

# 关于安信研究精选集合资产管理计划

## 合同变更的公告

根据《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》（合称资管规定），及《安信研究精选集合资产管理计划合同》“第24部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算”的规定，经与托管人上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行协商一致，管理人安信证券资产管理有限公司将对《安信研究精选集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）中相关内容进行变更（以下简称“本次变更”），现就本次变更相关事项公告如下：

### 一、合同主要变更内容：

本次变更详细内容请详见附件《安信研究精选集合资产管理计划合同修订对照表》，已在资管合同中补充“清算与交收”章节，原《安信研究精选集合资产管理计划托管协议》废止。

### 二、合同变更安排

#### 1、征询意见期

本次变更征询意见期为：2023年6月9日至2023年6月15日15:00。

#### 2、回复意见

请委托人在征询意见期内，书面签署附件二《关于安信研究精选集合资产管理计划合同变更的回复意见函》（以下简称“《回复函》”）反馈意见，未签署《回复函》的委托人或逾期回复的委托人视为同意合同的变更，同意合同变更的委托人，无需签署新合同。

### 3、退出安排

(1) 不同意变更或回复意见不明确的委托人，可于征询意见期的最后一个工作日即2023年6月15日退出本集合计划；

(2) 不同意变更或回复意见不明确但未于征询意见期退出的，管理人将在征询意见期最后一个工作日即2023年6月15日日终做强制退出处理。

### 三、合同变更生效日

合同变更生效日为征询意见期结束次一工作日，即2023年6月16日。

### 四、其他事项

1、安信研究精选集合资产管理计划将于2023年6月15日至2023年6月21日期间的交易日正常办理参与业务，于2023年6月15日正常办理退出业务，于2023年6月15日办理参与业务的委托人，管理人默认委托人已知悉本次变更的相关内容，并同意本次合同变更，管理人将依据变更生效后新合同进行资产管理业务。

2、本公告发布同时向委托人就合同变更事宜征求意见，不再另行征询，敬请各位委托人根据公告要求予以函复。

如有疑问，可咨询电话：95517。

安信证券资产管理有限公司



附件一：安信研究精选集合资产管理计划合同修订对照表

变更前	变更后
产品名称	安信资管策略优选5号集合资产管理计划
安信研究精选集合资产管理计划	安信资管策略优选5号集合资产管理计划
第1部分 前言	
一、订立本资产管理合同（以下简称“本合同”）的依据包括但不限于《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》等法律法规、中国证券监督管理委员会和中国证券业协会、中国证券投资基金业协会的有关规定。	一、订立本资产管理合同（以下简称“本合同”）的依据包括但不限于《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》等法律法规、中国证券监督管理委员会和中国证券业协会、中国证券投资基金业协会的有关规定。
二、订立本合同的目的是为了规范安信研究精选集合资产管理计划的运作，明确《安信研究精选集合资产管理计划资产管理合同》当事人的权利与义务，确保委托财产的安全，保护当事人各方的合法权益。	二、订立本合同的目的是为了规范安信资管策略优选5号集合资产管理计划的运作，明确《安信资管策略优选5号集合资产管理计划资产管理合同》当事人的权利与义务，确保委托财产的安全，保护当事人各方的合法权益。
四、管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。	四、管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会进行备案。
	六、本资产管理计划采用托管行结算模式。
第2部分 释义	
集合资产管理计划、本资产管理计划、资产管理计划、资管计划、计划：指安信研究精选集合资产管理计划；	集合资产管理计划、本资产管理计划、资产管理计划、资管计划、计划：指安信资管策略优选5号集合资产管理计划；
资产管理计划说明书、说明书：指《安信研究精选集合资产管理计划说明书》及其的任何有效修订和补充；	资产管理计划说明书、说明书：指《安信资管策略优选5号集合资产管理计划说明书》及其的任何有效修订和补充；
集合资产管理合同、资产管理合同、本合同、纸质合同、电子合同：指《安信研究精选集合资产管理计划资产管理合同》及其的任何修订和补充；	集合资产管理合同、资产管理合同、本合同、纸质合同、电子合同：指《安信资管策略优选5号集合资产管理计划资产管理合同》及其的任何修订和补充；
删除： 托管协议：指《安信研究精选集合资产管理计划托管协议》及其的任何修订和补充；	
风险揭示书：指《安信研究精选集合资产管理计划风险揭示书》及其对该风险揭示书的任何有效修订和补充；	风险揭示书：指《安信资管策略优选5号集合资产管理计划风险揭示书》及其对该风险揭示书的任何有效修订和补充；
《基金法》：指2013年6月1日起正式实施的《中华人民共和国证券投资基金法》；	《基金法》：指2013年6月1日起正式实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及其修订；
《管理办法》：指2018年10月22日经中国证券监督管理委员会公布并自公布之日起实施的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第151号）；	《管理办法》：指2023年1月12日经中国证券监督管理委员会公布并自2023年3月1日起实施的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第203号）及其修订；
《运作管理规定》：指2018年10月22日经中国证券监督管理委员会公布并自公布之日起实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2018]31号）；	《运作管理规定》：指2023年1月12日经中国证券监督管理委员会公布并自2023年3月1日起实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2023]2号）及其修订；
管理人：指安信证券股份有限公司，简称“安信证券”；	管理人：指安信证券资产管理有限公司，简称“安信资管”；
销售机构：安信证券股份有限公司及其他符合条件的销售机构（以管理人公告为准）；	销售机构：安信证券股份有限公司、安信证券资产管理有限公司及其他符合条件的销售机构（以管理人公告为准）；
注册登记机构：指办理本资产管理计划注册登记业务的机构，本资产管理计划的注册登记机构为安信证券股份有限公司或接受安信证券股份有限公司委托代为办理登记结算业务的机构；	注册登记机构：指办理本资产管理计划注册登记业务的机构，本资产管理计划的注册登记机构为安信证券资产管理有限公司或接受管理人委托代为办理登记结算业务的机构；
投资者/合格投资者：指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于本资产管理计划不低于100万元（不含认购费/参与费）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织： （1）具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于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； （2）最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位； （3）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构； （4）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； （5）基本养老金、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）； （6）中国证监会视为合格投资者的其他情形。	合格投资者：指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于本资产管理计划不低于40万元（不含认购费/参与费）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织： （1）具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于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； （2）最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位； （3）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、商业理财产子子公司、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； （4）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； （5）基本养老金、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）； 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

<p>管理人指定网站：指 www.essence.com.cn，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。</p>	<p>管理人指定网站：指 www.axzqzg.com，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。</p>
	<p>增加： 信义义务：托管人信义义务是指托管人按恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规和监管规定，在本资产管理合同约定范围内尽职尽责履行安全保管托管资产等托管人职责。</p>
<p><b>第3部分 承诺与声明</b></p>	
	<p>增加： （四）已知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》（银发〔2017〕235号）、《中国人民银行关于进一步做好受益所有人身份识别有关问题的通知》（银发〔2018〕164号）等反洗钱相关法律法规、监管规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料，并在产品受益所有人发生变化时，及时告知管理人并按管理人要求完成更新；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。承诺其不属于中国有权机关、联合国、欧盟或美国等制裁名单内的企业或个人，不位于被中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁的国家和地区。 （五）已同意并确认管理人基于实现合同服务之目的或其他资金管理、经营管理的需求，或根据相关法律法规及监管要求，有权自主决定对投资者个人信息（范围包括但不限于个人的姓名、身份证号、认购信息、账户信息等合理范围内的信息）/机构信息（范围包括但不限于机构名称、证件号、认购信息、账户信息等合理范围内的信息）以及合同的相关信息进行合理范围内的处理及使用，范围包括但不限于： 1、根据法律、法规、证券交易所规则、税务机关、政府机关、法院或仲裁机构要求披露； 2、为投资运作管理的必要需求，根据托管人等机构的要求向其披露； 3、为本合同投资运作管理的必要需求，向律师事务所(如有)、会计师事务所(如有)、资产评估(如有)和/或税务等其他专业机构披露； 4、其他为实现合同目的而合理使用、处理个人信息或机构信息的情形。</p>
<p><b>第4部分 当事人及权利义务</b></p>	
<p>一、投资者、管理人和托管人的基本情况 （二）管理人 机构名称：安信证券股份有限公司 法定代表人：王连志 住所：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元 通讯地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦A座27层 邮政编码：518026 联系人：应涵 联系电话：0755-82558218</p>	<p>一、投资者、管理人和托管人的基本情况 （二）管理人 机构名称：安信证券资产管理有限公司 法定代表人：李力 住所：深圳市福田区福田街道福安社区福华一路119号安信金融大厦21楼、22楼 通讯地址：深圳市福田区福田街道福安社区福华一路119号安信金融大厦21楼、22楼 邮政编码：518046 联系人：马志茹 联系电话：0755-81681509</p>
<p>一、投资者、管理人和托管人的基本情况 （三）托管人 机构名称：上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行 负责人：李荣军 住址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路333号 通讯地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路333号16楼 邮政编码：518000 联系人：胡月琴 联系电话：0755-88691606</p>	<p>一、投资者、管理人和托管人的基本情况 （三）托管人 机构名称：上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行 法定代表人/负责人：李荣军 住址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路333号 通讯地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路333号16楼 邮政编码：518000 联系人：朱津滢 联系电话：0755-81117910</p>
<p>三、投资者、管理人和托管人的权利和义务 （三）管理人的权利 4、根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；</p>	<p>三、投资者、管理人和托管人的权利和义务 （三）管理人的权利 4、根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构；</p>
<p>三、投资者、管理人和托管人的权利和义务 （四）管理人的义务 21、根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，向证券投资基金业协会备案，并抄报中</p>	<p>三、投资者、管理人和托管人的权利和义务 （四）管理人的义务 21、根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告；</p>

