

# 关于第一创业稳进平衡 2 号 FOF 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，江苏银行股份有限公司深圳分行作为托管人的第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2022 年 7 月 26 日成立。现根据 2023 年 3 月 1 日实施的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及管理人内部相关制度，拟对《第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》、《第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划说明书》和《第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书》进行变更。主要变更内容体现为以下方面（详细内容见本公告附件）：

- 1、补充合同订立依据；
- 2、修改释义；
- 3、修改管理人权利与义务；
- 4、修改托管人义务；
- 5、修改投资比例中资产名称；
- 6、修改管理人自有资金参与、退出资产管理计划安排；
- 7、修改被动超标调整时限的约定；
- 8、修改投资限制；
- 9、增加禁止行为；

- 10、修改关联交易安排及相关风险揭示；
- 11、修改债券估值方法；
- 12、调整管理费（固定管理费）及业绩报酬（浮动管理费）的安排；
- 13、修改信息披露安排；
- 14、补充关于清算后的剩余财产的分配安排；
- 15、修改清算报告的告知安排；
- 16、修改托管行监督事项。

根据相关法律法规，为保证委托人的利益，本计划合同变更需取得委托人和托管人同意。本计划变更事宜已经获得托管人的书面同意确认。委托人如不同意本次合同变更的应在本计划开放日 2023 年 4 月 26 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。截止 2023 年 4 月 26 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 5 月 4 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：第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划资产管理  
合同变更明细表

附件 2：第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划说明书变  
更明细表

附件 3：第一创业稳进平衡 2 号 FOF 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

二〇二三年四月二十四日

附件 1：第一创业稳进平衡 2 号 FOF 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”	<p>（一）订立本合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</p> <p>2、订立本合同的<b>依据</b>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>（一）订立本合同的目的、依据和原则</p> <p>.....</p> <p>2、订立本合同的<b>依据</b>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<b>原则</b>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>.....</p>	<p>3、订立本合同的<b>原则</b>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，具体以监管机构要求为准。</p> <p>.....</p>
2	“二、释义”	<p>在本合同中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：</p> <p>.....</p> <p>5、《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>6、《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>在本合同中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：</p> <p>.....</p> <p>5、《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>6、《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>.....</p> <p>15、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>（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</p>	<p>15、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>（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>民币合格境外机构投资者（RQFII）；</p> <p>.....</p>	<p>.....</p>
3	<p><b>“四、当 事人及权 利义务”</b></p> <p><b>“（六） 管理人的 权利与义 务”</b></p>	<p>1、管理人的权利</p> <p>.....</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>.....</p> <p>2、管理人的义务</p> <p>.....</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；</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</p>	<p>1、管理人的权利</p> <p>.....</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，具体以监管机构的要求为准；</p> <p>.....</p> <p>2、管理人的义务</p> <p>.....</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，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并通知托管人和委托人；</p>

		<p>托管人和委托人；</p> <p>(25) 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>(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>(25) 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>(26) 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>(27) 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>
4	<p><b>“四、当事人及权利义务”</b></p> <p><b>“（七）托管人的权利与义务”</b></p>	<p>2、托管人的义务</p> <p>.....</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>.....</p>	<p>2、托管人的义务</p> <p>.....</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，具体以监管机构的要求为准；</p> <p>.....</p>



5	<p>“五、资产管理计划的基本情况”</p> <p>“（五）资产管理计划的投资目标、投资范围、投资比例”</p>	<p>.....</p> <p>2、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资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产、金融衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>.....</p> <p>（5）金融衍生品类资产：国债期货；</p> <p>（6）本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>3、投资比例</p> <p>本计划财产投资于资产管理产品的投资比例为不低于资产总值的 80%。按照穿透合并计算后，本计划的资产配置需符合以下比例：固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；金融衍生品类资产的持仓合约价值为资产总值</p>	<p>.....</p> <p>2、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资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产、期货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>.....</p> <p>（5）期货和衍生品类资产：国债期货；</p> <p>（6）本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>3、投资比例</p> <p>本计划财产投资于资产管理产品的投资比例为不低于资产总值的 80%。按照穿透合并计算后，本计划的资产配置需符合以下比例：固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；期货和衍生品类资产的持仓合约价值为资产总值的 0-80%</p>
---	--	---	---

		<p>的 0-80%（不含）或衍生品账户权益为资产总值的 0-20%（不含）。参与证券正回购融入资金余额或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>（不含）或衍生品账户权益为资产总值的 0-20%（不含）。参与证券正回购融入资金余额或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>
6	<p><b>“八、资产管理计划的参与、退出与转让”</b></p> <p><b>“（五）管理人自有资金参与资产管理计划”</b></p> <p><b>“（六）”</b></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><b>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。</b></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>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) 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，管理人自有资金参与、退出本计划。</p> <p><b>3、风险揭示和信息披露</b></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</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</p>
--	---	---

	<p>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>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><b>3、风险揭示和信息披露</b></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>
--	--	---

7	<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资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产、金融衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>.....</p> <p>（5）金融衍生品类资产：国债期货；</p> <p>（6）本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划财产投资于资产管理产品的投资比例为不低于资产总值的 80%。按照穿透合并计算后，本计划的资产配置需符合以下比例：固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；金融衍生品类资产的持仓合约价值为资产总值的 0-80%（不含）或衍生品账户权益为资产总值的 0-20%（不</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资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产、期货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>.....</p> <p>（5）期货和衍生品类资产：国债期货；</p> <p>（6）本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>3、资产配置比例</p> <p>本计划财产投资于资产管理产品的投资比例为不低于资产总值的 80%。按照穿透合并计算后，本计划的资产配置需符合以下比例：固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；期货和衍生品类资产的持仓合约价值为资产总值的 0-80%（不含）或衍生品账户权益为资产总值的 0-20%（不含）。参与证</p>
---	--	---	--

		<p>含)。参与证券正回购融入资金余额或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>.....</p>	<p>券正回购融入资金余额或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>.....</p>
8	<p><b>“十一、资产管理计划的投资”</b></p> <p><b>“（三）”</b></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>（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和基金业协会报告。</p>
9	<p><b>“十一、资产管理计划的投资”</b></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</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</p>

