5 个工作日内将本合同、投资者名单与认购金额、验资报告等材料向基金业协会备案，同时抄报管理人住所地中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>本计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。</p>	<p>日期</p> <p>初始募集期限届满时，本计划的初始募集规模不低于人民币 1000 万元且其委托人的人数为 2 人至 200 人（含管理人自有资金参与份额），募集过程符合法律法规和中国证监会的规定，管理人公告本计划成立。</p> <p>（三）资产管理计划的成立和备案</p> <p>本计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人公告本计划成立。</p> <p>管理人应当在本计划成立之日起 5 个工作日内将本合同、投资者名单与认购金额等材料向基金业协会备案，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>本计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。</p>
6	<p>八、资产管理计划</p> <p>（一）资产管理计划的参与、退出</p> <p>2、参与和退出的开放日和时间</p> <p>通常情况下，本计划自成立日起每周一、三、五为开放日（如遇非工作日不顺延）可办理参与和退出业务。</p>	<p>（一）资产管理计划的参与、退出</p> <p>2、参与和退出的开放日和时间</p> <p>通常情况下，本计划开放期分为参与开放期、退出开放期，投资者可在相应开放期办理参与、退出业务。其中，</p>

<p>的参与、退出与转让</p>	<p>.....</p> <p>6、参与和退出的费用</p> <p>(1) 参与费用</p> <p>本计划无参与费,即参与费率为0。</p> <p>(2) 退出费用</p> <p>持有0日(含)~90日(不含),退出费率为0.50%;</p> <p>持有90日(含)及以上的,退出费率为0.00%。</p>	<p>参与开放期为每周一、三、五为开放日(如遇非工作日或本计划进行公募REITs投资暂停参与业务期间,不顺延),退出开放期为每自然季度的首月(1月、4月、7月、10月)前5个工作日(如遇本计划进行公募REITs投资暂停退出业务,导致退出开放期不足5个工作日的,自允许退出之日起相应顺延)。具体开放日期以管理人公告为准,届时管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p> <p>.....</p> <p>6、参与和退出的费用</p> <p>(1) 参与费用</p> <p>本计划无参与费,即参与费率为0。</p> <p>(2) 退出费用</p> <p>本计划无退出费,即退出费率为0。</p>
<p>7</p> <p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p>	<p>(五)管理人自有资金参与资产管理计划</p> <p>1、自有资金参与的条件</p> <p>管理人可以在初始募集期间或存续期内,以自有资金参与本计划,如管理人以自有资金参与,则自有资金所持本计划份额不高于本计划总份额的20%,且管理人及其附属机构以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的50%,法律法规或者监管机构对自有资金参与份额比例有新的规定的,按照新规定执行。</p>	<p>(五)管理人自有资金参与资产管理计划</p> <p>1、自有资金参与的条件</p> <p>在初始募集期间或存续期内,管理人、其子公司可以以自有资金参与本计划。如参与,则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本计划总份额的50%。法律法规或者中国证监会对管理人、其子公司自有资金投资比例另有规定的,从其规定。</p> <p>管理人、其子公司持有计划份额与其他委托人持有的本计划份额享有同</p>

<p>管理人持有计划份额与其他委托人持有的本计划份额享有同等参与收益分配的权利,也承担与所持本计划份额相对应损失的责任。管理人投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。</p> <p>2、自有资金参与、退出的条件</p> <p>(1) 自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。</p> <p>(2)管理人自有资金参与、退出本计划时应当提前5个工作日通知委托人和托管人。</p> <p>但在发生以下特殊情形时,管理人自有资金参与、退出可以不受上述条件限制,但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知委托人和托管人,并向住所地中国证监会派出机构及基金业协会报告:</p> <p>(1) 因规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与份额比例被动超限或可能被动超限(即超过或可能超过本计划总份额20%),管理人在发生上述超限情形或可能超限情形之日起5个工作日内退出超限部分的参与份额,5个工作日后仍超限的,管理人将在其后5个工作日处理。</p> <p>(2) 为应对本计划巨额赎回或解决流动性风险,在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下,管理人自有资</p>	<p>等参与收益分配的权利,也承担与所持本计划份额相对应损失的责任。管理人、其子公司投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。</p> <p>2、自有资金参与、退出的条件</p> <p>(1)管理人、其子公司自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。</p> <p>(2) 委托人和托管人签署本合同即视为同意管理人、其子公司可以在初始募集期间以自有资金参与本计划。</p> <p>(3)本计划存续期内管理人、其子公司以自有资金参与、退出本计划的,应当提前5个工作日通知委托人和托管人。管理人和托管人应书面达成一致,同时以公告或其他方式通知委托人。委托人不同意管理人、其子公司自有资金参与、退出的,应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请;未提出退出申请的,视同委托人已经同意管理人、其子公司自有资金参与、退出。</p> <p>但在发生以下特殊情形时,管理人、其子公司自有资金参与、退出可以不受上述条件限制,但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知委托人和托管人,并向住所地中国证监会派出机构报告,具体以监管机构的要求为准:</p> <p>(1) 因规模变动等客观因素导致管理人、其子公司自有资金参与份额比</p>
---	--

	<p>金参与、退出本计划。</p> <p>3、风险揭示和信息披露</p> <p>(1) 管理人以自有资金参与本计划的份额,享有与其他委托人份额相同的收益分配权,且不对本计划其他委托人承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。</p> <p>(2) 管理人自有资金退出,可能遭遇流动性风险,从而影响本计划损益。管理人将认真履行管理人职责,关注本计划规模变动情况,控制流动性风险。</p> <p>(六)管理人将按照法律法规及基金业协会的要求,定期将本计划投资者变更情况报送基金业协会。</p>	<p>例被动超限或可能被动超限(即管理人、其子公司自有资金投资比例被动超过或可能被动超过《证券公司风险控制指标计算标准规定》等中国证监会对管理人、其子公司自有资金投资比例的规定,或管理人及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计超过或可能超过本计划总份额的50%),管理人、其子公司在发生上述超限情形或可能超限情形之日起5个工作日内退出超限部分的参与份额,5个工作日后仍超限的,管理人、其子公司将在其后5个工作日内处理。</p> <p>(2) 为应对本计划巨额赎回或解决流动性风险,在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下,管理人、其子公司自有资金参与、退出本计划。</p> <p>3、风险揭示和信息披露</p> <p>(1) 管理人、其子公司以自有资金参与本计划的份额,享有与其他委托人份额相同的收益分配权,且不对本计划其他委托人承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。</p> <p>(2) 管理人、其子公司自有资金退出,可能遭遇流动性风险,从而影响本计划损益。管理人将认真履行管理人职责,关注本计划规模变动情况,控制流动性风险。</p> <p>(六) 管理人将按照法律法规及基</p>
--	--	---