<p>中国证监会相关派出机构；</p> <p>……</p> <p>26、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；</p> <p>删除：</p> <p>27、按照我国有关反洗钱法律、行政法规，履行客户身份识别反洗钱义务，在法律允许范围内，配合托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作，并提供必要客户信息、资料等。根据反洗钱政策及法规，要求投资者积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序；对具备合理理由怀疑涉嫌洗钱、恐怖融资的投资者，按照中国人民银行反洗钱监管规定采取必要管控措施；</p>	<p>……</p> <p>26、面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构并通知托管人和投资者</p>
<p>三、投资者、管理人和托管人的权利和义务</p> <p>（六）托管人的义务</p> <p>9、编制托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；</p> <p>……</p> <p>14、监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会，对管理人提供的交易材料等信息是否与合同约定的监督事项相符进行表面一致性审查；</p> <p>15、投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；</p> <p>删除：</p> <p>16、对具备合理理由怀疑涉嫌洗钱、恐怖融资的投资者，按照中国人民银行反洗钱监管规定采取必要管控措施；</p>	<p>三、投资者、管理人和托管人的权利和义务</p> <p>（六）托管人的义务</p> <p>9、编制托管年度报告；</p> <p>……</p> <p>14、监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构；</p> <p>15、投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、根据本合同约定监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；</p>
<p><b>第5部分 资产管理计划的基本情况</b></p>	
<p>一、资产管理计划的名称</p> <p>安信研究精选集合资产管理计划</p> <p>二、资产管理计划的类别</p> <p>权益类集合资产管理计划</p>	<p>一、资产管理计划的名称</p> <p>安信资管策略优选5号集合资产管理计划</p> <p>二、资产管理计划的类别</p> <p>混合类集合资产管理计划</p>
<p>四、资产管理计划的投资</p> <p>（一）投资目标</p> <p>本资产管理计划以为投资者争取最大收益为目标，遵循定量分析和定性分析相结合的投资理念，在有效控制风险的基础上，力争委托资产的稳健增值。</p> <p>（二）主要投资方向</p> <p>1、符合《指导意见》规定的标准化股权类资产、标准化债权类资产、标准化商品及金融衍生品；公开募集证券投资基金（公募基金）；</p> <p>2、本集合计划可以开展债券回购、融资融券、转融通证券出借业务。</p> <p>（三）投资比例</p> <p>1、本资产管理计划投资权益类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不低于80%；</p> <p>2、本资产管理计划投资商品及金融衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过20%或衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的20%；</p> <p>3、本资产管理计划参与债券正回购融入资金余额不得超过资产管理计划资产净值的100%，逆回购融出资金余额不得超过资产管理计划资产净值的100%；</p> <p>4、本资产管理计划资产总值不得超过资产管理计划资产净值的200%。</p>	<p>四、资产管理计划的投资</p> <p>（四）投资目标</p> <p>本资产管理计划在有效控制风险的基础上，力争实现计划资产的保值增值。</p> <p>（五）主要投资方向</p> <p>1、符合《指导意见》规定的标准化债权类资产、标准化股权类资产、标准化期货和衍生品类资产，公开募集证券投资基金（公募基金）；</p> <p>2、本资产管理计划可以开展债券回购、融资融券业务。</p> <p>（六）投资比例</p> <p>1、本资产管理计划投资固定收益类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过80%；</p> <p>2、本资产管理计划投资权益类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例为40%-80%（不含）；</p> <p>3、本资产管理计划投资期货和衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过80%或期货和衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的20%；</p> <p>4、本资产管理计划投资公募基金的市值占资产管理计划资产总值的比例低于80%；</p> <p>5、本资产管理计划参与债券正回购融入资金余额不得超过资产管理计划上一日资产净值的100%，逆回购融出资金余额不得超过资产管理计划上一日资产净值的100%；</p> <p>6、本资产管理计划资产总值不得超过资产管理计划资产净值的200%。</p>
<p>七、资产管理计划的最低初始募集规模</p> <p>本资产管理计划最低初始募集规模不低于人民币1000万元（不含认购费），初始募集期及存续期规模不设上限。单个客户首次参与金额不低于100万元（不含认购费），追加参与的最低金额为1万元，参与客户数不超过200户。</p>	<p>七、资产管理计划的最低初始募集规模</p> <p>本资产管理计划最低初始募集规模不低于人民币1000万元（不含认购费），初始募集期及存续期规模不设上限。单个客户首次参与金额不低于40万元（不含认购费），追加参与的最低金额为1000元，参与客户数不超过200户。</p>
<p>九、资产管理计划的服务机构</p> <p>本资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务均由安信证券股份有限公司（业务登记编码：PT03000000212）和提供，不存在聘请外部服务机构的情形。</p>	<p>九、资产管理计划的服务机构</p> <p>本资产管理计划的服务机构为安信证券资产管理有限公司。</p> <p>安信证券股份有限公司为安信证券资产管理有限公司提供投资运营管理、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务和支持，管理人应当承担的责任不因安信证券股份有限公司提供上述运营服务和支持而免除，对本资产管理合同各方当事人权利义务也不产生影响。管理人与安信证券</p>

	股份有限公司之间产生的纠纷，由管理人负责解决。
第6部分 资产管理计划的募集	
<p>一、资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限</p> <p>(一) 募集对象</p> <p>……</p> <p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于本资产管理计划不低于100万元（不含认购费/参与费）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：</p> <p>1、具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元；</p> <p>2、最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；</p> <p>3、依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>4、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>5、基本养老金、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>6、中国证监会视为合格投资者的其他情形。法律法规、监管机构、自律组织对于合格投资者认定将来另有规定的，从其规定。</p> <p>参与本资产管理计划的投资者如属于上述第4类“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”的，该资产管理产品的投资者中不得存在其他私募资产管理产品。该资产管理产品的管理人</p>	<p>一、资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限</p> <p>(一) 募集对象</p> <p>……</p> <p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于本资产管理计划不低于40万元（不含认购费/参与费）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：</p> <p>1、具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元；</p> <p>2、最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；</p> <p>3、依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业保理公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>4、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>5、基本养老金、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>6、中国证监会视为合格投资者的其他情形。法律法规、监管机构、自律组织对于合格投资者认定将来另有规定的，从其规定。</p> <p>参与本资产管理计划的投资者如属于上述第4类“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”的，该资产管理产品的投资者中不得存在其他私募资产管理产品。该资产管理产品的管理人</p>
<p>(二) 募集方式</p> <p>本资产管理计划通过安信证券股份有限公司及其他符合条件的销售机构（以管理人公告为准）进行募集。</p>	<p>(二) 募集方式</p> <p>本资产管理计划通过安信证券股份有限公司、安信证券资产管理有限公司及其他符合条件的销售机构（以管理人公告为准）进行募集。</p>
<p>三、资产管理计划的最低认购金额和支付方式</p> <p>(一) 最低认购金额</p> <p>投资者在初始募集期间的认购金额不得低于100万元人民币（不含认购费），追加认购的最低金额为1万元。</p> <p>(二) 支付方式</p> <p>本资产管理计划的认购资金应以现金形式交付。</p>	<p>三、资产管理计划的最低认购金额和支付方式</p> <p>(三) 最低认购金额</p> <p>投资者在初始募集期间的认购金额不得低于40万元人民币（不含认购费），追加认购的最低金额为1000元。</p> <p>(四) 支付方式</p> <p>本资产管理计划的认购资金应以货币资金形式交付。</p>
第7部分 资产管理计划的成立与备案	
<p>一、资产管理计划成立的有关事项</p> <p>(一) 资产管理计划成立的条件</p> <p>资产管理计划的初始募集规模不低于人民币1000万元（不含认购费），投资者人数不少于2人，且不超过200人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。</p> <p>(二) 资产管理计划的成立</p> <p>资产管理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对资产管理计划进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告资产管理计划成立。</p> <p>(三) 资产管理计划募集失败及其处理方式</p> <p>资产管理计划募集期结束，在资产管理计划初始募集规模低于人民币1000万元（不含认购费）或者投资者人数低于2人的情况下，资产管理计划设立失败，管理人以其固有财产承担资产管理计划募集行为而产生的债务和费用，并将投资者已缴纳的款项加计同期人民币活期存款利息（以注册登记机构的记录为准）在募集期结束之日起30日内退还资产管理计划投资者，退还完毕后各方互不承担其他责任。</p> <p>二、资产管理计划的备案</p> <p>管理人应当在资产管理计划成立之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。</p> <p>资产管理计划设立完成前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。</p> <p>三、资产管理计划在成立后备案完成前的投资活动</p> <p>资产管理计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</p>	<p>一、资产管理计划成立的有关事项</p> <p>(一) 资产管理计划成立的条件</p> <p>资产管理计划的初始募集规模不低于人民币1000万元（不含认购费），投资者人数不少于2人，且不超过200人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。</p> <p>(二) 资产管理计划的成立</p> <p>资产管理计划的募集金额缴足之日起10个工作日内，管理人公告资产管理计划成立。</p> <p>(三) 资产管理计划募集失败及其处理方式</p> <p>资产管理计划募集期结束，在资产管理计划初始募集规模低于人民币1000万元（不含认购费）或者投资者人数低于2人的情况下，资产管理计划设立失败，管理人以其固有财产承担资产管理计划募集行为而产生的债务和费用，并将投资者已缴纳的款项加计银行同期活期存款利息（以注册登记机构的记录为准）在募集期结束之日起30日内退还资产管理计划投资者，退还完毕后各方互不承担其他责任。</p> <p>二、资产管理计划的备案</p> <p>管理人应当在资产管理计划成立之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案。</p> <p>资产管理计划设立完成前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。</p> <p>三、资产管理计划在成立后备案完成前的投资活动</p> <p>资产管理计划在成立后备案完成前，可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。</p>