<p>“（八） 资产管理 计划的投 资限制及 禁止行 为”</p>	<p>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；本计划属于基金中基金资产管理计划（FOF），基金中基金资产管理计划投资“定制”的子基金，并持有有一个或多个子基金产品的全部份额的，可豁免单只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%的组合投资要求；</p> <p>.....</p> <p>（7）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> <p>（8）现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与</p>	<p>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；本计划属于基金中基金资产管理计划（FOF），基金中基金资产管理计划投资“定制”的子基金，并持有有一个或多个子基金产品的全部份额的，可豁免单只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%的组合投资要求；</p> <p>.....</p> <p>（7）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</p>
---	--	--

	<p>之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>本计划的禁止行为包括：</p> <p>.....</p> <p>(13) 不得直接投资于商业银行信贷资产；</p> <p>(14) 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>(15) 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>(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>其他资产管理产品，金融监管机构另有规定的除外；</p> <p>(8) 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，该资产管理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>(9) 现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>本计划的禁止行为包括：</p> <p>.....</p> <p>(13) 直接投资于商业银行信贷资产；</p> <p>(14) 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>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) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>	<p>(15) 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>(16) 为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利;</p> <p>(17) 开展明股实债投资;</p> <p>(18) 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>(19) 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>(20) 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</p>
--	--	--

			<p>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>(21) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>
10	<p><b>“十四、利益冲突及关联交易”</b></p> <p><b>“（四）资产管理计划的关联交易”</b></p>	<p>委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于管理人、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交易。</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。管理人将本计划财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司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的，应在交易完成后，书面告知委托人和托管人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，具体以监管规定为准。投资于证券期货的关联交易还应当及时向证券期货交易所报告。</p> <p><b>除将本计划财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股</b></p>	<p>管理人可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易，管理人制定的划分标准、管控机制包括：</p> <p>1、关联方范围</p> <p>本计划所称关联方包括：</p> <p>(1) 本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）；</p> <p>(2) 本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>(3) 本计划的投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>(4) 与管理人、本计划的托管人、投资顾问（如有）有其他重大利害关系的机构。上述第（1）项为管理人全部资产管理计划</p>

	<p>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外，管理人不得将本计划财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。全部委托人均符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者不包含募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品）且单个委托人投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得委托人同意的除外。</p>	<p>的关联方；第（2）（3）项为本计划的关联方。</p> <p>（5）监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p> <p>2、关联交易范围：本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p> <p>（1）本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）发行或者承销期内承销的证券；</p> <p>（2）本计划财产投资于本计划托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>（3）本计划财产投资于其投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>（4）本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>（5）本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产</p>
--	---	---

			<p>管理产品；</p> <p>(6) 本计划财产投资于投资顾问(如有)担任管理人的资产管理产品(含公募基金)；</p> <p>(7) 本计划财产以本计划关联方或者以本条第(4)、(5)、(6)项规定的资产管理产品为交易对手,进行询价交易(包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款等)；</p> <p>(8) 本计划财产以本计划关联方或者以本条第(4)、(5)、(6)项规定的资产管理产品为交易对手,进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第(五)项规定的非标准化资产交易；</p> <p>(9) 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的(如本计划财产开展逆回购交易的,将交易对手、质押券等统一纳入管理),管理人遵照执行。</p> <p>3、一般关联交易和重大关联交易</p> <p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易,实行分类管理。重大关联交易是指投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证</p>
--	--	--	---

			<p>券、投资于关联方产品且金额及比例重大的（本计划为 FOF 产品或本计划投资于货币基金的除外）、与关联方及关联方产品互为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大的询价交易等需强化审批、披露、报告的关联交易；一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监管机构和基金业协会的相关要求为准。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于一般关联交易。管理人将本计划财产投资于一般关联交易的，应在交易完成后，定期书面告知委托人和托管人并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>管理人将本计划财产投资于重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，逐笔通过公告或其他方式提前通知投资者，投资者约定时间内未提出异议的视为同意。委托人提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确。同时，管理人应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，具体以监管机构的要求为准。</p>
--	--	--	--

			<p>4、关联交易的内部控制机制</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。公司制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。</p> <p>5、产品关联方名单披露方式</p> <p>本产品的关联方名单信息将通过公告的形式在管理人指定网站上披露或其他适当的方式通知委托人。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>6、其他</p> <p>除将本计划财产投资于管理人、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者承销期内承销的证券外，管理人不得将本计划财产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其</p>
--	--	--	--

			<p>他关联方提供或者变相提供融资。全部委托人均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，穿透认定该私募资产管理产品的投资者均为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）且单个委托人投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得委托人同意的除外。</p>
11	<p><b>“十七、投资指令的发送、确认和执行”</b> <b>“（四）托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序”</b></p>	<p>托管人发现管理人发送的指令违反法律法规规定或本合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并及时以书面形式通知管理人并向管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会报告。托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定或本合同约定的，应及时以书面形式通知管理人并向管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会报告。</p>	<p>托管人发现管理人发送的指令违反法律法规规定或本合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并及时以书面形式通知管理人并向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构要求为准。托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定或本合同约定的，应及时以书面形式通知管理人并向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构要求为准。</p>

12	<p><b>“十九、越权交易的界定”</b></p> <p><b>“（二）越权交易的处理程序”</b></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>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，托管人应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>.....</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>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，托管人应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>.....</p>
13	<p><b>“十九、越权交易</b></p>	<p>1、托管人仅对以下投资范围及投资比例、投资限制进行监督：</p>	<p>1、托管人仅对以下投资范围及投资比例、投资限制进行监督</p> <p>（1）投资范围</p>



<p>的界定”</p> <p>“（三）</p> <p>托管人对</p> <p>管理人投</p> <p>资运作的</p> <p>监督”</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资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产、金融衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>.....</p> <p>5）金融衍生品类资产：国债期货；</p> <p>6）本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>（2）投资比例</p> <p>本计划财产投资于资产管理产品的投资比例为不低于资产总值的 80%。按照穿透合并计算后，本计划的资产配置需符合以下比例：固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；金融衍生品类资产的持仓合约价值为资产总值的 0-80%（不含）或衍生品账户权益为资产总值的 0-20%（不含）。参与证券正回购融入资金余额或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>.....</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资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产、期货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>.....</p> <p>5）期货和衍生品类资产：国债期货；</p> <p>6）本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>（2）投资比例</p> <p>本计划财产投资于资产管理产品的投资比例为不低于资产总值的 80%。按照穿透合并计算后，本计划的资产配置需符合以下比例：固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；期货和衍生品类资产的持仓合约价值为资产总值的 0-80%（不含）或衍生品账户权益为资产总值的 0-20%（不含）。参与证券正回购融入资金余额或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>.....</p> <p>（3）投资限制</p>
--	--	---

