

关于第一创业基础设施 2 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，国元证券股份有限公司作为托管人的第一创业基础设施 2 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2022 年 7 月 6 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《第一创业基础设施 2 号集合资产管理计划资产管理合同》、《第一创业基础设施 2 号集合资产管理计划说明书》和《第一创业基础设施 2 号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、修改前言和释义；
- 2、修改当事人及权利义务；
- 3、修改投资范围、投资比例、投资策略、投资限制及禁止行为；
- 4、修改资产管理计划的成立与备案；
- 5、修改资产管理计划的参与、退出时间和退出费用；
- 6、修改管理人自有资金参与、退出资产管理计划安排；
- 7、修改资产管理计划的关联交易；
- 8、修改越权交易的界定；
- 9、修改资产管理计划的估值；

10、调整管理费（固定管理费）及业绩报酬（浮动管理费）的安排；

11、修改信息披露与报告；

12、修改风险揭示；

13、修改资产管理合同的变更、终止与财产清算。

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 5 月 19 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。2023 年 5 月 19 日提出退出申请的，不收取退出费用。截止 2023 年 5 月 19 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 23 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 2 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 2 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 2 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

二〇二三年五月十八日

附件 1：第一创业基础设施 2 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	<p>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。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处，应当以届时就本合同做出相应的变更和调整。</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</p>	<p>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。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时就本合同做出相应的变更和调整。</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</p>

	<p>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所在地中国证监会派出机构。</p>	<p>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告管理人住所所在地中国证监会派出机构, 具体以监管机构要求为准。</p>
<p>2</p> <p>二、释 义</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>.....</p> <p>15、合格投资者：指具备相应风险识别能力和风险承受能力, 投资于单只资产管理产品不低于一定金额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：家庭金融资产不低于 300 万元, 家庭金融资产不低于 500</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>15、合格投资者：指具备相应风险识别能力和风险承受能力, 投资于单只资产管理产品不低于一定金额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>

3	四、当 事人及 权利义 务	<p>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) 基本养老保险、社会保障基金、企业年金等养老金，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>(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、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) 基本养老保险、社会保障基金、年金基金等养老金，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>(三) 托管人</p> <p>机构名称：国元证券股份有限公司</p> <p>负责人：俞仕新</p> <p>(六) 管理人的权利与义务</p>	<p>(三) 托管人</p> <p>机构名称：国元证券股份有限公司</p> <p>法定代表人：沈和付</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, 应当及时采取制止措施, 并向中国证监会、中国证监局及基金业协会;</p> <p>2、管理人的义务</p> <p>(19) 按照法律、法规及本合同的约定, 编制并向委托人披露的本计划季度、年度等定期报告, 并向基金业协会备案, 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>.....</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</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, 应当及时采取制止措施, 并向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、法规及本合同的约定, 编制并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>.....</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) 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>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>(9) 编制托管年度报告，报送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中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准；</p>
<p>4</p> <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</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</p>

	<p>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）权益类资产：公开募集基础设施证券投资基金（REITs）（以下简称“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>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例为资产总值的80%（含）-100%（含）；投向权益类资产的投资比例</p>	<p>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、公募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</p>
--	---	---

	<p>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>可交易之日起的 10 个交易日日内卖出。</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>对于本计划按照穿透原则合并计算投资限制比例的, 管理人应提供相关资料以供托管人监督履职。</p>
<p>七、资产管理计划的成立与</p> <p>5</p>	<p>(一) 资产管理计划成立的条件和日期</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</p>	<p>(一) 资产管理计划成立的条件和日期</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</p>

备案	<p>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>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、资产缴付证明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>
八、资产管理计划的参与、退出与转让	<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>.....</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，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</p>
6		

	<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>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</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>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承担的损失的责任。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，并向住所所在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 个工作日日后仍超限的，管理人将在其后 5 个工作日处理。</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承担的损失的责任。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，并取得其同意。管理人和托管人应书面达成一致，同时管理人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、</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>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</p>
--	---	--