<p>第 8 部分 资产管理计划的参与、退出与转让</p> <p>一、参与和退出的场所</p> <p>本资产管理计划参与和退出的场所为安信证券股份有限公司及其他符合条件的销售机构（以管理人公告为准）。</p> <p>二、参与和退出的开放日和时间</p> <p>本资产管理计划自成立之日起封闭运作 3 个月，满三个月后每个自然月自 15 日起连续开放 5 个工作日，投资者可于开放期的正常交易时间内申请参与，但是开放期内仅第一个开放日（T 日）的正常交易时间可办理退出业务，如遇法定节假日则顺延。除开放期、本资产管理合同另有约定外，本资产管理计划不允许投资者参与或退出。</p>	<p>一、参与和退出的场所</p> <p>本资产管理计划参与和退出通过安信证券股份有限公司、安信证券资产管理有限公司及其他符合条件的销售机构（以管理人公告为准）进行。投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的参与和退出。</p> <p>二、参与和退出的开放日和时间</p> <p>本资产管理计划的开放期为每周二、周三、周四（如遇非工作日，不开放、不顺延）。在开放期内，投资者可以申请参与或退出本资产管理计划。管理人有权根据实际情况调整开放期的日期、天数及参与、退出安排并提前公告，本集合计划每周开放最多不超过 3 个工作日（含）。</p> <p>除法律法规、监管规定、开放期、本资产管理合同另有约定外，本资产管理计划不允许投资者参与或退出。</p>								
<p>五、参与和退出的金额限制</p> <p>三、参与和退出的金额限制</p> <p>投资者在本资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应满足本资产管理计划最低参与金额限制（不含参与费），已持有资产管理计划份额的投资者在本资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。在开放期内追加参与的，每次参与的金額应不低于 1 万元人民币。</p> <p>投资者部分退出资产管理计划的，单笔退出最低份额为 1 万份，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。投资者没有一次性申请全部退出的，管理人将在退出申请确认日对该投资者所持有的全部份额做退出确认。</p> <p>本资产管理计划在退出开放期无退出次数限制。</p>	<p>五、参与和退出的金额限制</p> <p>投资者在本资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应满足本资产管理计划最低参与金额限制（不含参与费），已持有资产管理计划份额的投资者在本资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。在开放期内追加参与的，每次参与的金額应不低于 1000 元人民币。</p> <p>投资者部分退出资产管理计划的，单笔退出最低份额为 1 万份，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。投资者没有一次性申请全部退出的，管理人将在退出申请确认日对该投资者所持有的全部份额做退出确认。</p> <p>本资产管理计划的退出费率按照份额持有人持有该份额的时间分段设定：持有期限小于 180 天时退出费率为 1%；持有期限大于等于 180 天但小于 365 天时退出费率为 0.50%；持有期限大于等于 365 天时退出费率为 0。当触发前述份额强制退出情形时，持有期限小于 365 天的份额会按照前述退出费率收取相应的赎回费。投资者面临强制退出时产生赎回费用的风险。</p> <p>因份额强制退出可能会导致投资者发生实际的投资损益，投资者承诺已知悉并自愿承担强制退出的风险。</p>								
<p>六、参与和退出的费用</p> <p>（一）资产管理计划参与的费用</p> <p>本资产管理计划参与费率为 1.0%。</p> <p>（二）资产管理计划退出的费用</p> <p>本资产管理计划不收取退出费用。</p>	<p>六、参与和退出的费用</p> <p>（一）资产管理计划参与的费用</p> <p>本资产管理计划参与费率为 1%。</p> <p>（二）资产管理计划退出的费用</p> <p>本资产管理计划的退出费率按份额持有人持有该份额的时间分段设定如下：</p> <table border="1" data-bbox="826 1317 1445 1496"> <thead> <tr> <th>持有期限（T）</th> <th>退出费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>T &lt; 180 日</td> <td>1%</td> </tr> <tr> <td>180 日 ≤ T &lt; 365 日</td> <td>0.50%</td> </tr> <tr> <td>T ≥ 365 日</td> <td>0%</td> </tr> </tbody> </table> <p>其中，退出费用由赎回集合计划份额的份额持有人承担，在份额持有人赎回集合计划份额时收取，不列入集合计划财产。</p>	持有期限（T）	退出费率	T < 180 日	1%	180 日 ≤ T < 365 日	0.50%	T ≥ 365 日	0%
持有期限（T）	退出费率								
T < 180 日	1%								
180 日 ≤ T < 365 日	0.50%								
T ≥ 365 日	0%								
<p>七、参与份额和退出金额的计算方式</p> <p>（二）退出金额的计算方式</p> <p>退出金额 = 退出份额 × 资产管理计划单位净值 - 业绩报酬（如有）；</p>	<p>七、参与份额和退出金额的计算方式</p> <p>（二）退出金额的计算方式</p> <p>退出金额 = 退出份额 × T 日集合计划单位净值</p> <p>退出费用 = 退出金额 × 退出费率</p> <p>退出净额 = 退出金额 - 退出费用 - 业绩报酬（如有）</p>								
<p>九、巨额退出或连续巨额退出</p> <p>（一）巨额退出</p> <p>2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>部分顺延退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者的退出申请可能对资产管理计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于上一日资产管理计划总份额的 10%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，应当按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；……</p>	<p>九、巨额退出或连续巨额退出</p> <p>（一）巨额退出</p> <p>2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>部分顺延退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者的退出申请可能对资产管理计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于上一日资产管理计划总份额的 10%的前提下，可以对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，应当按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；……</p>								
<p>十四、管理人自有资金参与及退出</p> <p>（一）自有资金参与</p> <p>1、自有资金参与的条件</p> <p>管理人可在募集期和存续期以自有资金参与本资产管理计划，应符合本合同、《意见》、《管理办法》、《运作管理规定》和中国证监会及证</p>	<p>十四、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与及退出</p> <p>（一）自有资金参与</p> <p>1、自有资金参与的条件</p> <p>证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金在募集期和存续期参与其自身或其子公司管理的集合资产管理计划，应符合本合同、《意见》、</p>								

<p>券投资基金业协会的相关规定。</p> <p>2、自有资金参与的方式</p> <p>管理人自有资金持有的份额与其他投资者持有的份额享有同等权益、承担同等风险。管理人自有资金不对投资者的本金和收益进行赔付。参与时，管理人应当提前5个工作日告知投资者和托管人。</p> <p>3、自有资金参与的金额和比例</p> <p>(1) 本资产管理计划募集期间，管理人自有资金参与资产管理计划的份额不超过资产管理计划总份额的15%，管理人及其附属机构以自有资金参与资产管理计划的份额合计不得超过资产管理计划总份额的50%。</p> <p>(2) 本资产管理计划份额增加时，管理人有权增加自有资金参与份额，但参与比例不能超过上述第(1)条的限制。</p> <p>(3) 本资产管理计划因规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与本资产管理计划比例被动超过法律、法规及本合同规定的上限时，管理人应及时退出自有资金持有的超限部分资产管理计划份额。</p> <p>(二) 自有资金退出</p> <p>资产管理计划存续期间，管理人自有资金参与资产管理计划的持有期限不少于6个月时，可以退出资产管理计划。退出时，管理人应当提前5个工作日告知投资者和托管人。</p> <p>(三) 为应对资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及后续退出集合资产管理计划可不受上述第(一)、(二)条的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会报告。</p> <p>(四) 若法律法规关于管理人自有资金投资比例和退出条件等规定发生变化，管理人可参照最新法律法规要求，按规定履行合同变更程序后，变更相关条款。</p> <p>(五) 风险揭示：管理人自有资金退出后，本资产管理计划可能遭遇流动性风险，从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注计划规模变动情况，控制流动性风险。</p>	<p>《管理办法》、《运作管理规定》和中国证监会及证券投资基金业协会的相关规定。</p> <p>2、自有资金参与的方式</p> <p>证券期货经营机构及其子公司自有资金持有的份额与其他投资者持有的份额享有同等权益、承担同等风险。证券期货经营机构及其子公司自有资金不对投资者的本金和收益进行赔付。全体投资者及托管人同意证券期货经营机构及其子公司可在募集期以自有资金参与本资产管理计划。存续期参与时，管理人应当提前5个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意，具体按本条第(三)款“自有资金参与或退出安排”约定的方式办理。</p> <p>3、自有资金参与的金额和比例</p> <p>(1) 如证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本资产管理计划的，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与其自身或其子公司管理的单个集合资产管理计划的份额合计不得超过该资产管理计划总份额的50%，其中管理人及其母公司安信证券股份有限公司以自有资金参与本集合计划的份额不超过总份额的15%。中国证监会另有规定的，从其规定。</p> <p>(2) 本资产管理计划份额增加时，证券期货经营机构及其子公司有权增加自有资金参与份额，但参与比例不能超过上述第(1)条的限制。</p> <p>(二) 自有资金退出</p> <p>资产管理计划存续期间，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与资产管理计划的持有期限不少于6个月时，可以退出资产管理计划。退出时，管理人应当提前5个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意，具体按本条第(三)款“自有资金参与或退出安排”约定的方式办理。</p> <p>(三) 自有资金参与或退出安排</p> <p>证券期货经营机构及其子公司自有资金在存续期内参与或退出的，管理人应在取得托管人书面同意后，提前五个工作日在管理人网站以公告或其他方式(具体由管理人决定)告知投资者，并采取如下权利保障措施及安排：</p> <p>1、投资者不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出的，管理人保障其退出权利，具体退出安排以管理人公告为准；</p> <p>2、投资者不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出且未在公告确定的退出日内退出的，则管理人有权在公告中确定的退出日将相关份额强制退出计划(退出价格为退出当日资产管理计划相应份额的单位净值)，由此发生的相关税费或或有损失由投资者自行承担；</p> <p>3、投资者未回复意见且未在公告确定的退出日内退出的，视同投资者同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出，管理人不再另行通知；</p> <p>4、投资者回复意见不明确的，则视为该投资者不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出，按照上述1-2处理。</p> <p>(四) 为应对资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及后续退出集合资产管理计划可不受上述第(一)、(二)、(三)条的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>(五) 本资产管理计划因规模变动等客观因素导致证券期货经营机构及其子公司自有资金参与本资产管理计划比例被动超过法律、法规及本合同规定的上限时，证券期货经营机构及其子公司应及时退出自有资金持有的超限部分资产管理计划份额，不受上述第(一)、(二)、(三)条的限制，但事后应当及时告知投资者和托管人。</p> <p>(六) 若法律法规关于证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例、期限、参与和退出条件等有规定的，从其规定；如前述规定发生变化的，管理人可参照最新法律法规要求，按规定履行合同变更程序后，变更相关条款。</p> <p>风险揭示：证券期货经营机构及其子公司自有资金退出后，本资产管理计划可能遭遇流动性风险，从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注计划规模变动情况，控制流动性风险。</p>
<p>第10部分 资产管理计划份额的登记</p>	
<p>二、本资产管理计划的注册登记机构为安信证券资产管理有限公司。</p>	<p>二、本资产管理计划的注册登记机构为安信证券股份有限公司。</p>
<p>第11部分 资产管理计划的投资</p>	
<p>一、投资目标</p> <p>以为投资者争取最大收益为目标，遵循定量分析和定性分析相结合的投资理念，在有效控制风险的基础上，力争投资资产的稳健增值。</p> <p>二、投资范围及比例</p> <p>(一) 投资范围</p> <p>1、沪深交易所依法发行上市的股票(包括科创板、新股申购)、港股</p>	<p>一、投资目标</p> <p>本资产管理计划在有效控制风险的基础上，力争实现计划资产的保值增值。</p> <p>二、投资范围及比例</p> <p>(三) 投资范围</p> <p>6、沪深交易所依法发行上市的股票(包括科创板、新股申购)、港股</p>