	<p>(3) 投资限制</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；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；本计划属于基金中基金资产管理计划（FOF），基金中基金资产管理计划投资“定制”的子基金，并持有有一个或多个子基金产品的全部份额的，可豁免单只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%的组合投资要求；</p> <p>.....</p> <p>8) 现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改</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；本计划属于基金中基金资产管理计划（FOF），基金中基金资产管理计划投资“定制”的子基金，并持有有一个或多个子基金产品的全部份额的，可豁免单只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%的组合投资要求；</p>
--	--	---

		<p>或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。</p>	<p>.....</p> <p>8)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，该资产管理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>9)现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。</p>
--	--	---	---

14	<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、估值 方法”</p> <p>“（2）债 券估值方 法”</p>	<p>1) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本合同另有约定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，具体估值机构由管理人和托管人协商约定。</p> <p>2) 交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可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，确定公允价格。</p> <p>3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>4) 交易所挂牌转让的资产支持证券，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，按成本估值。</p> <p>5) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据</p>	<p>1) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本合同另有约定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，具体估值机构由管理人和托管人协商约定。</p> <p>2) 交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可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，确定公允价格。</p> <p>3)首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值。</p> <p>4) 交易所挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>5) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。</p> <p>6) 对于含投资者回售权的债券，行使回售权的，在回售登记</p>
----	---	---	---

		<p>第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。</p> <p>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。</p>	<p>日至实际收款日期间选取第三方估值机构提供的当日推荐估值净价估值, 同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日(含当日)未行使回售权的按照长代偿期对应的价格进行估值。</p> <p>7) 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>
15	<p>“二十一、资产管理计划的费用与税收”</p> <p>“(一) 资产管理</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</p>	<p>1、管理人的固定管理费及业绩报酬(浮动管理费);</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</p>

	计划费用种类”	支的其他费用。	其他费用。
16	<p>“二十一、资产管理计划的费用与税收”</p> <p>“（一）资产管理计划费用种类”</p> <p>“（二）资产管理计划费用支付标准、计算方法、支付方式</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1%年费率计提，计算方法如下：</p> $H=E \times 1\% \div 360$	<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1%年费率计提，计算方法如下：</p> $H=E \times 1\% \div 360$ <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>□ 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>□ 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>□ 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><b>付方式和 时间”</b></p>	<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>.....</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，</p>	<p>□ 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>□ 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>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> $R \square \frac{(P_1 \square P_0)}{P_0^*} \square D \square 100 \%$ <p><math>P_1</math> 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值；</p>
----------------------------	---	--

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。

## 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
$R < K$	0%	0
$K \leq R$	30%	$Y = M * (R - K) * 30% * D$

其中：

$Y$  = 业绩报酬；

$K$  = 业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准以产品的推广公告中列示为准，若产品存续期间，管理人需变更业绩报酬计提基准的，则管理人将公告新的业绩报酬计提基准，管理人将设置临时开放期供不同意新的业绩报酬计提基准的委托人退出；



$P_0^*$  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
$R < K$	0%	0
$K \leq R$	30%	$Y = M * (R - K) * 30\% * D$

其中：

$Y$ =业绩报酬；

$K$ =业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准以产品的推广公告中列示为准，若产品存续期间，管理人需变更业绩报酬计提基准的，则管理人将公告新的业绩报酬计提基准，管理人将设置临时开放期供不同意新的业绩报酬计提基准的委托人退出；

$M$ =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。

$M$ =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。

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。

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。

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>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>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>	
17	<p>“二十三、信息披露与报告”</p> <p>“（一）定期报告”</p> <p>“2、本计</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，同时抄送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</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，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><b>划的季度报告和年度报告”</b></p> <p>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>本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月的，可以不编制当期的年度报告。</p> <p>.....</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，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>本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月的，可以不编制当期的年度报告。</p> <p>.....</p>
--	---	--

18	<p>“二十三、信息披露与报告”</p> <p>“（一）定期报告”“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，具体以监管机构的要求为准。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。</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。</p>
----	---	--	--

19	<p>“二十三、信息披露与报告”</p> <p>“（二）临时报告”</p> <p>（三）</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>（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和基金业协会报告。</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>（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报告，具体以监管机构要求为准。</p>
20	<p>“二十四、风险揭示”</p> <p>“（二）</p>	<p>管理人可以将本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交易，管理人按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全</p>	<p>管理人可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易，管理人制定的划分标准、管控机制包括：</p> <p>1) 关联方范围</p>

<p>一般风险揭示” “15、其他风险” “（1）关联交易的 风险”</p>	<p>部关联交易类型的风险，同时，本计划进行关联交易时可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。</p>	<p>本计划所称关联方包括：</p> <p>① 本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）；</p> <p>② 本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>③本计划的投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>④ 与管理人、本计划的托管人、投资顾问（如有）有其他重大利害关系的机构。上述第①项为管理人全部资产管理计划的关联方；第②、③项为本计划的关联方。</p> <p>⑤ 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p> <p>2) 关联交易范围 本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p> <p>① 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方(含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司)发行或者承销期内承销的证券；</p>
--	---	---

			<p>② 本计划财产投资于本计划托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>③ 本计划财产投资于其投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>④ 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>⑤ 本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；</p> <p>⑥ 本计划财产投资于投资顾问（如有）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>⑦ 本计划财产以本计划关联方或者以本条第④、⑤、⑥项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款等）；</p> <p>⑧ 本计划财产以本计划关联方或者以本条第④、⑤、⑥项规</p>
--	--	--	---

			<p>定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产交易；</p> <p>⑨ 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的（如本计划财产开展逆回购交易的，将交易对手、质押券等统一纳入管理），管理人遵照执行。</p> <p>3) 一般关联交易和重大关联交易</p> <p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易是指投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品且金额及比例重大的（本计划为 FOF 产品或本计划投资于货币基金的除外）、与关联方及关联方产品互为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大的询价交易等需强化审批、披露、报告的关联交易；一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监管机构和基金业协会的相关要求为准。</p> <p><b>委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于一</b></p>
--	--	--	--