			<p>金业协会的要求，定期将本计划投资者变更情况报送基金业协会，具体以监管机构的要求为准。</p>
<p>8</p>	<p>十一、资产管理计划的投资</p>	<p>(二)资产管理计划的投资范围及投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的以下资产：</p> <p>(1)固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、同业存单、可转换债（含可分离交易的可转债）、可交换债（含可交换私募债）、资产支持证券（ABS）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、债券型证券投资基金，经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业集合票据、资产支持票据（ABN）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、非公开定向债务融资工具（PPN）等，国债逆回购；</p> <p>(2)现金类资产：包括现金、各类</p>	<p>(二)资产管理计划的投资范围及投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的以下资产：</p> <p>(1)固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、同业存单、可转换债（含可分离交易的可转债）、可交换债（含可交换私募债）、资产支持证券（ABS）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权），经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业集合票据、资产支持票据（ABN）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、非公开定向债务融资工具（PPN）等，国债逆回购；</p> <p>(2)现金类资产：包括现金、各类</p>

<p>银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金；</p> <p>（3）权益类资产：公开募集基础设施证券投资基金（REITs）（如相关法律法规以及监管部门对所属资产类别有相关规定的，本计划将从其规定）。</p> <p>本计划不直接投资于股票，但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的权益资产。因上述原因持有的股票，本计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>（1）固定收益类资产和现金类资产合计的投资比例为资产总值的 80%（含）-100%（含）；</p> <p>（2）权益类资产的投资比例为资产总值的 0%（含）-20%（不含）；</p> <p>（3）参与证券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>（三）如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管理人主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备</p>	<p>银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）；</p> <p>（3）资产管理产品：经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括货币市场基金、债券型证券投资基金、公开募集基础设施证券投资基金（REITs））、证券公司集合资产管理计划、信托公司集合资金信托计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划、在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、保险资产管理产品、银行理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品。</p> <p>本计划不直接投资于股票，但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的权益资产。因上述原因持有的股票，本计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划财产投向固定收益类资产和现金类资产合计的投资比例为资产总值的 80%（含）-100%（含）；投向权益类资产的投资比例为资产总值的 0%（含）-20%（不含）；参与证券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除</p>
---	--

<p>交易条件的 15 个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p> <p>.....</p> <p>(七) 资产管理计划的投资限制及禁止行为</p> <p>1、为维护委托人的合法权益，本计划的投资限制为：</p> <p>(1) 本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%；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%，单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算。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；全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者不包括募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品）且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划，以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划，不受前述关于投资于同一资产的比例限制；</p>	<p>外。</p> <p>本计划投资于资产管理产品的，计算本计划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。本计划投资于其他私募资产管理产品的，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。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，并按照所投资资产管理产品的披露频率更新计算计划所投资资产的金额或比例。</p> <p>如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管理人主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的 20 个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告。</p> <p>.....</p> <p>(七) 资产管理计划的投资限制及禁止行为</p> <p>1、为维护委托人的合法权益，本计划的投资限制为：</p> <p>(1) 本计划投资于同一资产的资</p>
---	---

	<p>.....</p> <p>2、禁止行为</p> <p>本计划的禁止行为包括：</p> <p>.....</p> <p>(13)不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：</p> <p>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；</p> <p>2) 投资项目违反国家环境保护政策要求；</p> <p>3)通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。</p> <p>(14)不得将本计划财产用于投资房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款或补充流动资金；前述关于“房地产价格上涨过快热点城市”、“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定，以基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第4号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准；</p> <p>(15)本计划不得直接投资于商业银行信贷资产；</p> <p>(16)本计划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；</p>	<p>金，不得超过本计划资产净值的25%；</p> <p>除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外，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%，单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算。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；全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者为私募资产管理产品的，该私募资产管理产品的投资者均应当符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于1000万元）且单个投资者投资金额不低于1000万元的封闭式集合资产管理计划，以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划，不受前述关于投资于同一资产的比例限制；</p> <p>.....</p> <p>(5) 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其净资产50%的，本计划的总资产不得超过其净资产的120%。资产管理计划投资于国债、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</p>
--	---	--

	<p>(17) 本计划不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；</p> <p>(18) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>	<p>资品种不受前述规定限制；</p> <p>(6) 本计划投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品的，该等资产管理产品不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品，金融监管机构另有规定的除外。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>本计划的禁止行为包括：</p> <p>.....</p> <p>(13) 利用资产管理计划，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，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；</p> <p>(14) 为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；</p> <p>(15) 开展明股实债投资；</p> <p>(16) 不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：</p> <p>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；</p> <p>2) 投资项目违反国家环境保护政策要求；</p> <p>3) 通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。</p> <p>(17) 不得将本计划财产用于投资房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款</p>
--	---	--

			<p>或补充流动资金；前述关于“房地产价格上涨过快热点城市”、“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定，以基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第4号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准；</p> <p>(18) 本计划不得直接投资于商业银行信贷资产；</p> <p>(19) 本计划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；</p> <p>(20) 本计划不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；</p> <p>(21) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>
9	十一、资产管理计划的投资	<p>(十) 本计划投资的资产组合的流动性与本计划参与、退出的安排相匹配，具体为：</p> <p>1、本计划通常情况下每周一、三、五开放，投资的现金类资产、固定收益类资产、公募 REITs 流动性较高，可以满足本计划参与、退出安排。</p> <p>2、本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本计划资产净值的 20%。流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同</p>	<p>(十) 本计划投资的资产组合的流动性与本计划参与、退出的安排相匹配，具体为：</p> <p>1、本计划为定期开放产品，投资的现金类资产、固定收益类资产、资产管理产品具有较好的流动性及变现能力，可以满足本计划参与、退出安排。</p> <p>2、本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本计划资产净值的 20%。流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同</p>

	<p>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）、流动性受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人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> <p>3、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，不低于本计划资产净值的 10%。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>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）、流动性受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人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> <p>3、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，不低于本计划资产净值的 10%。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>
10	<p>十九、越权交易的界定</p> <p>（二）越权交易的处理程序</p> <p>1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为</p> <p>托管人对于越权交易，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，应当拒绝执行并立即要求管理人改正；未能改正或者造成本计划财产损失的，托管人应当及时通知管理人并有权报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会。</p>	<p>（二）越权交易的处理程序</p> <p>1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为</p> <p>托管人对于越权交易，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，应当拒绝执行并立即要求管理人改正；未能改正或者造成本计划财产损失的，托管人应当及时通知管理人并有权报告管理人住所地中国证监会派出机构，具体以监管机构的</p>