		<p>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>	<p>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>
<p>8</p> <p>十一、资产管理计划的资产管理的投资</p>	<p>(二) 资产管理计划的资产管理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</p>	<p>(二) 资产管理计划的资产管理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</p>	<p>(二) 资产管理计划的资产管理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</p>

	<p>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）权益）、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）权益）、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）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>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）权益），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）权益）、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>(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>(六) 资产管理计划的投资策略</p> <p>3、管理人投资管理的方法和标准</p> <p>本计划以有效控制投资风险和保持产品流动性为前提, 综合考</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額或比例。</p> <p>对于本计划按照穿透原则合并计算投资限制比例的, 管理人应提供相关资料以供托管人监督履职。</p>
--	--	--

	<p>量宏观经济运行情况、市场流动性、资产风险收益率水平，在严谨深入的研究分析基础上，主要配置货币市场基金、债券型证券投资基金等固定收益类资产，提升产品的投资业绩。</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>(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报告。</p> <p>.....</p> <p>(六) 资产管理计划的投资策略</p> <p>3、管理人投资管理的方法和标准</p> <p>本计划以有效控制投资风险和保持产品流动性为前提，综合考量宏观经济运行情况、市场流动性、资产风险收益率水平，在严谨深入的研究分析基础上，主要配置固定收益类资产及固定收益类资产管理产品，提升产品的投资业绩。</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>(2) 本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%，计算总资产时，应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>(3) 本计划参与公募 REITs、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本计划的总资产，且所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>(4) 本计划投向的资产支持证券及资产支持票据仅限于在证券交易所与银行间市场挂牌转让或交易流通的资产支持证券及资产支持票据的优先级份额，不投向以信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权为底层基础资产的资产支持证券及资产支持票据。</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</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%，单一融资本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>(2) 本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%，计算总资产时，应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>(3) 本计划参与公募 REITs、债券、可转换公司债券、可交换</p>
--	---	---

	<p>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>(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>公司债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过本计划的总资产，且所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>(4) 本计划投向的资产支持证券及资产支持票据仅限于在证券交易所与银行间市场挂牌转让或交易流通的资产支持证券及资产支持票据的优先级份额，不投向以信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权为底层基础资产的资产支持证券及资产支持票据；</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> <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) 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"> 1) 投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录； 2) 投资项目违反国家环境保护政策要求； 3) 通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目； <p>(17) 将本计划财产用于投资于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</p>
--	--	---

		<p>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) 直接投资于商业银行信贷资产；</p> <p>(19) 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) 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为和领域；</p> <p>(21) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>
<p>十一、 资产管理计划的 投资</p> <p>9</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）、</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）、</p>

	<p>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>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>
<p>十四、 利益冲突及关联交易</p> <p>10</p>	<p>(三) 资产管理计划的关联交易</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。但管理人不得损害投资者利益。</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</p>	<p>(三) 资产管理计划的关联交易</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>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，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，具体以监管机构的要求为准。</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，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。全部委托人均为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>(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</p> <p>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</p>
--	--	--

		<p>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。</p> <p>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>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</p>
--	--	---

		<p>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。</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、关联交易的内部控制</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部控制制度，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、稽核审计等内部控制机制并执行，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部控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</p>
--	--	---

		<p>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> <p>（四）管理人应定期书面要求托管人提供关联方信息，托管人通过书面形式向管理人提供其控股股东、实际控制人及其他关联方的名单，托管人应当保证该名单的真实性、准确性和完整性，若该名单发生变更时，托管人应通知管理人。</p>
11	<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、法规和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</p>