			<p><b>般关联交易。</b>管理人将本计划财产投资于一般关联交易的，在交易完成后，定期书面告知委托人和托管人并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><b>管理人将本计划财产投资于重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，逐笔通过公告等方式提前通知投资者，投资者约定时间内未提出异议的视为同意。</b>委托人提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确。同时，管理人应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，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>4) 关联交易的内部控制机制</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。管理人为此制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。</p>
--	--	--	--

			<p>5) 产品关联方名单披露方式</p> <p>本产品的关联方名单信息将通过公告的形式在管理人指定网站上披露或其他适当的方式通知委托人。若管理人指定网站变更, 管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>管理人按照上述标准及机制进行关联交易管理时, 需按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查, 存在无法监控全部关联交易类型的风险, 同时, 本计划进行关联交易时可能存在一定的利益冲突风险, 由此造成的损失由本计划财产承担。</p>
21	<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>.....</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>.....</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</p>	<p>(一) 资产管理合同的变更</p> <p>.....</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>.....</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7项约定的情形除外, 具体以监管机构要求为准。</p>

	<p>会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出机构，前述第 7 项约定的情形除外。</p> <p>（五）资产管理计划的清算</p> <p>.....</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>（1）本计划终止情形发生后，由本计划财产清算小组负责统一接管本计划财产；</p> <p>（2）本计划财产清算小组根据情况确定具体的清算期限；</p> <p>（3）本计划财产清算小组对本计划财产进行清理和确认；</p> <p>（4）对本计划财产进行评估和变现；</p> <p>（5）制作清算报告；</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>（7）对本计划财产进行分配。</p> <p>3、本计划清算费用</p> <p>清算费用是指本计划财产清算小组在进行本计划财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由本计划财产清算小</p>	<p>（五）资产管理计划的清算</p> <p>.....</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>（1）本计划终止情形发生后，由本计划财产清算小组负责统一接管本计划财产；</p> <p>（2）本计划财产清算小组根据情况确定具体的清算期限；</p> <p>（3）本计划财产清算小组对本计划财产进行清理和确认；</p> <p>（4）对本计划财产进行评估和变现；</p> <p>（5）制作清算报告；</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，具体以监管机构的要求为准；</p> <p>（7）对本计划财产进行分配。</p> <p>3、本计划清算费用</p> <p>清算费用是指本计划财产清算小组在进行本计划财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由本计划财产清算小组优先从本计划财产中支付。</p> <p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p>
--	--	--

	<p>组优先从本计划财产中支付。</p> <p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>依据本计划财产清算的分配方案，将本计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后，按本计划委托人持有的计划份额比例进行分配，本合同另有约定的除外，本计划财产按照以下顺序进行分配：</p> <p>(1) 支付清算费用；</p> <p>(2) 缴纳所欠税款；</p> <p>(3) 清偿本计划债务：本计划债务主要包括应付管理费、托管费、银行间账户维护费、交易佣金、证券交易费用、银行汇划费用、销户费、管理人代表本计划及委托人处理本计划涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出等，除交易所、证券登记结算机构等自动扣缴的费用外，其他费用的清偿由管理人、托管人核对无误后，由管理人向托管人出具投资指令，由托管人复核后支付；</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</p>	<p>依据本计划财产清算的分配方案，将本计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后，按本计划委托人持有的计划份额比例进行分配，本合同另有约定的除外，本计划财产按照以下顺序进行分配：</p> <p>(1) 支付清算费用；</p> <p>(2) 缴纳所欠税款；</p> <p>(3) 清偿本计划债务：本计划债务主要包括应付管理费、托管费、银行间账户维护费、交易佣金、证券交易费用、银行汇划费用、销户费、管理人代表本计划及委托人处理本计划涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出等，除交易所、证券登记结算机构等自动扣缴的费用外，其他费用的清偿由管理人、托管人核对无误后，由管理人向托管人出具投资指令，由托管人复核后支付；</p> <p>(4) 按本计划委托人所持计划份额比例进行分配；</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；</p> <p>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>本计划财产未按前述第(1)、(2)、(3)项约定进行清偿前，</p>
--	---	--

	<p>前，不得分配给本计划委托人。</p> <p><b>5、本计划二次清算</b></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可在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><b>6、本计划清算报告的告知安排</b></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>.....</p>	<p>不得分配给本计划委托人。</p> <p><b>5、本计划二次清算</b></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可在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，具体以监管机构的要求为准。</p> <p><b>6、本计划清算报告的告知安排</b></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，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>.....</p>
--	--	--

附件 2：第一创业稳进配置 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书变更明细表

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
1	“基本信 息”“投 资限制”	<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；本计划属于基金中基金资产管理计划（FOF），基金中基金资产</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</p>

	<p>管理计划投资“定制”的子基金，并持有有一个或多个子基金产品的全部份额的，可豁免单只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%的组合投资要求；</p> <p>.....</p> <p>(8) 现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。</p> <p>.....</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</p>	<p>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；本计划属于基金中基金资产管理计划（FOF），基金中基金资产管理计划投资“定制”的子基金，并持有有一个或多个子基金产品的全部份额的，可豁免单只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%的组合投资要求；</p> <p>.....</p> <p>(8) 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，该资产管理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>(9) 现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。</p> <p>.....</p>
--	--	---

	<p>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>(18) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>	<p>(16) 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>(17) 为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；</p> <p>(18) 开展明股实债投资；</p> <p>(19) 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> <ol style="list-style-type: none"> <li>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；</li> <li>2) 投资项目违反国家环境保护政策要求；</li> <li>3) 通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。</li> </ol> <p>(20) 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</p>
--	---	---



			<p>定为准；</p> <p>(21) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>
	<p><b>“管理人 自有资金 参与情 况”</b></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>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 日通知委托人和托管人。</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>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>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</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</p>
--	---	---

		<p>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>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>
<p><b>“费用、报酬”</b></p> <p><b>“费用种类（计提标准、方</b></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0.2%年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.2\% \div 360$ <p>H 为每日应计提的管理费；</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0.2%年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.2\% \div 360$ <p>H 为每日应计提的固定管理费；</p>

	<p><b>法、支付方式)”</b></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>.....</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）（见下文“业绩报酬”）</p> <p>.....</p>
	<p><b>“费用、报酬”</b></p> <p><b>“业绩报酬”</b></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，</p>	<p>1) 管理人收取业绩报酬的原则：</p> <p>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>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>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>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>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，</p>