	<p>根据交易规则, 托管人只能在事后发现的越权交易, 托管人应当立即通知管理人, 管理人在收到通知后应当及时核对或纠正。</p> <p>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基金业协会。</p>	<p>要求为准。</p> <p>根据交易规则, 托管人只能在事后发现的越权交易, 托管人应当立即通知管理人, 管理人在收到通知后应当及时核对或纠正。</p> <p>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, 具体以监管机构的要求为准。</p>
<p>二十、资产管理计划财产的估值和会计核算</p>	<p>(一) 资产管理计划财产的估值</p> <p>(3) 证券投资基金估值方法</p> <p>1) 持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等), 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, 或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易日收盘价, 确定公允价值进行估值。</p> <p>2) 持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF)), 按估值日的基金份额净值估值; 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。</p>	<p>(一) 资产管理计划财产的估值</p> <p>(3) 证券投资基金估值方法</p> <p>1) 持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等), 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, 或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易日收盘价, 确定公允价值进行估值。</p> <p>2) 持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF)), 按估值日的基金份额净值估值; 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。</p>

	<p>3)持有的货币市场基金,按成本估值,按估值日基金管理公司的每万份收益计算。</p> <p>4)持有的基金处于封闭期的,按照最新公布的份额净值估值;没有公布份额净值的,按照成本估值。</p> <p>.....</p> <p>6、估值错误的处理</p> <p>本计划单位净值的计算精确到0.001元,小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。当资产估值导致本计划单位净值小数点后三位以内发生差错时,视为本计划单位净值错误。</p>	<p>3)持有的货币市场基金,按成本估值,按估值日基金管理公司的每万份收益计算。</p> <p>4)持有的场内公募 REITs 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;暂未上市流通的,采用成本估值;场外公募 REITs 基金需转托管至场内才可卖出,估值方法与场内公募 REITs 基金一致。</p> <p>5)持有的基金处于封闭期的,按照最新公布的份额净值估值;没有公布份额净值的,按照成本估值。</p> <p>(4) 资产管理产品估值方法</p> <p>本计划持有的资产管理产品(证券公司集合资产管理计划、信托公司集合资金信托计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划、在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、保险资产管理产品、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品。)的管理人、托管人或其运营服务机构定期公布份额净值的,按照最新公布的份额净值估值(若公布份额净值的同时,也提供扣除业绩报酬后的虚拟单位净值,优先选择按虚拟单位净值估值);不公布份额净值的,按照成本估值。如</p>
--	--	--

所投资管理产品公布的份额净值或虚拟单位净值错误等管理人和托管人之外的原因，导致本计划估值错误的，管理人和托管人予以免责。

管理人决定采取所投资资产管理产品的虚拟单位净值作为估值依据的，可以使用资产管理产品的管理人、托管人或其运营服务机构最近一次提供的虚拟单位净值，由于所投资资产管理产品的虚拟单位净值的真实性、准确性、完整性、及时性取决于该等资产管理产品基础数据，托管人仅根据其收到的虚拟单位净值对本计划进行估值。

委托人签署本合同，即表明其已经知晓并认可本计划采用上述资产管理产品的估值方法，以及通过前述估值方法计算的本计划单位净值受限于资产管理产品基础数据的真实性、准确性、完整性和及时性，委托人不会因此导致的产品净值差异情况而请求管理人或托管人进行任何损害赔偿。

.....

6、估值错误的处理

本计划单位净值的计算精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本计划单位净值错误。

<p style="text-align: center;">二十一、资产管理计划的费用与税收</p> <p style="text-align: center;">1 2</p>	<p>(一) 资产管理计划费用种类</p> <p>1、管理人的管理费及业绩报酬；</p> <p>2、托管人的托管费；</p> <p>3、证券交易费用；</p> <p>4、证券账户开户费；</p> <p>5、本计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、审计费和汇划费；</p> <p>6、按照法律法规及本合同的约定可以在本计划财产中列支的其他费用。</p> <p>(二) 资产管理计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、管理费：</p> <p>本计划管理人管理费按本计划前一日净值的【0.50】%年费率计提，计算方法如下：</p> $H=E \times 【0.50】\% \div 360$ <p>H为每日应计提的管理费；</p> <p>E为本计划前一日净值。</p> <p>本计划管理费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前5个工作日内向托管人出具管理费投资指令，经托管人核对无误后从本计划财产中一次性支付给管理人。</p> <p>(四) 管理人的业绩报酬</p> <p>1、管理人收取业绩报酬的原则：</p> <p>(1) 同一委托人不同时间多次参与本计划的，对委托人每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；</p> <p>(2)在委托人退出日、本计划分红</p>	<p>(一) 资产管理计划费用种类</p> <p>1、管理人的固定管理费及业绩报酬；</p> <p>2、托管人的托管费；</p> <p>3、证券交易费用；</p> <p>4、证券账户开户费；</p> <p>5、本计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、审计费和汇划费；</p> <p>6、按照法律法规及本合同的约定可以在本计划财产中列支的其他费用。</p> <p>(二) 资产管理计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、管理费：</p> <p>(1) 本计划管理人固定管理费按本计划前一日净值的【0.50】%年费率计提，计算方法如下：</p> $H=E \times 【0.50】\% \div 360$ <p>H为每日应计提的固定管理费；</p> <p>E为本计划前一日净值。</p> <p>本计划固定管理费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前5个工作日内向托管人出具管理费投资指令，经托管人核对无误后从本计划财产中一次性支付给管理人。</p> <p>(2)管理人的业绩报酬(浮动管理费)</p> <p>1) 管理人收取业绩报酬的原则：</p> <p>① 同一委托人不同时间多次参与本计划的，对委托人每笔参与份额分</p>
--	--	---

<p>日及计划清算处理日,对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬;</p> <p>(3) 在本计划分红日提取业绩报酬的,业绩报酬从分红中扣除;</p> <p>(4) 在委托人退出日及本计划清算处理日提取业绩报酬的,业绩报酬从退出资金中扣除;</p> <p>(5) 委托人申请退出时,管理人按“先进先出”的原则,即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额,计算、提取退出份额对应的业绩报酬。</p> <p>2、业绩报酬的计提方法</p> <p>每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日(如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日,则初始募集期参与的为注册登记机构份额注册登记日,存续期参与的为份额参与日,红利再投资的为分红除权日,下同)到本次业绩报酬计提日的年化收益率,作为计提业绩报酬的基准。</p> <p>本计划提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次,因委托人退出本计划,管理人按照本合同约定提取业绩报酬的,不受前述提取频率的限制。</p> <p>年化收益率的计算公式如下:</p> $R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0} \div D \times 100\%$ <p>P_1为业绩报酬计提日的计划单位</p>	<p>别计算年化收益率、计提业绩报酬;</p> <p>② 在委托人退出日、本计划分红日及计划清算处理日,对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬;</p> <p>③ 在本计划分红日提取业绩报酬的,业绩报酬从分红中扣除;</p> <p>④ 在委托人退出日及本计划清算处理日提取业绩报酬的,业绩报酬从退出资金中扣除;</p> <p>⑤ 委托人申请退出时,管理人按“先进先出”的原则,即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额,计算、提取退出份额对应的业绩报酬。</p> <p>2) 业绩报酬的计提方法</p> <p>每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日(如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日,则初始募集期参与的为注册登记机构份额注册登记日,存续期参与的为份额参与日,红利再投资的为分红除权日,下同)到本次业绩报酬计提日的年化收益率,作为计提业绩报酬的基准。</p> <p>本计划提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次,因委托人退出本计划,管理人按照本合同约定提取业绩报酬的,不受前述提取频率的限制。</p> <p>年化收益率的计算公式如下:</p>
---	--