<p>通标的股票以及中国证监会认可的其他标准化股权类资产；</p> <p>2、银行存款（包括但不限于银行活期存款、银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、国债、地方政府债、中央银行票据、金融债（含次级债、政策性银行债）、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具（PPN）、可交换债、可转换债、永续债、银行间或沪深交易所挂牌交易的资产支持证券（ABS）优先级（穿透至底层资产不得为产品）、资产支持票据（ABN）等交易所及银行间交易的投资品种、债券正回购、债券逆回购；</p> <p>3、股指期货、国债期货、商品期货、交易所期权等标准化商品及金融衍生品；</p> <p>4、公开募集证券投资基金（公募基金）；</p> <p>5、本集合计划可以开展融资融券、转融通证券出借业务。</p> <p><b>（二）投资比例</b></p> <p>1、本资产管理计划投资权益类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不低于80%；</p> <p>2、本资产管理计划投资商品及金融衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过20%或衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的20%；</p> <p>3、本资产管理计划参与债券正回购融入资金余额不得超过资产管理计划资产净值的100%，逆回购融出资金余额不得超过资产管理计划资产净值的100%；</p> <p>4、本资产管理计划的资产总值不得超过资产管理计划资产净值的200%。</p> <p>本资产管理计划的实际投向不得违反合同约定，如有改变，除高风险类型的产品超出比例范围投资较低风险资产外，应当先行取得投资者书面同意，并履行合同变更、登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。法律法规或中国证监会允许资产管理计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更等适当程序后，可以将其纳入本资产管理计划的投资范围。</p> <p>本资产管理计划投资范围包含债券回购、融资融券、转融通，投资者应注意上述投资标的风险，具体风险请参见本合同“第23部分 风险揭示”。</p> <p><b>三、投资比例超限的处理方式及流程</b></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之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的15个交易日内调整至符合要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p> <p><b>四、风险收益特征</b></p> <p>本资产管理计划属于权益类集合资产管理计划，理论上其预期风险和预期收益低于商品及金融衍生品类集合资产管理计划，高于固定收益类集合资产管理计划。</p> <p><b>五、业绩比较基准</b></p> <p>本资产管理计划不设置业绩比较基准。</p> <p><b>六、投资策略</b></p> <p><b>（一）资产管理计划投资决策依据</b></p> <p>资产管理计划以国家有关法律法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护资产管理计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：</p> <p>1、《管理办法》、《运作管理规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件；</p> <p>2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势；</p> <p>3、投资对象收益和风险的配比关系。本资产管理计划在衡量投资对象的收益与风险之间的配比关系时，以资产管理计划的资产安全和流动性为重要衡量标准，在此基础上争取较高的收益。</p> <p><b>（二）资产管理计划的投资决策程序</b></p> <p>严格的投资管理制度和程序可以保证投资理念的正确执行，避免发生重大风险。本资产管理计划采取公司资产管理业务投资决策委员会和资产管理部投资决策小组领导下的投资经理负责制。管理人另设立风险控制小组，对集合资产管理计划进行绩效分析和风险评估。</p> <p><b>1、研究分析</b></p> <p>宏观策略分析师和行业分析师在借鉴外部研究成果的基础上，开展宏观经济及政策分析、债券市场分析、行业及上市公司分析；定量分析师负责量化策略的研究、模型的构建、检验、维护和运行结果的报告。通过以上研究工作，为投资决策委员会、投资决策小组以及投资经理提供独立、统一的投资决策支持。</p>	<p>通标的股票以及中国证监会认可的其他标准化股权类资产；</p> <p>7、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、同业存单、债券正逆回购、银行存款以及符合《指导意见》规定的其他标准化债权类资产；</p> <p>8、股指期货、国债期货、商品期货等标准化期货和衍生品类资产；</p> <p>9、股票型公募基金证券投资基金（含ETF场外申赎及场内买卖、LOF）、债券型公募基金证券投资基金、货币型公募基金证券投资基金。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p><b>（四）投资比例</b></p> <p>5、本资产管理计划投资固定收益类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过80%；</p> <p>6、本资产管理计划投资权益类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例为40%-80%（不含）；</p> <p>7、本资产管理计划投资期货和衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过80%或期货和衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的20%；</p> <p>8、本资产管理计划投资公募基金的市值占资产管理计划资产总值的比例低于80%；</p> <p>9、本资产管理计划参与债券正回购融入资金余额不得超过资产管理计划上一日资产净值的100%，逆回购融出资金余额不得超过资产管理计划上一日资产净值的100%；</p> <p>10、本资产管理计划的资产总值不得超过资产管理计划资产净值的200%。</p> <p>本资产管理计划的实际投向不得违反合同约定，如有改变，除高风险类型的产品超出比例范围投资较低风险资产外，应当先行取得投资者书面同意，并履行合同变更、登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。法律法规或中国证监会允许资产管理计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更等适当程序后，可以将其纳入本资产管理计划的投资范围。</p> <p>本资产管理计划投资范围包含债券回购等，投资者应注意上述投资标的风险，具体风险请参见本合同“风险揭示”章节。</p> <p><b>三、投资比例超限的处理方式及流程</b></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之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的20个交易日内调整至符合要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p><b>四、风险收益特征</b></p> <p>本资产管理计划属于混合类集合资产管理计划，理论上其预期风险和预期收益低于期货和衍生品类集合资产管理计划、权益类集合资产管理计划，高于固定收益类集合资产管理计划。</p> <p><b>五、业绩比较基准</b></p> <p>本资产管理计划的业绩比较基准为沪深300指数收益率*60%+人民币一年期定期存款利率（税前）*40%。</p> <p>沪深300指数是中证指数有限公司依据国际指数编制标准并结合中国市场的实际情况编制的沪深两市统一指数，科学地反映了我国证券市场的整体业绩表现，选择科学客观，行业代表性好，流动性高，抗操纵性强，是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。基于本集合资产管理计划的投资范围和投资比例限制，选用上述业绩比较基准能够忠实反映本集合资产管理计划的风险收益特征。</p> <p><b>十二、投资策略</b></p> <p><b>（四）资产管理计划投资决策依据</b></p> <p>资产管理计划以国家有关法律法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护资产管理计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：</p> <p>4、《管理办法》、《运作管理规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律性文件；</p> <p>5、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势；</p> <p>6、投资对象收益和风险的配比关系。本资产管理计划在衡量投资对象的收益与风险之间的配比关系时，以资产管理计划的资产安全和流动性为重要衡量标准，在此基础上争取较高的收益。</p> <p><b>（五）资产管理计划的投资决策程序</b></p> <p>严格的投资管理制度和程序可以保证投资理念的正确执行，避免发生重大风险。本资产管理计划采取投资决策委员会领导下的投资经理负责制。管理人另设立风控部，对集合资产管理计划进行绩效分析和风险评估。</p> <p><b>8、研究分析</b></p>
--	---

## 2、投资决策

资产管理部投资决策小组定期和不定期召开会议，对宏观经济形势、利率趋势、证券市场走势等进行综合分析，确定资产管理计划下一阶段的资产配置；审核投资经理提交的投资计划以及其他涉及资产管理计划投资管理的重大问题。

## 3、组合构建

投资经理在投资决策小组给定的资产配置比例范围内，结合资产管理计划有关投资品种、投资限制等规定完成投资组合的构建。

## 4、交易执行

管理人设置独立的中央交易室，交易员负责在合法合规的前提下，执行投资经理的投资指令，并实施一线风险监控。

## 5、风险与绩效评估

风险控制小组对资产管理计划的投资行为进行合规性监控，对投资过程中存在的风险隐患进行风险提示，并就投资组合提出风险管理建议；定期和不定期对资产管理计划进行风险和绩效评估，对投资组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略提供相关报告。

## 6、组合监控与调整

投资经理将跟踪经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，结合资产管理计划参与和退出的现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，使之不断得到优化。