	<p>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> $R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \times D \times 100\%$ <p><math>P_1</math> 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值；</p> <p><math>P_0</math> 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值；</p>	<p>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><b>本计划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，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。</b></p> <p>年化收益率的计算公式如下：</p> $R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \times D \times 100\%$ <p><math>P_1</math> 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值；</p> <p><math>P_0</math> 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值；</p> <p><math>P_0^*</math> 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；</p> <p><math>D</math> 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</p>
--	--	---

$P_0^*$  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：

其中：

年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式
$R < K$	0%	0
$K \leq R$	15%	$Y = M * (R - K) * 15\% * D$

$Y$ =业绩报酬；

$K$ =业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准以产品的推广公告中列示为准，若产品存续期间，管理人需变更业绩报酬计提基准的，则管理人将公告新的业绩报酬计提基准，管理人将设置临时开放期供不同意新的业绩报酬计提基准的委托人退出；

$M$ =每笔参与份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计

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
$R < K$	0%	0
$K \leq R$	15%	$Y = M * (R - K) * 15\% * D$

其中：

$Y$ =业绩报酬；

$K$ =业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准以产品的推广公告中列示为准，若产品存续期间，管理人需变更业绩报酬计提基准的，则管理人将公告新的业绩报酬计提基准，管理人将设置临时开放期供不同意新的业绩报酬计提基准的委托人退出；

$M$ =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。

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；

		<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>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>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><b>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。</b></p>
<p>“信息披露”“定期报告”</p>	<p>.....</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。</p>	<p>.....</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。</p>	<p>.....</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。</p>

	<p>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，同时抄送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>本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的，可以不编制当期的年度报告。</p> <p>.....</p> <p>3、年度审计报告</p>	<p>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，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，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>本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的，可以不编制当期的年度报告。</p> <p>.....</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</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，具体以监管机构的要求为准。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。</p> <p>4、对账单</p> <p>管理人至少每个季度以邮寄方式向委托人寄送对账单。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。</p> <p>委托人应向管理人提供邮寄地址等资料，因委托人未正常提供以上信息、邮寄运营商系统平台故障及内部操作等原因导致委托人未能获得邮寄对账单的，管理人不承担任何责任。</p>	<p>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。</p> <p>4、对账单</p> <p>管理人至少每个季度以邮寄方式向委托人寄送对账单。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。</p> <p>委托人应向管理人提供邮寄地址等资料，因委托人未正常提供以上信息、邮寄运营商系统平台故障及内部操作等原因导致委托人未能获得邮寄对账单的，管理人不承担任何责任。</p>
“信息披	本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、	本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、资

	<p><b>露”“临时报告”</b></p> <p>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> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、管理人或托管人变更;</li> <li>2、本计划运作过程中,负责本计划的投资经理发生变更,或出现其他可能对本计划的持续运作产生重大影响的事项;</li> <li>3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请;</li> <li>4、本计划终止和清算;</li> <li>5、本合同的补充、修改与变更;</li> <li>6、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项;</li> <li>7、负责本计划的代理销售机构发生变更;</li> <li>8、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;</li> <li>9、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责;</li> <li>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</li> </ol>	<p>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> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、管理人或托管人变更;</li> <li>2、本计划运作过程中,负责本计划的投资经理发生变更,或出现其他可能对本计划的持续运作产生重大影响的事项;</li> <li>3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请;</li> <li>4、本计划终止和清算;</li> <li>5、本合同的补充、修改与变更;</li> <li>6、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项;</li> <li>7、负责本计划的代理销售机构发生变更;</li> <li>8、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;</li> <li>9、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责;</li> <li>10、资产计价出现错误(当资产估值导致本计划单位净值小</li> </ol>
--	--	--

		<p>错误);</p> <p>11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更;</p> <p>12、其他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。</p>	<p>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>11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更;</p> <p>12、其他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。</p>
	<p><b>“终止和清算”</b></p>	<p>资产管理计划的终止</p> <p>有下列情形之一的,本计划应当终止:</p> <p>1、本计划存续期届满且不展期;</p> <p>2、经全体委托人、管理人和托管人协商一致决定终止的;</p> <p>3、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,且在六个月内没有新的管理人承接;</p> <p>4、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,且在六个月内没有新的托管人承接;</p> <p>5、本计划存续期间,持续5个工作日委托人少于2人;</p> <p>6、本计划成立后,未在基金业协会完成备案或未通过基金业协会的产品备案或未取得产品的备案确认函的,则管理人有权终</p>	<p>(四)资产管理计划的终止</p> <p>有下列情形之一的,本计划应当终止:</p> <p>1、本计划存续期届满且不展期;</p> <p>2、经全体委托人、管理人和托管人协商一致决定终止的;</p> <p>3、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,且在六个月内没有新的管理人承接;</p> <p>4、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,且在六个月内没有新的托管人承接;</p> <p>5、本计划存续期间,持续5个工作日委托人少于2人;</p> <p>6、本计划成立后,未在基金业协会完成备案或未通过基金业协会的产品备案或未取得产品的备案确认函的,则管理人有权终</p>

	<p>权终止本计划，且不承担任何责任；</p> <p>7、不可抗力的发生导致本计划不能存续；</p> <p>8、因监管政策或监管规则的变化导致本产品违反相关监管政策或监管规则要求的，或监管机构通知（无论是口头或书面形式的通知）管理人停止开展此类资产管理产品的，则管理人有权停止开放本计划份额的参与并终止本计划，且不承担任何责任；</p> <p>9、管理人有权根据产品的运作情况决定提前终止本计划；</p> <p>10、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。</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7项约定的情形除外。</p> <p>资产管理计划的清算</p> <p>1、本计划财产清算小组</p> <p>本计划在发生终止情形起5个工作日内，由管理人组织成立本计划财产清算小组，在本计划财产清算小组接管本计划财</p>	<p>止本计划，且不承担任何责任；</p> <p>7、不可抗力的发生导致本计划不能存续；</p> <p>8、因监管政策或监管规则的变化导致本产品违反相关监管政策或监管规则要求的，或监管机构通知（无论是口头或书面形式的通知）管理人停止开展此类资产管理产品的，则管理人有权停止开放本计划份额的参与并终止本计划，且不承担任何责任；</p> <p>9、管理人有权根据产品的运作情况决定提前终止本计划；</p> <p>10、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。</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7项约定的情形除外，具体以监管机构要求为准。</p> <p>（五）资产管理计划的清算</p> <p>1、本计划财产清算小组</p> <p>本计划在发生终止情形起5个工作日内，由管理人组织成立本计划财产清算小组，在本计划财产清算小组接管本计划财产之前，管理人和托管人应按照本合同的约定继续履行保护本计划财产安全的职责。</p>
--	--	--