累计净值；

P_0 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0^* 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；

D 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（1 年按 365 天计算）；

R 为年化收益率。

管理人业绩报酬计提如下：

年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式
$R < \text{【5.00】\%}$	0%	0
$\text{【5.00】\%} \leq R$	【30】\%	$Y = M * (R - \text{【5.00】\%}) * \text{【30】\%} * D$

其中：

Y = 业绩报酬；

M = 每笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。部分退出某笔参与份额的， M 值仅指实际退出的该笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。

初始募集期参与的份额首次计提业绩报酬的，上一个业绩报酬计提日指

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \div D \times 100\%$$

P_1 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0^* 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；

D 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（1 年按 365 天计算）；

R 为年化收益率。

管理人业绩报酬计提如下：

年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式
$R < \text{【5.00】\%}$	0%	0
$\text{【5.00】\%} \leq R$	【30】\%	$Y = M * (R - \text{【5.00】\%}) * \text{【30】\%} * D$

其中：

Y = 业绩报酬；

M = 每笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。部分退出某笔参与份额的， M 值仅指实际退出的该笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计

		<p>注册登记机构确认初始募集期参与份额的注册登记日；开放期参与的份额首次计提业绩报酬的，上一个业绩报酬计提日指参与日。</p> <p>3、业绩报酬支付：由于业绩报酬的计算涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人计算，托管人不承担复核责任。托管人根据管理人的投资指令于计提日后五个工作日内从本计划财产中一次性支付给管理人。费用计提如有四舍五入的差异，以注册登记机构确认的金额为准。</p>	<p>提日的资产净值总额。</p> <p>初始募集期参与的份额首次计提业绩报酬的，上一个业绩报酬计提日指注册登记机构确认初始募集期参与份额的注册登记日；开放期参与的份额首次计提业绩报酬的，上一个业绩报酬计提日指参与日。</p> <p>1) 业绩报酬支付：由于业绩报酬的计算涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人计算，托管人不承担复核责任。托管人根据管理人的投资指令于计提日后五个工作日内从本计划财产中一次性支付给管理人。费用计提如有四舍五入的差异，以注册登记机构确认的金额为准。</p> <p>业绩报酬属于管理费，法律法规或者监管机构对固定管理费和业绩报酬（浮动管理费）的收取比例上限有新的规定的，按照新规定执行。</p>
13	二十三、信息披露与报告	<p>(一) 定期报告</p> <p>2、本计划的季度报告和年度报告</p> <p>(1) 本计划的资产管理季度报告</p> <p>管理人每季度结束之日起一个月内向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人通过管理人网站公告，并报基金业协会备案，同时抄报管理人住所地中国证监会</p>	<p>(一) 定期报告</p> <p>2、本计划的季度报告和年度报告</p> <p>(1) 本计划的资产管理季度报告</p> <p>管理人每季度结束之日起一个月内向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人通过管理人网站公告。</p> <p>本计划成立不足 3 个月或存续期</p>

<p>派出机构，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月的，可以不编制当期的季度报告。</p> <p>(2) 本计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人每年度结束之日起四个月内向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理年度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人通过管理人网站公告，并报基金业协会备案，同时抄报管理人住所地中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准。托管人在每年度结束之日起四个月内向委托人提供一次年度托管报告，年度托管报告由管理人通过管理人网站公告。</p> <p>3、年度审计报告</p> <p>管理人应当进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本计划出具单项审计意见。</p> <p>管理人应当将审计结果报基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构，并将本计划的单项审计意见通过管理人网站公告。本计划成</p>	<p>间不足 3 个月的，可以不编制当期的季度报告。</p> <p>(2) 本计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人每年度结束之日起四个月内向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理年度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人通过管理人网站公告。托管人在每年度结束之日起四个月内向委托人提供一次年度托管报告，年度托管报告由管理人通过管理人网站公告。</p> <p>3、年度审计报告</p> <p>管理人应当进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求符合《证券法》规定的具有证券相关业务资格的会计师事务所就本计划出具单项审计意见。</p> <p>管理人应当将本计划的单向审计意见通过管理人网站公告。本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月时，可以不编制当期的年度审计报告，产品终止当年，无需出具年度审计报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>(二) 临时报告</p> <p>本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生</p>
--	---

	<p>立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月时，可以不编制当期的年度审计报告，产品终止当年，无需出具年度审计报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>（二）临时报告</p> <p>本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起 5 日内以管理人指定网站公告或其他途径和方式及时向委托人披露。</p> <p>临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>.....</p> <p>10、资产计价出现错误（当资产估值导致本计划单位净值小数点后三位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；</p> <p>.....</p> <p>（四）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计划的，管理人应当按照相关法律法规的规定和本合同的约定通过管理人网站或其他途径和方式向委托人披露，并向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p>	<p>之日起 5 日内以管理人指定网站公告或其他途径和方式及时向委托人披露，并及时报送管理人住所地中国证监会相关派出机构，具体以监管机构的要求为准。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>.....</p> <p>10、资产计价出现错误（当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；</p> <p>.....</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计划的，管理人应当按照相关法律法规的规定和本合同的约定通过管理人网站或其他途径和方式向委托人披露，并向管理人住所地中国证监会派出机构，具体以监管机构要求为准。</p>
14	<p>二十四、风险揭示</p> <p>（二）一般风险揭示</p> <p>13、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险</p> <p>当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，</p>	<p>（二）一般风险揭示</p> <p>13、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险</p> <p>当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，</p>

	<p>届时赎回净值可能发生变动, 委托人退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异, 将直接影响到委托人的投资收益。举例如下:</p> <p>假设本计划退出申请日单位净值为 A (净值精度调整前), 委托人退出份额为 X, 则退出申请日单位净值精度误差最高为 ± 0.0005 元 (即四舍五入小数点后第 4 位最大误差), 由此计算的单位净值 A 调整精度后对委托人退出总金额的最大影响为 $\pm X * 0.0005$ 元。</p>	<p>届时赎回净值可能发生变动, 委托人退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异, 将直接影响到委托人的投资收益。举例如下:</p> <p>假设本计划退出申请日单位净值为 A (净值精度调整前), 委托人退出份额为 X, 则退出申请日单位净值精度误差最高为 ± 0.00005 元 (即四舍五入小数点后第 5 位最大误差), 由此计算的单位净值 A 调整精度后对委托人退出总金额的最大影响为 $\pm X * 0.00005$ 元。</p>
<p>1 5</p> <p>二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算</p>	<p>(一) 资产管理合同的变更</p> <p>6、本合同发生变更的, 管理人应当按照基金业协会要求及时向基金业协会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出机构, 具体以监管机构的要求为准。</p> <p>(四) 资产管理计划的终止</p> <p>管理人应当自本计划终止之日起 5 个工作日内报基金业协会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出机构, 前述第 8 项约定的情形除外。</p> <p>(五) 资产管理计划的清算</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>(6) 将清算报告报基金业协会、管理人住所地中国证监会派出机构并告知委托人;</p> <p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p>	<p>(一) 资产管理合同的变更</p> <p>6、本合同发生变更的, 管理人应当按照基金业协会要求及时向基金业协会备案, 具体以监管机构的要求为准。</p> <p>(四) 资产管理计划的终止</p> <p>管理人应当自本计划终止之日起 5 个工作日内报基金业协会备案, 前述第 8 项约定的情形除外。</p> <p>(五) 资产管理计划的清算</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>(6) 将清算报告报基金业协会并告知委托人, 具体以监管机构的要求为准;</p> <p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>(4) 按本计划委托人所持计划份额比例进行分配;</p> <p>本计划财产未按前述第 (1)、(2)、</p>