	<p>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>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的中国证监会派出机构及基金业协会。</p>	<p>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，托管人有权报告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、 资产管理计划的财产估值和会计核算</p>	<p>(一) 资产管理计划财产的估值</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</p>	<p>(一) 资产管理计划财产的估值</p> <p>(2) 债券估值方法</p> <p>1) 对于已上市或已挂牌转让的不含固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值净价，具体估值机构由管理人和托管人协商约定。</p> <p>2) 对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价，具体估值机构由管理人和托管人</p>
<p>12</p>		

	<p>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，确定公允价值。</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>(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</p>	<p>协商约定。</p> <p>对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值净价或推荐估值净价，同时应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)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。</p> <p>3) 对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券、可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。</p> <p>4) 对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，一般应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。</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</p>
--	---	--

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

		<p>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。如所投资资产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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>
--	--	--

		<p>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补偿。</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 0.0001 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>
<p>二十 一、资 产管理 计划的 费用与 税收</p> <p>13</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>(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>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>管理人收取管理费的银行账户为：</p> <p>户名：第一创业证券股份有限公司</p> <p>账号：4000023319200099986</p> <p>开户银行：工行深圳分行福田支行</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>(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>管理人收取管理费的银行账户为：</p> <p>户名：第一创业证券股份有限公司</p> <p>账号：4000023319200099986</p> <p>开户银行：工行深圳分行福田支行</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>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>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累计净值；</p> <p>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> <p>P_0^*为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；</p> <p>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）；</p> <p>R为年化收益率。</p> <p>管理人业绩报酬计提如下：</p> <table border="1" data-bbox="1171 1149 1295 1785"> <tr> <td>年化收益率</td> <td>计提比例</td> <td>业绩报酬计算公式</td> </tr> <tr> <td>$R < \mathbf{【K】}$</td> <td>0%</td> <td>0</td> </tr> </table>	年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式	$R < \mathbf{【K】}$	0%	0	<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累计净值；</p> <p>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> <p>P_0^*为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；</p> <p>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）；</p> <p>R为年化收益率。</p> <p>管理人业绩报酬计提如下：</p> <table border="1" data-bbox="1171 320 1295 956"> <tr> <td>年化收益率</td> <td>计提比例</td> <td>业绩报酬计算公式</td> </tr> <tr> <td>$R < \mathbf{【K】}$</td> <td>0%</td> <td>0</td> </tr> </table>	年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式	$R < \mathbf{【K】}$	0%	0
年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式												
$R < \mathbf{【K】}$	0%	0												
年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式												
$R < \mathbf{【K】}$	0%	0												

	$Y = M * (R - \text{【K】}) * \text{【30】} \% * D$	$Y = M * (R - \text{【K】}) * \text{【30】} \% * D$
	$\text{【K】} \leq R$	$\text{【K】} \leq R$
	其中： Y=业绩报酬； K=业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准由管理人公告，业绩报酬计提基准将在产品的推广公告中列示，若产品存续期间，管理人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。部分退出某笔参与份额的，M值仅指实际退出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。	其中： Y=业绩报酬； K=业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准由管理人公告，业绩报酬计提基准将在产品的推广公告中列示，若产品存续期间，管理人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。部分退出某笔参与份额的，M值仅指实际退出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。

		<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)的收取比例上有限新的规定的, 按照新规定执行。</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>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)的收取比例上有限新的规定的, 按照新规定执行。</p>
<p>14</p> <p>二十 三、信 息披露 与报告</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, 并报基金业协会备案, 同时抄报管理人住所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</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个月或存续期间不足3个月的, 可以不编制当期的季度报告。</p>

	<p>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>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。</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>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>4、对账单</p> <p>管理人至少每个季度以电子或其他形式向委托人提供对账单，如有调整，管理人将以公告形式通知委托人。对账单内容应包括委</p>
--	--	--