	<p>产之前，管理人和托管人应按照本合同的约定继续履行保护本计划财产安全的职责。</p> <p>本计划财产清算小组成员由管理人、托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员，本计划财产清算小组负责本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配，本计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>(1) 本计划终止情形发生后，由本计划财产清算小组负责统一接管本计划财产；</p> <p>(2) 本计划财产清算小组根据情况确定具体的清算期限；</p> <p>(3) 本计划财产清算小组对本计划财产进行清理和确认；</p> <p>(4) 对本计划财产进行评估和变现；</p> <p>(5) 制作清算报告；</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>(7) 对本计划财产进行分配。</p> <p>3、本计划清算费用</p>	<p>本计划财产清算小组成员由管理人、托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员，本计划财产清算小组负责本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配，本计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>(1) 本计划终止情形发生后，由本计划财产清算小组负责统一接管本计划财产；</p> <p>(2) 本计划财产清算小组根据情况确定具体的清算期限；</p> <p>(3) 本计划财产清算小组对本计划财产进行清理和确认；</p> <p>(4) 对本计划财产进行评估和变现；</p> <p>(5) 制作清算报告；</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>(7) 对本计划财产进行分配。</p> <p>3、本计划清算费用</p> <p>清算费用是指本计划财产清算小组在进行本计划财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由本计划财产清算小组优先</p>
--	--	--

	<p>清算费用是指本计划财产清算小组在进行本计划财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由本计划财产清算小组优先从本计划财产中支付。</p> <p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>依据本计划财产清算的分配方案，将本计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后，按本计划委托人持有的计划份额比例进行分配，本合同另有约定的除外，本计划财产按照以下顺序进行分配：</p> <p>(1) 支付清算费用；</p> <p>(2) 缴纳所欠税款；</p> <p>(3) 清偿本计划债务：本计划债务主要包括应付管理费、托管费、银行间账户维护费、交易佣金、证券交易费用、银行汇划费用、销户费、管理人代表本计划及委托人处理本计划涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出等，除交易所、证券登记结算机构等自动扣缴的费用外，其他费用的清偿由管理人、托管人核对无误后，由管理人向托管人出具投资指令，由托管人复核后支付。</p>	<p>从本计划财产中支付。</p> <p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>依据本计划财产清算的分配方案，将本计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后，按本计划委托人持有的计划份额比例进行分配，本合同另有约定的除外，本计划财产按照以下顺序进行分配：</p> <p>(1) 支付清算费用；</p> <p>(2) 缴纳所欠税款；</p> <p>(3) 清偿本计划债务：本计划债务主要包括应付管理费、托管费、银行间账户维护费、交易佣金、证券交易费用、银行汇划费用、销户费、管理人代表本计划及委托人处理本计划涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出等，除交易所、证券登记结算机构等自动扣缴的费用外，其他费用的清偿由管理人、托管人核对无误后，由管理人向托管人出具投资指令，由托管人复核后支付；</p> <p>(4) 按本计划委托人所持计划份额比例进行分配；</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；</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可在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。</p> <p>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>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>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可在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。并报告基金业协会，具体以监管机构的要求为准。</p>
--	---	--

	<p>7、本计划相关账户销户</p> <p>(1) 证券类账户销户</p> <p>本计划证券类资产完成变现、结清相关权益、缴清相关费用后，托管人负责证券类账户的销户工作，管理人负责基金账户销户，销户过程中其他各方应给以必要的配合。</p> <p>在证券资产变现完毕、相关权益结清后 5 个工作日内，管理人将托管人注销证券账户的通知书及其他销户资料寄送托管人，托管人原则上应于收到管理人提供资料后的 10 个工作日内完成。</p> <p>管理人在开放式基金变现完毕、相关权益结清后 15 个工作日内完成场外开放式基金账户注销，并向托管人出具销户确认通知书。</p> <p>(2) 银行托管账户销户</p> <p>本计划财产债权、债务结清后，管理人向托管人出具投资指令，托管人复核无误后，向委托人支付所有剩余财产，并于当日注销本计划财产托管账户。剩余财产支付过程中发生的银行费用，由委托人负担。向委托人支付的托管账户利息，以销</p>	<p>7、本计划相关账户销户</p> <p>(1) 证券类账户销户</p> <p>本计划证券类资产完成变现、结清相关权益、缴清相关费用后，托管人负责证券类账户的销户工作，管理人负责基金账户销户，销户过程中其他各方应给以必要的配合。</p> <p>在证券资产变现完毕、相关权益结清后 5 个工作日内，管理人将托管人注销证券账户的通知书及其他销户资料寄送托管人，托管人原则上应于收到管理人提供资料后的 10 个工作日内完成。</p> <p>管理人在开放式基金变现完毕、相关权益结清后 15 个工作日内完成场外开放式基金账户注销，并向托管人出具销户确认通知书。</p> <p>(2) 银行托管账户销户</p> <p>本计划财产债权、债务结清后，管理人向托管人出具投资指令，托管人复核无误后，向委托人支付所有剩余财产，并于当日注销本计划财产托管账户。剩余财产支付过程中发生的银行费用，由委托人负担。向委托人支付的托管账户利息，以销</p>
--	---	---



	<p>户时银行实际支付为准。</p> <p>与本计划财产有关的其他账户的销户，由管理人与托管人协商一致后办理。</p> <p>8、本计划存续及清算期间，为支付本计划财产承担的各项税费，管理人有权预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的税费的，差额部分由管理人通知委托人补足，管理人不承担垫付责任，委托人应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。</p> <p>本计划清算期间，为支付最低备付金、结算保证金，管理人有权预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的备付金、保证金金额的，差额部分由管理人通知委托人补足，管理人不承担垫付责任，委托人应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。</p> <p>9、本计划清算账册及文件应当由管理人自清算完毕之日起保存 20 年以上。</p>	<p>与本计划财产有关的其他账户的销户，由管理人与托管人协商一致后办理。</p> <p>8、本计划存续及清算期间，为支付本计划财产承担的各项税费，管理人有权预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的税费的，差额部分由管理人通知委托人补足，管理人不承担垫付责任，委托人应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。</p> <p>本计划清算期间，为支付最低备付金、结算保证金，管理人有权预留相应金额，若预留金额不足以支付实际需缴存的备付金、保证金金额的，差额部分由管理人通知委托人补足，管理人不承担垫付责任，委托人应当及时追加资金，不得以任何理由拒绝补足义务。</p> <p>9、本计划清算账册及文件应当由管理人自清算完毕之日起保存 20 年以上。</p>
--	--	---