	<p>(4) 按本计划委托人所持计划份额比例进行分配;</p> <p>本计划财产未按前述第(1)、(2)、(3)项约定进行清偿前,不得分配给本计划委托人。</p> <p>5、本计划二次清算</p> <p>若本计划在终止之日有未能流通变现的证券或金融产品,管理人可对此制定二次清算方案,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,对前述未能流通变现的证券或金融产品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,以货币形式分配给委托人,二次清算期间,管理人、托管人继续按照本合同约定计提管理费、托管费及其他费用。发生二次清算情形的,管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p> <p>6、本计划清算报告的告知安排</p> <p>清算结果由本计划财产清算小组结束后通过管理人网站向委托人进行披露。并报告管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p>	<p>(3)项约定进行清偿前,不得分配给本计划委托人。</p> <p>(5)清算后的剩余财产,原则上以货币资金形式进行分配;本合同另有约定的,从其约定;但不得违反中国证监会规定。</p> <p>5、本计划二次清算</p> <p>若本计划在终止之日有未能流通变现的证券或金融产品,管理人可对此制定二次清算方案,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,对前述未能流通变现的证券或金融产品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,以货币形式分配给委托人,二次清算期间,管理人、托管人继续按照本合同约定计提管理费、托管费及其他费用。发生二次清算情形的,管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告,具体以监管机构的要求为准。</p> <p>6、本计划清算报告的告知安排</p> <p>清算结果由本计划财产清算小组结束后通过管理人网站向委托人进行披露。并报告管理人住所地中国证监会派出机构报告,具体以监管机构的要求为准。</p>
16	附件	一、投资范围及资产配置比例

<p>一： 投资 运作 监督 事项 表</p>	<p>1、投资范围</p> <p>(1)固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、同业存单、可转换债（含可分离交易的可转债）、可交换债（含可交换私募债）、资产支持证券（ABS）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、债券型证券投资基金，经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业集合票据、资产支持票据（ABN）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、非公开定向债务融资工具（PPN）等，国债逆回购；</p> <p>(2)现金类资产：包括现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金；</p> <p>(3)权益类资产：公开募集基础设施证券投资基金（REITs）（以下或简称“公募REITs”，如相关法律法规以及监管部门对所属资产类别有相关规定的，</p>	<p>1、投资范围</p> <p>(1)固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、同业存单、可转换债（含可分离交易的可转债）、可交换债（含可交换私募债）、资产支持证券（ABS）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权），经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业集合票据、资产支持票据（ABN）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、非公开定向债务融资工具（PPN）等，国债逆回购；</p> <p>(2)现金类资产：包括现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）；</p> <p>(3)资产管理产品：经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括货币市场基金、债券型证券投资基金、公开募集基础设施证券投资基金（REITs））、证券公司集合资产管理计</p>
---	---	---

<p>本计划将从其规定)。</p> <p>本计划不直接投资于股票,但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的权益资产。因上述原因持有的股票,本计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划财产投向固定收益类资产和现金类资产合计的投资比例为资产总值的 80% (含) -100% (含); 投向权益类资产的投资比例为资产总值的 0% (含) -20% (不含); 参与证券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%, 中国证监会另有规定的除外。</p> <p>二、投资限制</p> <p>1、为维护委托人的合法权益,本计划的投资限制为:</p> <p>(1) 本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%; 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%, 单一融资主体及其关联方的非标准化资产, 视为同一资产合并计算。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; 全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者(专业投资者不包括募集两个以</p>	<p>划、信托公司集合资金信托计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划、在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、保险资产管理产品、银行理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品。</p> <p>本计划不直接投资于股票,但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的权益资产。因上述原因持有的股票,本计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划财产投向固定收益类资产和现金类资产合计的投资比例为资产总值的 80% (含) -100% (含); 投向权益类资产的投资比例为资产总值的 0% (含) -20% (不含); 参与证券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%, 中国证监会另有规定的除外。</p> <p>本计划投资于资产管理产品的, 计算本计划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。本计划投资于其他私募资产管理产品的, 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額。本计划按照所投资资产管理产品</p>
---	--

	<p>上投资者资金设立的私募资产管理产品)且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划, 以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划, 不受前述关于投资于同一资产的比例限制;</p> <p>.....</p>	<p>披露投资组合的频率, 并按照所投资资产管理产品的披露频率更新计算计划所投资资产的金额或比例。</p> <p>二、投资限制</p> <p>1、为维护委托人的合法权益, 本计划的投资限制为:</p> <p>(1) 本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%; 除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外, 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%, 单一融资主体及其关联方的非标准化资产, 视为同一资产合并计算。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; 全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者(专业投资者为私募资产管理产品的, 该私募资产管理产品的投资者均应当符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元) 且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划, 以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划, 不受前述关于投资于同一资产的比例限制;</p>
--	---	---

		<p>.....</p> <p>(5) 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其净资产 50%的, 本计划的总资产不得超过其净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、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>(6) 本计划投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品的, 该等资产管理产品不得再投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品, 金融监管机构另有规定的除外。</p>
--	--	--

附件 2: 第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划说明书变更明细表

序号	位置	原合同	变更后合同
1	基本信息	<p>投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的以下资产:</p> <p>(1)固定收益类资产:国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债(含公开发行和非公开发行)、金融债(含次级债、混合资本债)、同业存单、可转换债(含可分离交易的可转</p>	<p>投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的以下资产:</p> <p>(1)固定收益类资产:国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债(含公开发行和非公开发行)、金融债(含次级债、混合资本债)、同业存单、可转换债(含可分离交易的可转</p>