## 7、股指期货、国债期货保证金的流动性应急处理

### (1) 应急触发条件

管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。

### (2) 保证金补充机制

如出现保证金不足的情况时，管理人将首先运用资产管理计划资产从市场上拆借资金；如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现资产管理计划资产，变现时应重点考虑变现资产的流动性，以最大限度的降低损失。

### (3) 损失责任承担等

因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的资产管理计划资产损失，管理人应进行赔偿，但管理人不承担委托资产的变现损失及未及时追加保证金的损失（包括穿仓损失）。对于其他相关方的原因给委托人造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表资产管理计划委托人的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关衍生品交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表资产管理计划与各方签订的相关协议为准。

### (三) 投资管理的方法和标准

#### 1、股票精选投资策略

本资产管理计划结合使用定量分析和定性分析两方面的方法精选符合条件的股票。以新兴产业、处于周期性景气上升阶段的拐点行业以及持续增长的传统产业为重点，并精选其中行业代表性高、潜在成长性良好、估值具有吸引力的个股进行投资。对于新兴产业，在对产业结构演变趋势进行深入研究和分析的基础上，准确把握新兴产业的发展方向，重点投资体现行业发展方向、拥有核心技术、创新意识领先并已经形成明确盈利模式的公司；对于拐点产业，依据对行业景气变化趋势的研究，结合行业库存、出货量、产品价格、行业调研景气等辅助判断指标，提前发现景气度进入上升周期的行业，重点投资拐点行业中景气敏感度高的公司；对于传统产业，主要关注产业增长的持续性、企业的竞争优势、发展战略以及潜在发展空间，重点投资具有清晰商业模式、增长具有可持续性和不可复制性的企业。

综合运用领先和动量两个择时策略，通过对市场氛围和个股价格走势的短期、中期分析，追求更好地把握组合买卖时机和调整节奏。

#### 2、衍生品投资策略

##### (1) 股指期货策略

在建立股票现货组合同时，灵活使用股指期货进行对冲，主动防御市场风险。

##### (2) 国债期货策略

国债期货可用于对债券组合久期进行管理，调整组合风险暴露。国债期货也可用来进行套保、期现、跨期、跨市、跨品种套利交易。

##### (3) 场内期权策略

在符合投资目标及策略的前提下，管理人选择期限、收益特性、挂钩标的符合本资产管理计划的期权，严格控制衍生品投资风险，确保衍生品的投资以对冲风险为目的。

#### 3、固定收益类资产投资策略

管理人将在充分考虑债券流动性、收益率和抗风险能力的基础上，选

宏观策略分析师和行业分析师在借鉴外部研究成果的基础上，开展宏观经济及政策分析、债券市场分析、行业及上市公司分析；量化分析师负责量化策略的研究、模型的构建、检验、维护和运行结果的报告。通过以上研究工作，为投资决策委员会及投资经理提供独立、统一的投资决策支持。

## 9、投资决策

投资决策委员会不定期召开会议，对宏观经济形势、利率趋势、证券市场走势等进行综合分析，确定资产管理计划下一阶段的资产配置；审议投资经理提交的投资计划以及其他涉及资产管理计划投资管理的重大问题。

## 10、组合构建

投资经理在投资决策委员会给定的资产配置比例范围内，结合资产管理计划有关投资品种、投资限制等规定完成投资组合的构建。

## 11、交易执行

管理人设置独立的中央交易室，交易员负责在合法合规的前提下，执行投资经理的投资指令，并实施一线风险监控。

## 12、风险与绩效评估

风控部对资产管理计划的投资行为进行合规性监控，对投资过程中存在的风险隐患进行风险提示，并就投资组合提出风险管理建议；定期和不定期对资产管理计划进行风险和绩效评估，对投资组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略提供相关报告。

## 13、组合监控与调整

投资经理将跟踪经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，结合资产管理计划参与和退出的现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，使之不断得到优化。

## 14、股指期货保证金的流动性应急处理

### (1) 应急触发条件

管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。

### (2) 保证金补充机制

如出现保证金不足的情况时，管理人将首先运用资产管理计划资产从市场上拆借资金；如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现资产管理计划资产，变现时应重点考虑变现资产的流动性，以最大限度的降低损失。

### (3) 损失责任承担等

因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的资产管理计划资产损失，管理人应进行赔偿，但管理人不承担委托资产的变现损失及未及时追加保证金的损失（包括穿仓损失）。对于其他相关方的原因给委托人造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表资产管理计划委托人的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关衍生品交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表资产管理计划与各方签订的相关协议为准。

### (六) 投资理念

将价值选股和择时有机结合，以自上而下的选时策略尽可能地规避系统性风险，以自下而上的选股策略力争规避个股风险，并配合仓位管理、建仓策略和适当的止损措施，以获取稳健的超额收益为目标。

### (七) 投资管理的方法和标准

本资产管理计划根据对宏观经济形势、货币政策、行业及企业盈利和信用状况、债券市场供求关系等的动态分析，在限定投资范围内，跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化，定期对各类资产配置比例进行动态调整。

#### 1、大类资产配置策略

本资产管理计划投资管理计划中，投资策略由自上而下的资产配置计划和自下而上的单个证券选择计划组成。本资产管理计划根据对宏观经济趋势、国家宏观政策趋势、行业及企业盈利和信用状况、市场预期收益等的动态分析，在限定投资范围内，跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化，定期对股票、债券和货币市场工具等大类资产配置比例进行调整。

#### 2、股票投资策略

以价值投资为锚，辅以选时、大类资产配置等灵活策略，追求高于基准指数的收益。投资风格上以价值投机为主。通过自下而上的方式寻找具备长期价值的公司；通过自上而下的方式判断系统性风险的概率，通过仓位调整整体组合风险。

##### (1) 行业配置

在经济转型过程中，市场机会大概率呈现的是结构性的而不是全局性的。自上而下的行业配置策略能够筛选出真正具备长期投资价值的行业与公司，是把握结构性机会的重要手段。

择合适的债券进入备选证券，从备选证券出发，以流动性为约束条件，以优化的方法选择合适的投资品种，构建风险收益特性及久期符合投资目标的固定收益组合。

#### 4、现金类资产投资策略

在确定本资产管理计划总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、信用水平来确定现金类资产的配置，并定期对现金类资产组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。

#### 七、投资限制

为维护投资者的合法权益，本资产管理计划投资的投资限制为：

(一)不得从事证券法规规定和资产管理计划合同约定禁止从事的投资事项。

(二)本资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过本资产管理计划资产净值的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%。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。

(三)本资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的200%。

(四)本资产管理计划不得投资于管理人管理的其他资产管理计划。

(五)参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过资产管理计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

(六)管理人管理的全部资产管理计划及公开募集证券投资基金（如有）合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的30%。

若法律法规、监管规定等有变化，管理人履行合同变更程序后，可以对上述投资限制进行调整，并在管理人网站公告告知投资者。

#### 八、禁止行为

本资产管理计划的禁止行为包括：

(一)违规将资产管理计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；

(二)将资产管理计划资产用于可能承担无限责任的投资；

(三)向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；

(四)挪用资产管理计划资产；

(五)募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；

(六)接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；

(七)使用资产管理计划资产进行不必要的交易；

(八)内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；

(九)直接投资于商业银行信贷资产；

(十)违规为地方政府及其部门提供融资；

(十一)要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；

(十二)直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止投资的行业和领域；

(十三)直接或者间接投资于违反国家产业政策、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：

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。

(十四)法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

#### 九、建仓期

本资产管理计划的建仓期为自本资产管理计划成立之日起6个月。

管理人将在建仓期内逐步将资产配置比例满足本合同约定的投资比例限制要求。建仓期内的投资活动，应当符合本合同约定的投向和本资产管理计划的风险收益特征，以资金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和本合同约定的投向和比例。

十、投资者在此同意并授权管理人在计划存续期间，为规避特定风险，投资于权益类资产的比例可以低于资产管理计划总资产80%，但不得持续6个月低于资产管理计划总资产80%。

特定风险包括应对开放期流动性风险、市场趋势性下跌风险、发生巨额或连续巨额退出、投资标的流动性风险等。

#### 十一、投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配

本资产管理计划退出开放期内，其资产组合中7个工作日可变现资产的价值不低于本资产管理计划资产净值的10%，主动投资于流动性受限资产市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的20%。

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、

行业分析主要包括行业景气度、行业生命周期、行业竞争格局三个方面。

行业景气度受到宏观经济形势、国家产业政策、行业自身等因素影响。着重分析新经济形势下政策、技术等变化对行业景气度的影响，重点关注景气度上行或者困境反转的行业。

不同生命周期的行业适用于不同的估值方式，分析各个行业所处的生命周期，重点配置处于成长期的公司。对处于幼稚期的公司积极跟踪，根据市场风险偏好程度进行选择配置；对于成熟期的行业在市场弱势期适当配置；规避处于衰退期的行业。

行业竞争格局主要分析行业发展的核心驱动力，进而判断行业的“护城河”。本资产管理计划主要配置具备较强“护城河”的行业。

#### (2) 个股选择

充分发挥投研团队的主动选股能力，深度挖掘成长型公司的中长期机会，构建优质股票投资组合。对上市公司竞争优势进行定性分析，对财务进行定量分析；通过草根调研、上市公司调研、业内沟通调研等渠道对公司进行验证；备选公司股票需与自上而下和自下而上的逻辑进行匹配，确定是否符合双重标准；最后，参考估值情况和市场风险偏好情况确定合适的买点。

#### (3) 选时策略

因子的变动影响到市场参与者的预期，进而影响市场参与者的买卖行为。通过分析因子变动对市场影响的传导路径来确定市场的波动趋势，观测市场参与者的行为和资金流变化印证判断的有效性。

#### 3、固收类资产投资策略

本资产管理计划利用安信资管宏观经济分析框架和内部信用评级系统，结合宏观经济研究和信用研究，分析影响宏观经济、资本市场和行业发展前景的关键因素，选择基本面较强、较高等级的主体，在有效控制风险并确保流动性的基础上，实现收益最大化。