	<p>告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>4、对账单</p> <p>管理人至少每季度以邮寄或电子邮件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>委托人可以选择对账单寄送方式，本计划默认的寄送方式为邮寄。委托人选择电子邮件方式寄送对账单的，委托人应向管理人提供电子邮件等资料，以便管理人能正常发送电子对账单。管理人根据委托人提供的上述信息资料提供电子对账单的，电子对账单从管理人系统处发出即视为送达，因委托人未正常提供以上信息、电子邮件运营系统平台故障等原因导致其未能获得电子对账单的，管理人不承担任何责任。委托人选择邮寄方式寄送对账单的，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>(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</p>	<p>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。委托人应向管理人提供电子邮箱地址等资料，因委托人未正常提供以上信息、邮件运营系统平台故障及内部操作等非管理人原因导致委托人未能获得电子对账单的，管理人不承担任何责任。</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，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约定的通过管理人网站或其他途径和方式</p>
--	--	---

	<p>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>.....</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>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>
<p>15 二十四、 风险揭示</p>	<p>（一）特殊风险揭示</p> <p>4、本计划未在基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉及风险</p> <p>管理人在本计划成立后5个工作日内向基金业协会办理备案手续。本计划面临因未能在基金业协会履行备案手续或基金业协会不予备案导致本计划财产不能进行投资运作的风险。</p>	<p>（一）特殊风险揭示</p> <p>4、本计划因备案不成功需要整改规范所涉风险</p> <p>管理人在本计划成立后5个工作日内向基金业协会办理备案手续，可能存在基金业协会对本资产管理计划不予备案及要求整改规范的风险。如本计划备案不成功，管理人将在本计划财产变现后返还给委托人。</p>

	<p>.....</p> <p>6、其他特殊风险</p> <p>.....</p> <p>(6) 无法预警止损的风险</p> <p>本计划未设置预警线和平仓线,由于投资品种价格可能持续向不利方向变动、投资品种市场剧烈波动等原因,委托财产存在全部亏损的风险。</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± 0.0005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$\pm X \times 0.0005$元。</p> <p>14、其他风险</p>	<p>.....</p> <p>6、其他特殊风险</p> <p>.....</p> <p>(6) 投资资产管理产品的风险</p> <p>本计划部分资产将配置金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品(包括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>1) 资产管理产品管理人风险</p> <p>资产管理产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险是指因管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内控等因素导致公司经营不善,极端情况下甚至破产倒闭,可能对其管理人的产品业绩造成不利影响。另外,对于约定了止损条款的资产管理产品,可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。</p> <p>2) 赎回资产管理产品面临的流动性风险</p> <p>因本计划委托人赎回或管理人进行资产配置调整需要,管理人</p>
--	--	--

	<p>(1) 关联交易的风险：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>赎回资产管理产品时，可能触发资产管理产品大额赎回或巨额赎回条款，导致赎回资金延迟到账的风险。</p> <p>3) 净值波动风险（如有）</p> <p>本计划配置的金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品出现如下情形之一时，将可能导致本计划出现净值波动风险：</p> <p>① 估值日后的第一个交易日仍无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；</p> <p>② 投资上述品种后无法及时确认，上述投资品种在投资确认前估值价格波动；</p> <p>③ 估值日后的第一个交易日取得的上述投资品种的最新估值价格仍没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响）。</p> <p>(7) 无法预警止损的风险</p> <p>本计划未设置预警线和平仓线，由于投资品种价格可能持续向不利方向变动、投资品种市场剧烈波动等原因，委托财产存在全部亏损的风险。</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> <p>14、其他风险</p> <p>(1) 关联交易的风险</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</p> <p>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</p>
--	--	---

		<p>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。</p> <p>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>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</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部控制制度，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、稽核审计等内部控制机制并执行，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部控制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>
<p>二十 五、资 产管理 合同的 变更、 终止与 财产清 算</p> <p>16</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)、(3) 项约定进行清偿前，不</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>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可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。并报告证券投资基金业协会，具体以监管机构的要求为准。</p>
--	--	--

<p>17</p>	<p>附件一：投资指令（样本）</p>	<p>第一创业-单一资产管理业务 编号：201*年第*号 指令日期：201*年**月**日</p>	<p>第一创业-集合资产管理业务 编号：202*年第*号 指令日期：202*年**月**日</p>
-----------	---------------------	---	---