<p>债)、可交换债(含可交换私募债)、资产支持证券(ABS)(不含劣后级,其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权)、债券型证券投资基金,经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具,包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业集合票据、资产支持票据(ABN)(不含劣后级,其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权)、非公开定向债务融资工具(PPN)等,国债逆回购;</p> <p>(2)现金类资产:包括现金、各类银行存款(包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款,不含结构性存款)、货币市场基金;</p> <p>(3)权益类资产:公开募集基础设施证券投资基金(REITs)(以下或简称“公募REITs”,如相关法律法规以及监管部门对所属资产类别有相关规定的,本计划将从其规定)。</p> <p>本计划不直接投资于股票,但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的权益资产。因上述原因持有的股票,本计划将在其可交易之日起的10个交易日内卖出。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划财产投向固定收益类资产</p>	<p>债)、可交换债(含可交换私募债)、资产支持证券(ABS)(不含劣后级,其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权),经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具,包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业集合票据、资产支持票据(ABN)(不含劣后级,其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权)、非公开定向债务融资工具(PPN)等,国债逆回购;</p> <p>(2)现金类资产:包括现金、各类银行存款(包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款,不含结构性存款);</p> <p>(3)资产管理产品:经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金(包括货币市场基金、债券型证券投资基金、公开募集基础设施证券投资基金(REITs))、证券公司集合资产管理计划、信托公司集合资金信托计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划、在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、保险资产管理产品、银行理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品。</p>
--	---

	<p>和现金类资产合计的投资比例为资产总值的 80%（含）-100%（含）；投向权益类资产的投资比例为资产总值的 0%（含）-20%（不含）；参与证券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p>	<p>本计划不直接投资于股票，但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的权益资产。因上述原因持有的股票，本计划将在其可交易之日起的 10 个交易日卖出。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划财产投向固定收益类资产和现金类资产合计的投资比例为资产总值的 80%（含）-100%（含）；投向权益类资产的投资比例为资产总值的 0%（含）-20%（不含）；参与证券逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>本计划投资于资产管理产品的，计算本计划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。本计划投资于其他私募资产管理产品的，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。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，并按照所投资资产管理产品的披露频率更新计算计划所投资资产的金额或比例。</p>
2	<p>投资限制</p> <p>1、为维护委托人的合法权益，本计划的投资限制为：</p> <p>（1）本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%；</p>	<p>投资限制</p> <p>1、为维护委托人的合法权益，本计划的投资限制为：</p> <p>（1）本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%；</p>

<p>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%,单一融资主体及其关联方的非标准化资产,视为同一资产合并计算。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;全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者(专业投资者不包括募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品)且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划,以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划,不受前述关于投资于同一资产的比例限制;</p> <p>.....</p> <p>2、禁止行为</p> <p>本计划的禁止行为包括:</p> <p>.....</p> <p>(13)不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目(证券市场投资除外),包括但不限于以下情形:</p> <p>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;</p> <p>2)投资项目违反国家环境保护政策要求;</p> <p>3)通过穿透核查,资产管理计划最终投向上述投资项目。</p>	<p>除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外,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%,单一融资主体及其关联方的非标准化资产,视为同一资产合并计算。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;全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者(专业投资者为私募资产管理产品的,该私募资产管理产品的投资者均应当符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元)且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划,以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划,不受前述关于投资于同一资产的比例限制;</p> <p>.....</p> <p>(6)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其净资产 50%的,本计划的总资产不得超过其净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、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>(14)不得将本计划财产用于投资房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款或补充流动资金；前述关于“房地产价格上涨过快热点城市”、“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定，以基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第4号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准；</p> <p>(15)本计划不得直接投资于商业银行信贷资产；</p> <p>(16)本计划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；</p> <p>(17)本计划不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；</p> <p>(18)法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>	<p>(6) 本计划投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品的，该等资产管理产品不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品，金融监管机构另有规定的除外。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>本计划的禁止行为包括：</p> <p>……</p> <p>(13) 利用资产管理计划，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，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；</p> <p>(14) 为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；</p> <p>(15) 开展明股实债投资；</p> <p>(16) 不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：</p> <p>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；</p> <p>2) 投资项目违反国家环境保护政策要求；</p> <p>3) 通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。</p> <p>(17) 不得将本计划财产用于投资房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款或补充流动资金；前述关于“房地产价</p>
--	---	--

			<p>格上涨过快热点城市”、“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定，以基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第4号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准；</p> <p>(18) 本计划不得直接投资于商业银行信贷资产；</p> <p>(19) 本计划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；</p> <p>(20) 本计划不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；</p> <p>(21) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>
3	集合计划成立的条件、时间	<p>初始募集期限届满时，本计划的初始募集规模不低于人民币 1000 万元且其委托人的人数为 2 人至 200 人(含管理人自有资金参与份额)，募集过程符合法律法规和中国证监会的规定，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本计划进行验资并出具验资报告后，管理人公告本计划成立。</p>	<p>初始募集期限届满时，本计划的初始募集规模不低于人民币 1000 万元且其委托人的人数为 2 人至 200 人(含管理人自有资金参与份额)，募集过程符合法律法规和中国证监会的规定，管理人公告本计划成立。</p>
4	集合计划的	<p>办理时间</p> <p>通常情况下，本计划自成立日起每周一、三、五为开放日(如遇非工作日</p>	<p>办理时间</p> <p>通常情况下，本计划开放期分为参与开放期、退出开放期，投资者可在相</p>

参与和退出	<p>不顺延)可办理参与和退出业务。</p> <p>.....</p> <p>参与和退出的费用</p> <p>(1)参与费用</p> <p>本计划无参与费,即参与费率为0。</p> <p>(2)退出费用</p> <p>持有0日(含)~90日(不含),退出费率为0.50%;</p> <p>持有90日(含)及以上的,退出费率为0.00%。</p>	<p>应开放期办理参与、退出业务。其中,参与开放期为每周一、三、五为开放日(如遇非工作日或本计划进行公募REITs投资暂停参与业务期间,不顺延),退出开放期为每自然季度的首月(1月、4月、7月、10月)前5个工作日(如遇本计划进行公募REITs投资暂停退出业务,导致退出开放期不足5个工作日的,自允许退出之日起相应顺延)。具体开放日期以管理人公告为准,届时管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p> <p>.....</p> <p>参与和退出的费用</p> <p>(1)参与费用</p> <p>本计划无参与费,即参与费率为0。</p> <p>(2)退出费用</p> <p>本计划无退出费,即退出费率为0。</p>
5 管理人自有资金参与情况	<p>1、自有资金参与的条件</p> <p>管理人可以在初始募集期间或存续期内,以自有资金参与本计划,如管理人以自有资金参与,则自有资金所持本计划份额不高于本计划总份额的20%,且管理人及其附属机构以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的50%,法律法规或者监管机构对自有资金参与份额比例有新的规定的,按照新规定执行。</p> <p>管理人持有计划份额与其他委托</p>	<p>1、自有资金参与的条件</p> <p>在初始募集期间或存续期内,管理人、其子公司可以以自有资金参与本计划。如参与,则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本计划总份额的50%。法律法规或者中国证监会对管理人、其子公司自有资金投资比例另有规定的,从其规定。</p> <p>管理人、其子公司持有计划份额与其他委托人持有的本计划份额享有同等参与收益分配的权利,也承担与所持</p>