#### 4、期货和衍生品投资策略

##### (1) 股指期货策略

在建立股票现货组合时，灵活使用股指期货进行对冲，主动防御市场风险。

##### (2) 国债期货策略

国债期货可用于对债券组合久期进行管理，调整组合风险暴露。国债期货也可用来进行套保、期现、跨期、陡平等套利交易。

##### (3) 其他衍生品的投资策略

根据各种衍生品工具，如期货的特性和交易情况，选择最为合适的对冲工具。

#### 十三、投资限制

为维护投资者的合法权益，本资产管理计划投资的投资限制为：

(一)不得从事证券法规规定和资产管理计划合同约定禁止从事的投资事项。

(二)本资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过本资产管理计划资产净值的25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

(三)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%。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。

(四)本资产管理计划所投资的资产支持证券和资产支持票据的优先级，须为银行间或沪深交易所挂牌交易，且基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权。

(五)本资产管理计划不得投资于管理人管理的其他资产管理计划。

(六)参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过资产管理计划的总资产，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。

(七)管理人管理的全部资产管理计划及公开募集证券投资基金（如有）合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的30%。

(八)本资产管理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，本资产管理计划的总资产不得超过净资产的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。

若法律法规、监管规定等有变化，管理人履行合同变更程序后，可以对上述投资限制进行调整，并在管理人网站公告告知投资者。

#### 十四、禁止行为

本资产管理计划的禁止行为包括：

(一)违规将资产管理计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；

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。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）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务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。

管理人通过综合考量本资产管理计划的收益及资产的流动性，根据本资产管理计划的开放期设置，动态调整高流动性资产的比例，应对投资者的退出申请。

(二)将资产管理计划资产用于可能承担无限责任的投资；  
(三)向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；

(四)挪用资产管理计划资产；  
(五)募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；  
(六)接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；  
(七)使用资产管理计划资产进行不必要的交易；  
(八)内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；

(九)直接投资于商业银行信贷资产；  
(十)违规为地方政府及其部门提供融资；  
(十一)要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；  
(十二)直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止投资的行业和领域；

(十三)直接或者间接投资于违反国家产业政策、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：

- 4、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；
- 5、投资项目违反国家环境保护政策要求；
- 6、通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。

(十四)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；

- (十五)为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；
- (十六)法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

#### 十五、建仓期

本资产管理计划的建仓期为自本资产管理计划成立之日起6个月。

管理人将在建仓期内逐步将资产配置比例满足本合同约定的投资比例限制要求。建仓期内的投资活动，应当符合本合同约定的投向和本资产管理计划的风险收益特征，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和本合同约定的投向和比例。

#### 十六、投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配

本资产管理计划退出开放期内，其资产组合中7个工作日内可变现资产的价值不低于本资产管理计划资产净值的10%。7个工作日内可变现资产包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及标准化期权合约和同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款、7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。

本资产管理计划退出开放期内，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该资产管理计划资产净值的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）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务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。

管理人通过综合考量本资产管理计划的收益及资产的流动性，根据本资产管理计划的开放期设置，动态调整高流动性资产的比例，应对投资者的退出申请。

### 第十四部分 利益冲突及关联交易

#### 一、资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形

(一)将资产管理计划资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、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或者其他关联交易事项；

(二)管理人及其附属机构以自有资金参与本资产管理计划；

(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资产管理计划；

(四)其他可能产生利益冲突的情形。

全体投资者充分知悉、理解、同意并认可管理人开展上述事项并自愿承担相关投资风险。

#### 二、利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率

##### (一)利益冲突的处理方式

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本资产管理计划财产，公平对待全体投资者，实在在公司、股东和员工个人的利益与投资者利益发生冲突时，优先保障投资者的利益，不同投资者利益之间的利益发生冲突时，公平对待不同投资者。

管理人制定了内部控制和风险合规管理制度，按照内外部管控要求识

#### 一、资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形

(一)将资产管理计划资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、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或者其他关联交易事项；

(二)证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本资产管理计划；

(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资产管理计划；

(四)其他可能产生利益冲突的情形。

#### 二、利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率

##### (一)利益冲突的处理方式

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本资产管理计划财产，公平对待全体投资者，实在在公司、股东和员工个人的利益与投资者利益发生冲突时，优先保障投资者的利益，不同投资者利益之间的利益发生冲突时，公平对待不同投资者。

管理人制定了内部控制和风险合规管理制度，按照内外部管控要求识别、报告、评估、解决利益冲突事项。管理人运用受托资产从事上述利益

别、报告、评估、解决利益冲突事项。管理人运用受托资产从事上述利益冲突交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会、证券投资基金业协会的的规定和合同约定，并遵循投资者利益优先原则，防范利益冲突。

#### (二)利益冲突的披露方式、披露内容以及披露频率

管理人运用受托管理资产从事上述法律法规、监管规定允许的的利益冲突交易的，将在交易发生后及时以公告的方式，及时、全面、客观地向托管人和投资者披露，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。

#### 三、资产管理计划的关联交易

(一)运用受托管理资产从事关联交易的，事后及时、全面、客观地向投资者和托管人进行披露。运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。管理人从事上述事项的，应遵循投资者利益优先原则，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。

(二)托管人承诺在本资产管理计划开始投资运作前向管理人提交托管人关联方名单，如本资产管理计划存续期内前述关联方名单发生变化的，托管人承诺及时书面告知管理人，托管人应对其提交的关联方名单的真实性、准确性、完整性等负责。管理人将按照托管人提交的关联方名单及其变化情况进行关联交易的控制，但管理人无义务对托管人提供的关联方名单的真实性、准确性、完整性等进行复核，亦无须承担责任。

冲突交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会、证券投资基金业协会的的规定和合同约定，并遵循投资者利益优先原则，防范利益冲突。

#### (三)利益冲突的披露方式、披露内容以及披露频率

管理人运用受托管理资产从事上述法律法规、监管规定允许的的利益冲突交易的，将在交易发生后及时以公告的方式，充分地向托管人和投资者披露，并向中国证监会相关派出机构报告。

#### 三、资产管理计划的关联交易

##### (一) 关联交易的范围

本资产管理计划可能涉及的关联交易情形包括：

- 1、投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券；
- 2、投资管理及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行设立的资产管理产品；
- 3、与管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方开展现券交易、债券借贷、回购交易、场外衍生品交易及接受或提供服务等其他关联交易，含逆回购交易对手方、质押券；
- 4、其他依据法律法规或监管机构规定应认定为关联交易的情形。

##### (二) 关联方名单披露

- 1、管理人的关联方名单披露。管理人的关联方名单及其更新，管理人将以公告或其他方式告知托管人和投资者。
- 2、托管人的关联方名单披露。托管人应当配合管理人提供并更新关联方名单，管理人将在获取托管人关联方名单与关联证券（如有）后将以公告或其他方式告知投资者。托管人应对其提交的关联方名单与关联证券（如有）的真实性、准确性、完整性等负责。管理人将按照托管人提交的关联方名单与关联证券（如有）及其变化情况进行关联交易控制，但管理人无义务对托管人提供的关联方名单与关联证券（如有）的真实性、准确性、完整性等进行复核，亦无须承担责任。

##### (三) 关联交易的分类

管理人对资产管理计划关联交易进行分层管理，区分为重大关联交易和一般关联交易，具体分类如下：

##### 1、重大关联交易

管理人运用资产管理计划资产从事以下关联交易的为重大关联交易：

- (1)与管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方开展关联交易，单笔交易金额达到或超过特定比例或数值：
  - 1)存在非专业投资者或单个投资者投资金额低于1,000万元的资产管理计划，单笔交易金额达到或超过资产管理计划资产净值的5%且达到5,000万元及以上的；
  - 2)全部投资者均为专业投资者，且单个投资者投资金额不低于1,000万元的资产管理计划：若产品规模超过20亿元，单笔交易金额达到或超过资产管理计划资产净值的10%的；
  - 3)全部投资者均为专业投资者，且单个投资者投资金额不低于1000万元的资产管理计划，若产品规模低于20亿元，单笔交易金额达到或超过资产管理计划资产净值的10%或达到6000万及以上的。
- (2)与管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方开展逆回购交易，或回购交易中的质押券为相关关联方发行的证券。

##### 2、一般关联交易

管理人运用资产管理计划资产从事包括但不限于下列交易，以及前述重大关联交易以外的其他关联交易，为一般关联交易：

- (1)与管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方开展关联交易，单笔关联交易金额未达到前述重大关联交易的特定比例或数值；
- (2)与管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方开展的正回购交易；
- (3)与托管人及其控股股东、实际控制人或其他关联方开展逆回购，或回购交易中的质押券为相关关联方发行的证券；
- (4)高管战略配售资产管理计划、员工持股计划等特定目的资产管理计划，所投资的股票为管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方承销期内承销的股票，或者该等股票的发行人为管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方的，该等特定目的资产管理计划投资该上市公司股票的。

法律法规、监管规定或自律规则对重大关联交易及一般关联交易的范围和标准另有规定的，从其规定。

##### (四) 关联交易的投资者同意机制

- 1、投资者同意并授权管理人可以运用受托管理资产从事一般关联交易，无需就一般关联交易再行分别取得投资者授权或同意；
- 2、管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先另行取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。管理人应提前在管理人网