附件：第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划说明书变更对照表

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
1	“基本信息”“投资范围及比例”	<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资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产、金融衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>.....</p> <p>(5) 金融衍生品类资产：国债期货；</p> <p>(6) 本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>资产配置比例：</p> <p>本计划财产投资于资产管理产品的投资比例为不低于资产总值的 80%。按照穿透合并计算后，本计划的资产配置需符合以下比例：固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；金融衍生品类资产的持仓合约价值为资产总值的 0-80%（不含）或衍生品账户权益为资产总值的 0-20%（不含）。参与</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资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产、期货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>.....</p> <p>(5) 期货和衍生品类资产：国债期货；</p> <p>(6) 本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>资产配置比例：</p> <p>本计划财产投资于资产管理产品的投资比例为不低于资产总值的 80%。按照穿透合并计算后，本计划的资产配置需符合以下比例：固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%（不含）；期货和衍生品类资产的持仓合约价值为资产总值的 0-80%（不含）或衍生品账户权益为资产总值的 0-20%（不含）。参与证券正回购融</p>

		<p>证券正回购融入资金余额或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>.....</p>	<p>入资金余额或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>.....</p>
2	“基本信息”“投资限制”	<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；本计划属于基金中基金资产管理计划（FOF），基金中基金资产管理计划投资“定制”的子基金，并持有一个或多个子基金产品的</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</p>

	<p>全部份额的，可豁免单只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%的组合投资要求；</p> <p>.....</p> <p>(8) 现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>本计划的禁止行为包括：</p> <p>.....</p> <p>(13) 不得直接投资于商业银行信贷资产；</p> <p>(14) 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>(15) 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>(16) 不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的</p>	<p>的比例限制；本计划属于基金中基金资产管理计划（FOF），基金中基金资产管理计划投资“定制”的子基金，并持有一个或多个子基金产品的全部份额的，可豁免单只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%的组合投资要求；</p> <p>.....</p> <p>(8) 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，该资产管理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>(9) 现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>本计划的禁止行为包括：</p>
--	---	--

	<p>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) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>	<p>.....</p> <p>(13) 直接投资于商业银行信贷资产；</p> <p>(14) 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>(15) 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>(16) 为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；</p> <p>(17) 开展明股实债投资；</p> <p>(18) 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>(19) 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>(20) 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>(21) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>
3	“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</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</p>

	<p>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 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>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</p>	<p>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</p>
--	---	---

		<p>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>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>
4	<p><b>“费用、 报酬”</b></p> <p><b>“费用种</b></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 1% 年费率计提，计算方法如下：</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（浮动管理费）；</p> <p>2、托管人的托管费；</p>



	<p>类（计提标准、方法、支付方式）”</p>	<p><math>H = E \times 1\% \div 360</math></p> <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>.....</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 1% 年费率计提，计算方法如下：</p> <p><math>H = E \times 1\% \div 360</math></p> <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）（见下文“业绩报酬”）</p> <p>.....</p>
5	<p><b>“费用、报酬”</b></p> <p><b>“业绩报酬”</b></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>管理人的业绩报酬（浮动管理费）</p> <p>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>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>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>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>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>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</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> $R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \times D \times 100\%$ <p><math>P_1</math> 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值；</p> <p><math>P_0</math> 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值；</p> <p><math>P_0^*</math> 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；</p> <p><math>D</math> 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）；</p>	<p>（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> $R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \times D \times 100\%$ <p><math>P_1</math> 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值；</p> <p><math>P_0</math> 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值；</p> <p><math>P_0^*</math> 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；</p> <p><math>D</math> 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）；</p> <p><math>R</math> 为年化收益率。</p>
--	---	---

$R$ 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
$R < K$	0%	0
$K \leq R$	30%	$Y = M * (R - K) * 30\% * D$

其中：

$Y$  = 业绩报酬；

$K$  = 业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准以产品的推广公告中列示为准，若产品存续期间，管理人需变更业绩报酬计提基准的，则管理人将公告新的业绩报酬计提基准，管理人将设置临时开放期供不同意新的业绩报酬计提基准的委托人退出；

$M$  = 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。

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。

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
$R < K$	0%	0
$K \leq R$	30%	$Y = M * (R - K) * 30\% * D$

其中：

$Y$  = 业绩报酬；

$K$  = 业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准以产品的推广公告中列示为准，若产品存续期间，管理人需变更业绩报酬计提基准的，则管理人将公告新的业绩报酬计提基准，管理人将设置临时开放期供不同意新的业绩报酬计提基准的委托人退出；

$M$  = 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。

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>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>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>
6	<p><b>“信息披露”“定期报告”</b></p>	<p>定期报告包括本计划单位净值报告、本计划的资产管理季度及年度报告、托管年度报告、年度审计报告和对账单。</p> <p>1、本计划单位净值报告</p> <p>披露时间: 本计划存续期内每周最后一个工作日及每个开放日的计划单位净值及计划累计单位净值将于后三个工作日内在管理人网站上公布。</p> <p>披露方式: 本计划的单位净值、累计单位净值等信息将在管理人指定网站上披露, 委托人可随时查阅。若管理人指定网站变更, 管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p>	<p>定期报告包括本计划单位净值报告、本计划的资产管理季度及年度报告、托管年度报告、年度审计报告和对账单。</p> <p>1、本计划单位净值报告</p> <p>披露时间: 本计划存续期内每周最后一个工作日及每个开放日的计划单位净值及计划累计单位净值将于后三个工作日内在管理人网站上公布。</p> <p>披露方式: 本计划的单位净值、累计单位净值等信息将在管理人指定网站上披露, 委托人可随时查阅。若管理人指定网站变更, 管理人将提前进行相关信息的详细披露。</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，同时抄送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>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，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，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>本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月的，可以不编制当期的年度报告。</p>
--	---	--

		<p>本计划成立不足 3 个月或存续期间不足 3 个月的，可以不编制当期的年度报告。</p> <p>.....</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，具体以监管机构的要求为准。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报告，产品终止当年，无需出具年度审计报告。</p> <p>.....</p>	<p>.....</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。</p> <p>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报告，产品终止当年，无需出具年度审计报告。</p> <p>.....</p>
7	“信息披露”“临时报告”	<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>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</p>