<p>人持有的本计划份额享有同等参与收益分配的权利,也承担与所持本计划份额相对应损失的责任。管理人投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。</p> <p>2、自有资金参与、退出的条件</p> <p>(1) 自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。</p> <p>(2)管理人自有资金参与、退出本计划时应当提前5个工作日通知委托人和托管人。</p> <p>但在发生以下特殊情形时,管理人自有资金参与、退出可以不受上述条件限制,但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知委托人和托管人,并向住所地中国证监会派出机构及基金业协会报告:</p> <p>(1) 因规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与份额比例被动超限或可能被动超限(即超过或可能超过本计划总份额20%),管理人在发生上述超限情形或可能超限情形之日起5个工作日内退出超限部分的参与份额,5个工作日后仍超限的,管理人将在其后5个工作日处理。</p> <p>(2) 为应对本计划巨额赎回或解决流动性风险,在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下,管理人自有资金参与、退出本计划。</p>	<p>本计划份额相对应损失的责任。管理人、其子公司投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。</p> <p>2、自有资金参与、退出的条件</p> <p>(1)管理人、其子公司自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。</p> <p>(2) 委托人和托管人签署本合同即视为同意管理人、其子公司可以在初始募集期间以自有资金参与本计划。</p> <p>(3)本计划存续期内管理人、其子公司以自有资金参与、退出本计划的,应当提前5个工作日通知委托人和托管人。管理人和托管人应书面达成一致,同时以公告或其他方式通知委托人。委托人不同意管理人、其子公司自有资金参与、退出的,应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请;未提出退出申请的,视同委托人已经同意管理人、其子公司自有资金参与、退出。</p> <p>但在发生以下特殊情形时,管理人、其子公司自有资金参与、退出可以不受上述条件限制,但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知委托人和托管人,并向住所地中国证监会派出机构报告,具体以监管机构的要求为准:</p> <p>(1) 因规模变动等客观因素导致管理人、其子公司自有资金参与份额比例被动超限或可能被动超限(即管理</p>
---	---

		<p>3、风险揭示和信息披露</p> <p>(1) 管理人以自有资金参与本计划的份额,享有与其他委托人份额相同的收益分配权,且不对本计划其他委托人承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。</p> <p>(2) 管理人自有资金退出,可能遭遇流动性风险,从而影响本计划损益。管理人将认真履行管理人职责,关注本计划规模变动情况,控制流动性风险。</p>	<p>人、其子公司自有资金投资比例被动超过或可能被动超过《证券公司风险控制指标计算标准规定》等中国证监会对管理人、其子公司自有资金投资比例的规定,或管理人及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计超过或可能超过本计划总份额的 50%),管理人、其子公司在发生上述超限情形或可能超限情形之日起5个工作日内退出超限部分的参与份额,5个工作日后仍超限的,管理人、其子公司将在其后5个工作日处理。</p> <p>(2) 为应对本计划巨额赎回或解决流动性风险,在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下,管理人、其子公司自有资金参与、退出本计划。</p> <p>3、风险揭示和信息披露</p> <p>(1) 管理人、其子公司以自有资金参与本计划的份额,享有与其他委托人份额相同的收益分配权,且不对本计划其他委托人承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。</p> <p>(2) 管理人、其子公司自有资金退出,可能遭遇流动性风险,从而影响本计划损益。管理人将认真履行管理人职责,关注本计划规模变动情况,控制流动性风险。</p>
6	费用、报	<p>1、管理费:</p> <p>本计划管理人管理费按本计划前</p>	<p>1、管理费:</p> <p>(1) 本计划管理人固定管理费按</p>

<p>酬</p>	<p>一日净值的【0.50】%年费率计提，计算方法如下：</p> $H=E \times 【0.50】\% \div 360$ <p>H为每日应计提的管理费； E为本计划前一日净值。</p> <p>本计划管理费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前5个工作日内向托管人出具管理费投资指令，经托管人核对无误后从本计划财产中一次性支付给管理人。</p> <p>管理人的业绩报酬</p> <p>1、管理人收取业绩报酬的原则：</p> <p>(1) 同一委托人不同时间多次参与本计划的，对委托人每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；</p> <p>(2) 在委托人退出日、本计划分红日及计划清算处理日，对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬；</p> <p>(3) 在本计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红中扣除；</p> <p>(4) 在委托人退出日及本计划清算处理日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；</p> <p>(5) 委托人申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。</p> <p>2、业绩报酬的计提方法</p>	<p>本计划前一日净值的【0.50】%年费率计提，计算方法如下：</p> $H=E \times 【0.50】\% \div 360$ <p>H为每日应计提的固定管理费； E为本计划前一日净值。</p> <p>本计划固定管理费每日计提，按季支付。管理人于每季度首月前5个工作日内向托管人出具管理费投资指令，经托管人核对无误后从本计划财产中一次性支付给管理人。</p> <p>(2) 管理人的业绩报酬(浮动管理费)</p> <p>1) 管理人收取业绩报酬的原则：</p> <p>⑥ 同一委托人不同时间多次参与本计划的，对委托人每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；</p> <p>⑦ 在委托人退出日、本计划分红日及计划清算处理日，对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬；</p> <p>⑧ 在本计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红中扣除；</p> <p>⑨ 在委托人退出日及本计划清算处理日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；</p> <p>⑩ 委托人申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。</p>
----------	--	---

每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则初始募集期参与的为注册登记机构份额注册登记日，存续期参与的为份额参与日，红利再投资的为分红除权日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。

本计划提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次，因委托人退出本计划，管理人按照本合同约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0} \div D \times 100\%$$

P_1 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0^* 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；

D 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（1 年按 365 天计算）；

R 为年化收益率。

管理人业绩报酬计提如下：

年化收	计提	业绩报酬计算
-----	----	--------

2) 业绩报酬的计提方法

每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则初始募集期参与的为注册登记机构份额注册登记日，存续期参与的为份额参与日，红利再投资的为分红除权日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。

本计划提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次，因委托人退出本计划，管理人按照本合同约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0} \div D \times 100\%$$

P_1 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0^* 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；

D 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（1 年按 365 天计算）；

R 为年化收益率。

管理人业绩报酬计提如下：

收益率	比例	公式
R < 【5.00】%	0%	0
【5.00】% ≤ R	【30】%	$Y = M * (R - 【5.00】%) * 【30】% * D$

其中：

Y=业绩报酬；

M=每笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。部分退出某笔参与份额的，M值仅指实际退出的该笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。

初始募集期参与的份额首次计提业绩报酬的，上一个业绩报酬计提日指注册登记机构确认初始募集期参与份额的注册登记日；开放期参与的份额首次计提业绩报酬的，上一个业绩报酬计提日指参与日。