附件：第一创业基础设施2号集合资产管理计划说明书变更对照表

序号	位置	原说明书	变更后说明书
1	<p>基本信息</p>	<p>投资范围及比例 1、投资范围 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： (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（不含次级债、混合资本债）、资产支持证券（ABS）（不含劣</p>	<p>投资范围及比例 1、投资范围 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： (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（不含劣</p>

	<p>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）权益）、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）权益）、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）（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>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）权益），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）权益）、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、基金公司及其子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>(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>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。</p> <p>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>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</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 个交易日內卖出。</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額或比例。</p> <p>对于本计划按照穿透原则合并计算投资限制比例的, 管理人应提供相关资料以供托管人监督履职。</p>
--	--	--

	<p>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>(2) 本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%，计算总资产时，应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>(3) 本计划参与公募 REITs、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本计划的总资产，且所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>(4) 本计划投向的资产支持证券及资产支持票据仅限于在证券交易所与银行间市场挂牌转让或交易流通的资产支持证券及资</p>	<p>因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等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，管理人应当向管理人住所所在地中国证监会派出机构报告。</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%；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</p>
--	---	---

	<p>产支持票据的优先级份额，不投向以信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权为底层基础资产的资产支持证券及资产支持票据。</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</p>	<p>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>（2）本计划总资产不得超过本计划资产净值的200%，计算总资产时，应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>（3）本计划参与公募REITs、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过本计划的总资产，且所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>（4）本计划投向的资产支持证券及资产支持票据仅限于在证券交易所与银行间市场挂牌转让或交易流通的资产支持证券及资产支持票据的优先级份额，不投向以信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权为底层基础资产的资产支持证券及资产支持票据；</p>
--	---	---

	<p>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为和领域；</p> <p>(18) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p> <p>投资策略</p> <p>本计划以有效控制投资风险和保持产品流动性为前提，综合考虑宏观经济运行情况、市场流动性、资产风险收益率水平，在严谨深入的研究分析基础上，主要配置货币市场基金、债券型证券投资基金等固定收益类资产，提升产品的投资业绩。</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%。</p> <p>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) 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) 将本计划财产用于投资于房地产价格上涨过快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) 直接投资于商业银行信贷资产;</p> <p>(19) 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) 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和行业领域;</p> <p>(21) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p> <p>投资策略</p>
--	--	---

			<p>本计划以有效控制投资风险和保持产品流动性为前提，综合考量宏观经济运行情况、市场流动性、资产风险收益率水平，在严谨深入的研究分析基础上，主要配置固定收益类资产及固定收益类资产管理产品，提升产品的投资业绩。</p>
2	<p>集合计划成立的条件、时间</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>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>
3	<p>集合计划的参与和退出</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>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>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</p>

		<p>网站上发布公告即视为履行了告知义务。</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>
<p>4</p> <p>管理人 自有资 金参与 情况</p>	<p>持有 90 日（含）及以上的，退出费率为 0.00%。</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>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</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，并向住所中国证监局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，享有与其他委托入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</p>	<p>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，并取得其同意。管理人和托管人应书面达成一致，同时管理人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，并向住所中国证监局派出机构报告，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</p>
--	--	--

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

5	费用、报酬	<p>1、管理费： 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： $H = E \times 【0.50】\% \div 360$ H 为每日应计提的管理费； E 为本计划前一日净值。 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。 管理人收取管理费的银行账户为： 户名：第一创业证券股份有限公司 账号：4000023319200099986 开户银行：工行深圳分行福田支行 (四) 管理人的业绩报酬 1、管理人收取业绩报酬的原则： (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>1、管理费： (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： $H = E \times 【0.50】\% \div 360$ H 为每日应计提的固定管理费； E 为本计划前一日净值。 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。 管理人收取管理费的银行账户为： 户名：第一创业证券股份有限公司 账号：4000023319200099986 开户银行：工行深圳分行福田支行 (2) 管理人的业绩报酬（浮动管理费） 1) 管理人收取业绩报酬的原则： 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>(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</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> <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</p>
--	---	--