	<p>站以公告或以其他方式充分告知投资者，并采取如下权利保障措施及安排：</p> <p>(1) 投资者不同意开展该笔重大关联交易的，管理人保障其退出权利，具体退出安排以管理人公告为准；</p> <p>(2) 投资者不同意该笔重大关联交易且未在公告确定的退出日内退出的，则管理人有权在公告中确定的退出日将相关份额强制退出计划（退出价格为退出当日资产管理计划相应份额的单位净值），由此发生的相关税费或或有损失由投资者自行承担；</p> <p>(3) 投资者未回复意见且未在公告确定的退出日内退出的，视同投资者同意该笔重大关联交易，管理人不再另行通知；</p> <p>(4) 投资者回复意见不明确的，则视为该投资者不同意该笔重大关联交易，按照上述（1）-（2）处理。</p> <p>(五) 管理人关联交易的内部管控机制</p> <p>1、管理人已建立健全的关联交易审批机制和评估机制，包括但不限于关联方的清单管理、关联交易的识别、关联交易的投资决策、信息披露等。</p> <p>2、管理人运用受托管理资产从事关联交易的，在遵循投资者利益优先原则的前提下，管理人的投资部门根据实际投资需要，按照管理人、托管人及其关联方清单谨慎开展关联交易，按照公司制度规定的定价规则进行定价，并将包括但不限于定价结果及定价依据提交审批，其中一般关联交易提交管理人投资部门的分管领导进行审批，重大关联交易提交管理人的投资决策委员会进行审批。管理人的交易部门按照公司制度的规定在完成审批后开展交易，同时公司通过系统和人工的方式，对关联交易进行核查。管理人的合规部门对关联交易的合法合规性进行事后监督和检查。</p> <p>3、关联交易完成后，管理人将及时向投资者和托管人进行披露，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>法律法规、监管规定或自律规则对关联交易管理另有规定的，如为本合同未约定或与本合同约定不一致的，管理人将在管理人网站另行公告，无需修改本合同，以最新规则为准。</p>
<p><b>第 15 部分 投资经理的指定与变更</b></p>	
<p><b>一、投资经理的指定</b></p> <p>本资产管理计划的投资经理由管理人指定；管理人确认本资产管理计划之投资经理不兼任管理人所管理的单一资产管理业务的投资经理。</p> <p>本资产管理计划的投资经理：许也可</p> <p>许也可：西南财经大学中国金融研究中心金融学硕士，2012年7月加入安信证券股份有限公司资产管理部，历任投资研究员、投资主办助理。现任安信证券资产管理部投资主办。</p> <p>本资产管理计划的投资经理已取得基金从业资格，本资产管理计划的投资经理最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>……</p> <p>三、投资经理离任的，管理人应当对其进行离任审查，并自离任之日起三十个工作日内将审查报告报送中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会。</p>	<p><b>一、投资经理的指定</b></p> <p>本资产管理计划的投资经理由管理人指定。</p> <p>本资产管理计划的投资经理：胡红伟。</p> <p>胡红伟：华东师范大学金融学硕士。2009年至今先后任职于上海昂诺投资管理有限公司、西藏同信证券股份有限公司、万联证券股份有限公司从事权益研究与投资工作。现任安信资管投资经理。</p> <p>本资产管理计划的投资经理已取得基金从业资格，本资产管理计划的投资经理最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>……</p> <p>三、投资经理离任的，管理人应当对其进行离任审查，并自离任之日起三十个工作日内将审查报告报送中国证监会相关派出机构。</p>
<p><b>第 16 部分 资产管理计划的财产</b></p>	
<p><b>一、资产管理计划财产相关账户的开立和管理</b></p> <p><b>(一) 资产管理计划托管账户、证券账户的开立</b></p> <p>托管人为本资产管理计划开立证券账户、托管账户以及其他相关账户。托管账户名称应当是“安信研究精选集合资产管理计划”，证券账户名称应当是“安信证券—浦发银行—安信研究精选集合资产管理计划”（以实际开户名为准）。管理人应配合托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。</p>	<p><b>一、资产管理计划财产相关账户的开立和管理</b></p> <p><b>(一) 资产管理计划托管账户、证券账户的开立</b></p> <p>托管人、管理人为本资产管理计划开立证券账户、托管账户以及其他相关账户。托管账户名称应当是“安信资管策略优选5号集合资产管理计划”（以实际开户名为准），证券账户名称应当是“安信资管—浦发银行—安信资管策略优选5号集合资产管理计划”（以实际开户名为准）。管理人应配合托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。托管账户的所有预留印章印鉴由托管人保管和使用。该账户不得透支、提现，保管期间委托人、管理人、托管人三方均不得采取任何使该账户无效的行为。</p>
<p><b>第 17 部分 投资指令的发送、确认与执行</b></p>	
<p><b>一、交易清算授权</b></p> <p>管理人应向托管人提供预留印鉴和有权人（“授权人”）签字样本，事先书面通知（以下称“授权通知”）托管人有权发送投资指令的人员名单（“被授权人”）。授权通知中应包括被授权人的名单、权限、预留印鉴和签字样本，并注明相应的交易权限，规定管理人向托管人发送指令时托管人确认有权发送人员身份的方法。授权通知由授权人签字并盖章。托管人在收到授权通知当日向管理人确认。授权通知须载明授权生效日期。授权通知自通知载明的生效日期开始生效。托管人收到通知的日期晚于通知载明生效日期的，则通知自托管人收到该通知时生效。管理人和托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。</p>	<p><b>一、交易清算授权</b></p> <p>管理人应向托管人提供预留印鉴和有权人（“授权人”）签字样本，事先书面通知（以下称“授权通知”）托管人有权发送投资指令的人员名单（“被授权人”）。授权通知书为管理人向托管在同一托管人项下的所有资产管理计划出具的统一授权，内容应包括被授权人的名单、权限、预留印鉴和签字样本，并注明相应的交易权限，规定管理人向托管人发送指令时托管人确认有权发送人员身份的方法。授权通知由授权人签字或盖章并加盖公章。托管人在收到授权通知当日向管理人确认。授权通知须载明授权生效日期。授权通知自通知载明的生效日期开始生效。托管人收到通知的日期晚于通知载明生效日期的，则通知自托管人收到该通知时生效。管理人和托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向相关人员以外的任何人泄露。</p>
<p><b>三、投资指令的发送、确认及执行的时间与程序</b></p> <p>指令由“授权通知”确定的被授权人代表管理人用传真方式或其他托管人和管理人认可的方式向托管人发送。管理人有义务在发送指令后与托管人以录音电话的方式进行确认。传真以获得收件人（托管人）确认该指</p>	<p><b>三、投资指令的发送、确认及执行的时间与程序</b></p> <p>指令由“授权通知”确定的被授权人代表管理人用传真方式、电子邮件方式或其他托管人和管理人认可的方式向托管人发送。管理人有义务在发送指令后与托管人以录音电话或其他托管人和管理人认可的方式进行</p>

<p>令已成功接收之时视为送达。因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，托管人不承担责任。托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。</p> <p>……</p> <p>托管人收到管理人发送的指令后，应对投资指令进行形式审查，验证指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本相符，复核无误后依据本合同约定在规定的期限内及时执行，不得延误。若存在异议或不符，托管人立即与管理人指定人员进行电话沟通和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。托管人可以要求管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。</p> <p>管理人向托管人下达指令时，应确保本资产管理计划银行账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人有权拒绝执行，并立即通知管理人，托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。</p> <p>管理人应将银行间同业拆借中心的成交通知单加盖印章后发送给托管人。在本资产管理计划财产申购/认购开放式基金时，管理人应在向托管人提交投资指令的同时将经有效签章的基金申购/认购申请书以传真或其他托管人和管理人认可的形式送达托管人。</p>	<p>确认。传真、电子邮件以获得收件人（托管人）确认该指令已成功接收之时视为送达。托管人依照“授权通知”规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。</p> <p>……</p> <p>托管人收到管理人发送的指令后，应对投资指令进行审查，验证指令的书面要素是否齐全，指令中所载支付对象、对方银行账户户名、对方银行账户账号、支付金额、支付时间是否与划款证明文件（如有）是否一致（如没有证明文件的，本项不适用），所载印鉴的文字和基本样式与授权印鉴是否相同，复核无误后依据本合同约定在规定的期限内及时执行，不得延误。若存在异议或不符，托管人立即与管理人指定人员进行电话或其他托管人和管理人认可的方式联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。托管人可以要求管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料（如有），以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。</p> <p>管理人向托管人下达指令时，应确保本资产管理计划银行账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人有权拒绝执行，并立即通知管理人。</p> <p>管理人应将银行间同业拆借中心的成交通知单加盖印章后发送给托管人，资产管理人与资产托管人另有约定的除外。在本资产管理计划财产申购/认购开放式基金时，管理人应在向托管人提交投资指令的同时将经有效签章的基金申购/认购申请书以传真或其他托管人和管理人认可的形式送达托管人。</p>
<p>六、更换投资指令被授权人的程序</p> <p>管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少一个交易日，使用传真方式或其他管理人和托管人认可的方式向托管人发出由授权人签字和盖章的被授权人变更通知，并提供新被授权人签字样本，同时电话通知托管人，托管人收到变更通知当日通过电话向管理人确认。被授权人变更通知须载明新授权生效日期。被授权人变更通知自通知载明的生效时间开始生效。托管人收到通知的日期晚于通知载明的生效日期的，通知自托管人收到该通知时生效。管理人在电话告知后五日内将被授权人变更通知的正本送交托管人。被授权人变更通知生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或新被授权人员超权限发送的指令，管理人不承担责任。</p>	<p>六、更换投资指令被授权人的程序</p> <p>管理人撤换被授权人员或改变被授权人员的权限，必须提前至少一个交易日，使用传真方式或其他管理人和托管人认可的方式向托管人发出由授权人签字或盖章的被授权人变更通知，并提供新被授权人签字样本，同时以电话或其他托管人和管理人认可的方式通知托管人，托管人收到变更通知当日通过电话或其他托管人和管理人认可的方式向管理人确认。被授权人变更通知须载明新授权生效日期。被授权人变更通知自通知载明的生效时间开始生效。托管人收到通知的日期晚于通知载明的生效日期的，通知自托管人收到该通知时生效。管理人在以电话或其他托管人和管理人认可的方式告知后五日内将被授权人变更通知的正本送交托管人。如扫描件或传真件与正本不一致，以扫描件或传真件为准，被授权人变更通知生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或新被授权人员超权限发送的指令，管理人不承担责任。</p>
<p>七、投资指令的保管</p> <p>投资指令若以传真形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件。当两者不一致时，以托管人收到的投资指令传真件或其他托管人和管理人认可的为准。</p>	<p>七、投资指令的保管</p> <p>投资指令若以传真形式、电子邮件形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件、电子邮件。当两者不一致时，以托管人收到的投资指令传真件、电子邮件或其他托管人和管理人认可的为准。</p>
<p>八、其他相关责任</p> <p>托管人正确执行管理人符合本合同规定、合法合规的投资指令，资产管理计划财产发生损失的，托管人不承担任何形式的责任。……</p>	<p>八、其他相关责任</p> <p>托管人正确执行管理人符合本合同规定、合法合规的投资指令，资产管理计划财产发生损失的，托管人不承担任何形式的责任，由责任主体承担相应职责。……</p>
<p>第 18 部分 交易及清算交收安排（原《安信研究精选集合资产管理计划托管协议》废止，故合同中新增此章节）</p>	
	<p>一、本资产管理计划采用托管行结算模式。</p> <p>二、代理本资产管理计划证券买卖的证券经营机构的选择</p> <p>管理人负责选择代理本资产管理计划证券买卖的证券经营机构。管理人应及时以书面形式通知托管人集合计划专用交易单元、佣金费率等集合计划基本信息以及变更情况。管理人应当通过专用交易单元进行交易，该交易单元只对应托管人，同时，该交易单元下不能办理自营业务，并向证券交易所、证券登记机构备案。</p> <p>三、集合计划投资证券后的清算、交割及账目核对</p> <p>1、清算与交割</p> <p>(1) 基本规定</p> <p>集合计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由计划托管人负责办理。</p> <p>集合计划投资于场内交易的投资品种前，计划管理人和计划托管人应当另行签署托管银行证券资金结算协议。</p> <p>(2) 投资于非担保交收的投资品种</p> <p>委托财产投资于非担保交收的投资品种时，资产管理人应在约定时间内提交指令：</p> <p>上海市场非担保交收收款账户信息：  户名：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（备付金）  账号：97020153500000011  开户行：上海浦东发展银行上海分行营业部  划款摘要：04000000000430982  指令备注：“成交号码”、“股东代码”、“证券代码”</p> <p>深圳市场非担保交收收款账户信息：  户名：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（备付金）  账号：990002322003856</p>