3、业绩报酬支付：由于业绩报酬的计算涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人计算，托管人不承担复核责任。托管人根据管理人的投资指令于计提日后五个工作日内从本计划财产中一次性支付给管理人。费用计提如有四舍五入的差异，以注册登记机构确认的金额为准。

年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式
R < 【5.00】%	0%	0
【5.00】% ≤ R	【30】%	$Y = M * (R - 【5.00】%) * 【30】% * D$

其中：

Y=业绩报酬；

M=每笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。部分退出某笔参与份额的，M值仅指实际退出的该笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。

初始募集期参与的份额首次计提业绩报酬的，上一个业绩报酬计提日指注册登记机构确认初始募集期参与份额的注册登记日；开放期参与的份额首次计提业绩报酬的，上一个业绩报酬计提日指参与日。

2) 业绩报酬支付：由于业绩报酬的计算涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人计算，托管人不承担复核责任。托管人根据管理人的投资指令于计提日后五个工作日内从本计划财产中一次性支付给管理人。费用计提如有四舍五入的差异，以注册登记机构确认的金

			<p>额为准。</p> <p>业绩报酬属于管理费，法律法规或者监管机构对固定管理费和业绩报酬（浮动管理费）的收取比例上限有新的规定的，按照新规定执行。</p>
7	信息披露	<p>定期报告</p> <p>2、本计划的季度报告和年度报告</p> <p>（1）本计划的资产管理季度报告</p> <p>管理人每季度结束之日起一个月内向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人通过管理人网站公告，并报基金业协会备案，同时抄报管理人住所地中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的，可以不编制当期的季度报告。</p> <p>（2）本计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人每年度结束之日起四个月内向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理年度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人通过管理人网站公告，并报基金业协会备案，同时抄报管理人住所地中国证监会</p>	<p>定期报告</p> <p>2、本计划的季度报告和年度报告</p> <p>（1）本计划的资产管理季度报告</p> <p>管理人每季度结束之日起一个月内向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人通过管理人网站公告。</p> <p>本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的，可以不编制当期的季度报告。</p> <p>（2）本计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人每年度结束之日起四个月内向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产管理年度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人通过管理人网站公告。托管人在每年度结束之日起四个月内向委托人提供一次年度托管报告，年度托管报告由管理人通过管理人网站公告。</p> <p>3、年度审计报告</p>

	<p>派出机构，具体以监管机构的要求为准。托管人在每年度结束之日起四个月内向委托人提供一次年度托管报告，年度托管报告由管理人通过管理人网站公告。</p> <p>3、年度审计报告</p> <p>管理人应当进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本计划出具单项审计意见。</p> <p>管理人应当将审计结果报基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构，并将本计划的单项审计意见通过管理人网站公告。本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月时，可以不编制当期的年度审计报告，产品终止当年，无需出具年度审计报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>临时报告</p> <p>本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起5日内以管理人指定网站公告或其他途径和方式及时向委托人披露。临时报告的情形包括但不限于：</p>	<p>管理人应当进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求符合《证券法》规定的具有证券相关业务资格的会计师事务所就本计划出具单项审计意见。</p> <p>管理人应当将本计划的单向审计意见通过管理人网站公告。本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月时，可以不编制当期的年度审计报告，产品终止当年，无需出具年度审计报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>临时报告</p> <p>本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起5日内以管理人指定网站公告或其他途径和方式及时向委托人披露，并及时报送管理人住所地中国证监会相关派出机构，具体以监管机构的要求为准。临时报告的情形包括但不限于：</p>
8	<p>终止和清算</p> <p>资产管理计划的终止</p> <p>管理人应当自本计划终止之日起5个工作日内报基金业协会备案并抄报</p>	<p>资产管理计划的终止</p> <p>管理人应当自本计划终止之日起5个工作日内报基金业协会备案，前述第</p>

<p>管理人住所地中国证监会派出机构,前述第 8 项约定的情形除外。</p> <p>资产管理计划的清算</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>(6)将清算报告报基金业协会、管理人住所地中国证监会派出机构并告知委托人;</p> <p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>(4)按本计划委托人所持计划份额比例进行分配;</p> <p>本计划财产未按前述第(1)、(2)、(3)项约定进行清偿前,不得分配给本计划委托人。</p> <p>5、本计划二次清算</p> <p>若本计划在终止之日有未能流通变现的证券或金融产品,管理人可对此制定二次清算方案,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,对前述未能流通变现的证券或金融产品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,以货币形式分配给委托人,二次清算期间,管理人、托管人继续按照本合同约定计提管理费、托管费及其他费用。发生二次清算情形的,管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p>	<p>8 项约定的情形除外。</p> <p>资产管理计划的清算</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>(6)将清算报告报基金业协会并告知委托人,具体以监管机构的要求为准;</p> <p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>(4)按本计划委托人所持计划份额比例进行分配;</p> <p>本计划财产未按前述第(1)、(2)、(3)项约定进行清偿前,不得分配给本计划委托人。</p> <p>(5)清算后的剩余财产,原则上以货币资金形式进行分配;本合同另有约定的,从其约定;但不得违反中国证监会规定。</p> <p>5、本计划二次清算</p> <p>若本计划在终止之日有未能流通变现的证券或金融产品,管理人可对此制定二次清算方案,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,对前述未能流通变现的证券或金融产品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,以货币形式分配给委托人,二次清算期间,管理人、托管人继续按照本合同约定计提管理费、托管</p>
---	---

	<p>6、本计划清算报告的告知安排</p> <p>清算结果由本计划财产清算小组结束后通过管理人网站向委托人进行披露。并报告管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p>	<p>费及其他费用。发生二次清算情形的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>6、本计划清算报告的告知安排</p> <p>清算结果由本计划财产清算小组结束后通过管理人网站向委托人进行披露。并报告管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。</p>
--	---	--

附件 3：第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划风险揭示书变更明细表

序号	位置	原风险揭示书	变更后风险揭示书
1	二、风险揭示	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>13、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险</p> <p>当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，届时赎回净值可能发生变动，委托人退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异，将直接影响到委托人的投资收益。举例如下：</p> <p>假设本计划退出申请日单位净值为 A（净值精度调整前），委托人退出份额为 X，则退出申请日单位净值精度误差最高为 ± 0.0005 元（即四舍五入小数点后第 4 位最大误差），由此计算的单位净值 A 调整精度后对委托人退出总金额的最大影响为 $\pm X * 0.0005$ 元。</p>	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>13、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险</p> <p>当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，届时赎回净值可能发生变动，委托人退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异，将直接影响到委托人的投资收益。举例如下：</p> <p>假设本计划退出申请日单位净值为 A（净值精度调整前），委托人退出份额为 X，则退出申请日单位净值精度误差最高为 ± 0.00005 元（即四舍五入小数点后第 5 位最大误差），由此计算的单位净值 A 调整精度后对委托人退出总金额的最大影响为 $\pm X * 0.00005$ 元。</p>