		.....	的要求为准。临时报告的情形包括但不限于：  .....
8	<b>“终止和清算”</b>	<p>资产管理计划的终止</p> <p>有下列情形之一的，本计划应当终止：</p> <p>.....</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7项约定的情形除外。</p> <p>资产管理计划的清算</p> <p>.....</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>(1) 本计划终止情形发生后，由本计划财产清算小组负责统一接管本计划财产；</p> <p>(2) 本计划财产清算小组根据情况确定具体的清算期限；</p> <p>(3) 本计划财产清算小组对本计划财产进行清理和确认；</p> <p>(4) 对本计划财产进行评估和变现；</p>	<p>资产管理计划的终止</p> <p>有下列情形之一的，本计划应当终止：</p> <p>.....</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7项约定的情形除外，具体以监管机构要求为准。</p> <p>资产管理计划的清算</p> <p>.....</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>(1) 本计划终止情形发生后，由本计划财产清算小组负责统一接管本计划财产；</p> <p>(2) 本计划财产清算小组根据情况确定具体的清算期限；</p> <p>(3) 本计划财产清算小组对本计划财产进行清理和确认；</p> <p>(4) 对本计划财产进行评估和变现；</p> <p>(5) 制作清算报告；</p>



	<p>(5) 制作清算报告;</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>(7) 对本计划财产进行分配。</p> <p>3、本计划清算费用</p> <p>清算费用是指本计划财产清算小组在进行本计划财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由本计划财产清算小组优先从本计划财产中支付。</p> <p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>依据本计划财产清算的分配方案,将本计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后,按本计划委托人持有的计划份额比例进行分配,本合同另有约定的除外,本计划财产按照以下顺序进行分配:</p> <p>(1) 支付清算费用;</p> <p>(2) 缴纳所欠税款;</p> <p>(3) 清偿本计划债务:本计划债务主要包括应付管理费、托管费、银行间账户维护费、交易佣金、证券交易费用、银行</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,具体以监管机构的要求为准;</p> <p>(7) 对本计划财产进行分配。</p> <p>3、本计划清算费用</p> <p>清算费用是指本计划财产清算小组在进行本计划财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由本计划财产清算小组优先从本计划财产中支付。</p> <p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>依据本计划财产清算的分配方案,将本计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后,按本计划委托人持有的计划份额比例进行分配,本合同另有约定的除外,本计划财产按照以下顺序进行分配:</p> <p>(1) 支付清算费用;</p> <p>(2) 缴纳所欠税款;</p> <p>(3) 清偿本计划债务:本计划债务主要包括应付管理费、托管费、银行间账户维护费、交易佣金、证券交易费用、银行汇划费用、销户费、管理人代表本计划及委托人处理本计划涉及诉讼、</p>
--	--	---

	<p>汇划费用、销户费、管理人代表本计划及委托人处理本计划涉及诉讼、仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出等，除交易所、证券登记结算机构等自动扣缴的费用外，其他费用的清偿由管理人、托管人核对无误后，由管理人向托管人出具投资指令，由托管人复核后支付。</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可在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。</p> <p>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</p>	<p>仲裁或争议解决的事项所产生的费用及支出等，除交易所、证券登记结算机构等自动扣缴的费用外，其他费用的清偿由管理人、托管人核对无误后，由管理人向托管人出具投资指令，由托管人复核后支付。</p> <p>(4) 按本计划委托人所持计划份额比例进行分配；</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；</p> <p>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>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可在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</p>
--	---	--

	<p>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>.....</p>	<p>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，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，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>.....</p>
--	---	--

附件：第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书变更对照表

序号	位置	原风险揭示书	变更后风险揭示书
1	“二、风险揭示” “（二）一般风险揭示” “15、其	<p>管理人可以将本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交易，管理人按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险，同时，本计划进行关联交易时可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。</p>	<p>管理人可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易，管理人制定的划分标准、管控机制包括：</p> <p>1) 关联方范围</p> <p>本计划所称关联方包括：</p> <p>① 本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关</p>

	<p>他风险”</p> <p>“（1）</p> <p>关联交易</p> <p>的风险”</p>		<p>关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）；</p> <p>② 本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>③本计划的投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>④ 与管理人、本计划的托管人、投资顾问（如有）有其他重大利害关系的机构。上述第①项为管理人全部资产管理计划的关联方；第②、③项为本计划的关联方。</p> <p>⑤ 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p> <p>2) 关联交易范围：本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p> <p>① 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）发行或者承销期内承销的证券；</p> <p>② 本计划财产投资于本计划托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p>
--	---	--	---

			<p>③ 本计划财产投资于其投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>④ 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>⑤ 本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；</p> <p>⑥ 本计划财产投资于投资顾问（如有）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>⑦ 本计划财产以本计划关联方或者以本条第④、⑤、⑥项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款等）；</p> <p>⑧ 本计划财产以本计划关联方或者以本条第④、⑤、⑥项规定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资</p>
--	--	--	--

			<p>产交易；</p> <p>⑨ 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的（如本计划财产开展逆回购交易的，将交易对手、质押券等统一纳入管理），管理人遵照执行。</p> <p>3) 一般关联交易和重大关联交易</p> <p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易是指投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品且金额及比例重大的（本计划为 FOF 产品或本计划投资于货币基金的除外）、与关联方及关联方产品互为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大的询价交易等需强化审批、披露、报告的关联交易；一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监管机构和基金业协会的相关要求为准。</p> <p><b>委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于一般关联交易。</b>管理人将本计划财产投资于一般关联交易的，在交易完成后，定期书面告知委托人和托管人并向管理人住所地中国证</p>
--	--	--	---

			<p>监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p><b>管理人将本计划财产投资于重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，逐笔通过公告等方式提前通知投资者，投资者约定时间内未提出异议的视为同意。</b></p> <p>委托人提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确。同时，管理人应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，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>4) 关联交易的内控机制</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。管理人为此制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。</p> <p>5) 产品关联方名单披露方式</p> <p>本产品的关联方名单信息将通过公告的形式在管理人指定网</p>
--	--	--	--

			<p>站上披露或其他适当的方式通知委托人。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>管理人按照上述标准及机制进行关联交易管理时，需按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险，同时，本计划进行关联交易时可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。</p>
--	--	--	--