	<p>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净值；</p> <p>P_0为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；</p> <p>P_0^*为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；</p> <p>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）；</p> <p>R为年化收益率。</p> <p>管理人业绩报酬计提如下：</p> <table border="1" data-bbox="1007 1245 1321 1688"> <thead> <tr> <th>年化收益率</th> <th>计提比例</th> <th>业绩报酬计算公式</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R < \mathbf{【K】}$</td> <td>0%</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td>$\mathbf{【K】} \leq R$</td> <td>$\mathbf{【30】}$ %</td> <td>$Y = M * (R - \mathbf{【K】}) * \mathbf{【K】}$</td> </tr> </tbody> </table>	年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式	$R < \mathbf{【K】}$	0%	0	$\mathbf{【K】} \leq R$	$\mathbf{【30】}$ %	$Y = M * (R - \mathbf{【K】}) * \mathbf{【K】}$	<p>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净值；</p> <p>P_0为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；</p> <p>P_0^*为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值；</p> <p>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）；</p> <p>R为年化收益率。</p> <p>管理人业绩报酬计提如下：</p> <table border="1" data-bbox="1007 412 1321 855"> <thead> <tr> <th>年化收益率</th> <th>计提比例</th> <th>业绩报酬计算公式</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R < \mathbf{【K】}$</td> <td>0%</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td>$\mathbf{【K】} \leq R$</td> <td>$\mathbf{【30】}$ %</td> <td>$Y = M * (R - \mathbf{【K】}) * \mathbf{【K】}$</td> </tr> </tbody> </table>	年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式	$R < \mathbf{【K】}$	0%	0	$\mathbf{【K】} \leq R$	$\mathbf{【30】}$ %	$Y = M * (R - \mathbf{【K】}) * \mathbf{【K】}$
年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式																		
$R < \mathbf{【K】}$	0%	0																		
$\mathbf{【K】} \leq R$	$\mathbf{【30】}$ %	$Y = M * (R - \mathbf{【K】}) * \mathbf{【K】}$																		
年化收益率	计提比例	业绩报酬计算公式																		
$R < \mathbf{【K】}$	0%	0																		
$\mathbf{【K】} \leq R$	$\mathbf{【30】}$ %	$Y = M * (R - \mathbf{【K】}) * \mathbf{【K】}$																		

	<p>其中：</p> <p>Y=业绩报酬；</p> <p>K=业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准由管理人公告，业绩报酬计提基准将在产品的推广公告中列示，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的新的业绩报酬计提基准的，管理人退出；</p> <p>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。</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</p>	<p>【30】 %*D</p>
<p>其中：</p> <p>Y=业绩报酬；</p> <p>K=业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准由管理人公告，业绩报酬计提基准将在产品的推广公告中列示，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的新的业绩报酬计提基准的，管理人退出；</p> <p>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。</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</p>	<p>【30】 %*D</p>	<p>【30】 %*D</p>

	<p>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）的收取比例上有限新的规定的，按照新规定执行。</p>	<p>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）的收取比例上有限新的规定的，按照新规定执行。</p>
<p>信息披露</p> <p>6</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，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>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>(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、完整的资产管理年度报告，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>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>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、完整的资产管理年度报告，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>4、对账单</p> <p>管理人至少每个季度以电子或其他形式向委托人提供对账单，如有调整，管理人将以公告形式通知委托人。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</p>
--	---	--

	<p>4、对账单</p> <p>管理人至少每个季度以邮寄或电子邮件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>委托人可以选择对账单寄送方式,本计划默认的寄送方式为邮寄。委托人选择电子邮件方式寄送对账单的,委托人应向管理人提供电子邮件等资料,以便管理人能正常发送电子对账单。管理人根据委托人提供的上述信息资料提供电子对账单的,电子对账单从管理人系统处发出即视为送达,因委托人未正常提供以上信息、电子邮件运营商系统平台故障等原因导致其未能获得电子对账单的,管理人不承担任何责任。委托人选择邮寄方式寄送对账单的,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>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</p>	<p>等情况。委托人应向管理人提供电子邮箱地址等资料,因委托人未正常提供以上信息、邮件运营商系统平台故障及内部操作等非管理人原因导致委托人未能获得电子对账单的,管理人不承担任何责任。</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所在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>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： 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>7 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>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>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>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>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>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。并报告证券投资基金业协会，具体以监管机构的要</p> <p>求为准。</p>
--	--	---

附件：第一创业基础设施 2 号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	<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>4、本计划在基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险</p> <p>管理人在本计划成立后 5 个工作日内向基金业协会办理备案手续。本计划面临因未能在基金业协会履行备案手续或基金业协会不予备案导致本计划财产不能进行投资运作的风险。</p> <p>.....</p> <p>6、其他特殊风险</p> <p>.....</p> <p>(6) 无法预警止损的风险</p> <p>本计划未设置预警线和平仓线，由于投资品种价格可能持续向不利方向变动、投资品种市场剧烈波动等原因，委托财产存在全部亏损的风险。</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>(一) 特殊风险揭示</p> <p>4、本计划因备案不成功需要整改规范所涉风险</p> <p>管理人在本计划成立后 5 个工作日内向基金业协会办理备案手续，可能存在基金业协会对本资产管理计划不予备案及要求整改规范的风险。如本计划备案不成功，管理人将在本计划财产变现后返还给委托人。</p> <p>.....</p> <p>6、其他特殊风险</p> <p>.....</p> <p>(6) 投资资产管理产品的风险</p> <p>本计划部分资产将配置金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品（包括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>1) 资产管理产品管理人风险</p> <p>资产管理产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险</p>

<p>是指因管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内控等因素导致公司经营不善，极端情况下甚至破产倒闭，可能对其管理人的产品业绩造成不利影响。另外，对于约定了止损条款的资产管理产品，可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。</p>	<p>是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±X*0.0005 元。</p>
<p>2) 赎回资产管理产品面临的流动性风险</p> <p>因本计划委托人赎回或管理人进行资产配置调整需要，管理人赎回资产管理产品时，可能触发资产管理产品大额赎回或巨额赎回条款，导致赎回资金延迟到账的风险。</p>	<p>14、其他风险</p> <p>(1) 关联交易的风险：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>3) 净值波动风险（如有）</p> <p>本计划配置的金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品出现如下情形之一时，将可能导致本计划出现净值波动风险：</p>	<p>④ 估值日后的第一个交易日仍无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；</p> <p>⑤ 投资上述品种后无法及时确认，上述投资品种在投资确认前估值价格波动；</p> <p>⑥ 估值日后的第一个交易日取得的上述投资品种的最新估值价格仍没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对</p>

	<p>估值价格的影响)。</p> <p>(7) 无法预警止损的风险</p> <p>本计划未设置预警线和平仓线，由于投资品种价格可能持续向不利方向变动、投资品种市场剧烈波动等原因，委托财产存在全部亏损的风险。</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> <p>14、其他风险</p> <p>(1) 关联交易的风险</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>6) 关联方范围</p> <p>本计划所称关联方包括：</p> <p>⑥ 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>⑦ 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>⑧ 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>⑨ 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>⑩ 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>7) 关联交易范围</p> <p>本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p> <p>⑩ 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>11 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>12 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>13 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>14 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>15 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>16 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>17 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>18 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>8) 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>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</p>

		<p>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>9) 关联交易的内部控制</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>10) 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，</p>
--	--	---

			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。
--	--	--	---