	<p>开户行：上海浦东发展银行深圳分行营业部  划款摘要：B009999715  指令备注：“委托序号”、“股票代码”、“证券代码”  (3) 银行间债券券款对付结算  资产管理计划投资于银行间债券市场若采用券款对付结算模式，管理人和托管人应当另行签署券款对付结算业务服务标准协议。  (4) 开放式基金认购、申购、赎回的交易安排  计划管理人申购（认购）开放式基金时，应将划款指令连同经有效签章的基金申购（认购）申请单发送至计划托管人。计划托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行，并对划款指令执行情况进行查询，将执行结果通知计划管理人。  计划管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时，连同收款通知发送至计划托管人。计划托管人应及时查询到账情况并反馈计划管理人。  计划管理人应及时将申购（认购）、赎回交易确认单、分红（红利转份额）确认单等相关业务单据发送至计划托管人。  2、资金和证券账目核对的时间和方式  (1) 资金账目的核对  资金账目包括集合计划的银行存款等会计资料。管理人和托管人对资金账目(每日)对账一次，按日核实，做到账账相符。  (2) 证券账目的核对  计划托管人在收到有关登记结算数据后，(每日)核对账面证券种类和余额与登记结算数据是否相符。管理人和托管人(每日)核对证券账目，做到账账相符。  四、参与和退出的资金清算  集合计划托管账户与注册登记机构清算专用账户间的参与和退出资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每日按照应收参与资金与应付退出资金的差额来确定净应收额或净应付额。当存在净应付额时，托管人按照管理人的划款指令将净应付额划往注册登记机构指定的资金清算账户。当存在净应收额时，管理人应在交收日从注册登记机构指定的资金清算账户划往托管账户。</p>
<p><b>第 19 部分 越权交易</b></p>	
<p><b>一、越权交易的处理程序</b>  <b>(一)违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为</b>  托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权及时报告中国证监会、证券投资基金业协会。  托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并有权及时报告中国证监会、证券投资基金业协会。  管理人应向投资者和托管人主动报告越权交易。在限期内，投资者和托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对投资者和托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会、证券投资基金业协会。  .....  <b>(三) 非因管理人主观因素导致本资产管理计划投资突破本合同投资范围中约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个工作日内调整完毕。法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。</b></p>	<p><b>一、越权交易的处理程序</b>  <b>(一)违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为</b>  托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权及时报告中国证监会相关派出机构。  托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并有权及时报告中国证监会相关派出机构。  管理人应向投资者和托管人主动报告越权交易。在限期内，投资者和托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对投资者和托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会相关派出机构。  .....  <b>(三) 非因管理人主观因素导致本资产管理计划投资突破本合同投资范围中约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个工作日内调整完毕。法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。</b></p>
<p><b>三、托管人对管理人投资运作的投资监督</b>  <b>(一) 托管人对管理人的投资行为行使监督权。托管人根据托管协议附件《投资监督事项表》中约定的投资范围及投资比例等对计划管理人进行监督。</b></p>	<p><b>三、托管人对管理人投资运作的投资监督</b>  <b>(一) 托管人对管理人的投资行为行使监督权。托管人根据本合同有关资产管理计划财产投资政策的约定，承诺对本资产管理计划项下投资事项进行监督。托管人以《投资事项监督表》（附件三）为限进行监督。</b></p>
<p>四、如因投资政策变更需调整上述监督职责的，管理人应提前以书面形式通知托管人。</p>	<p>四、如因投资政策变更需调整上述监督职责的，管理人应提前以书面形式通知托管人，还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。</p>
<p><b>第 20 部分 资产管理计划财产的估值和会计核算</b></p>	
<p><b>三、估值方法</b>  <b>(一) 基金产品估值方法</b>  3、货币市场基金按成本估值，每天按公布的估值日前一日万份收益计提收益。</p>	<p><b>三、估值方法</b>  <b>(一) 基金产品估值方法</b>  3、<b>摊余成本法</b>货币市场基金按成本估值，每天按公布的估值日前一日万份收益计提收益。</p>
<p><b>(三) 债券估值方法</b>  1、在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：  对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权债券，选取中证指数行情提供的相应品种当日的估值净价。  对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权债券，选取中证指数行情提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。</p>	<p><b>(三) 债券估值方法</b>  3、在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：  对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权债券，选取中证指数有限公司提供的相应品种当日的估值全价。  对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权债券，选取中证指数有限公司提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。对于含投资</p>



<p>对于在交易所上市全价交易的公募可转换债券、公募可交换债，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。”</p> <p>对于在交易所上市净价交易的公募可交换债，选取每日收盘价作为估值净价。</p> <p>对于在交易所挂牌转让的资产支持证券、非公开发行债券，采用中证指数提供的推荐估值价，中证指数未提供推荐估值价的，按成本估值。</p> <p>对于在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值按成本估值。</p> <p>2、银行间市场交易的债券，按如下估值方式处理：</p> <p>对于在银行间市场上不含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的估值净价。</p> <p>对于在银行间市场上含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。对于含投资人回售权的债券，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>对于银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。</p> <p>在任何情况下，管理人如采用本小项规定的方法对委托资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。</p> <p>法律法规、监管规定有最新规定的，按其规定进行估值。</p> <p>（四）同业存单的估值</p> <p>同业存单按估值日中债估值提供的估值净价估值，中债估值未提供价格的，按成本估值。</p>	<p>人回售权的债券，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间建议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全价或推荐估值全价，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）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>4、银行间市场交易的债券，按如下估值方式处理：</p> <p>对于在银行间市场上不含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的估值全价。</p> <p>对于在银行间市场上含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。对于含投资人回售权的债券，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间建议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全价或推荐估值全价，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）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>5、对于银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值全价的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>6、交易所违约债的估值按中证提供的特殊证券估值方法进行估值，银行间的违约债按中债提供的特殊证券估值方法进行估值。</p> <p>在任何情况下，管理人如采用本小项规定的方法对委托资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。</p> <p>法律法规、监管规定有最新规定的，按其规定进行估值。</p> <p>（四）同业存单的估值</p> <p>同业存单按估值日中债估值提供的估值全价估值，中债估值未提供价格的，按成本估值。</p>
<p>（八）金融衍生品的估值</p> <p>1、因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。</p> <p>2、股指期货、国债期货、商品期货、交易所期权以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。</p> <p>删除：</p> <p>（九）本集合计划出借的证券以估值日证券交易所挂牌的该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近一日收盘价计算，并按商定利率逐日计提应收利息。</p> <p>（十）融资买入、融券卖出的证券在融券期间以估值日证券交易所挂牌的该证券收盘价估值，该日无估值的，以最近一日收盘价计算，并按商定利率逐日计提应付利息。</p>	<p>（八）金融衍生品的估值</p> <p>1、因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。</p> <p>2、股指期货、国债期货、商品期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。</p>
<p>五、估值程序</p> <p>日常估值由管理人进行。管理人每个工作日将资产管理计划资产净值按照约定方式报托管人，托管人进行复核；托管人复核无误后以约定方式返回给管理人；报告期末估值复核与资产管理计划会计账目的核对同时进行。</p> <p>如果托管人的估值结果与管理人的估值结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，管理人有权按照其对资产管理计划净值的计算结果对外予以公布，由此产生的估值错误，托管人不承担赔偿责任，托管人有权将相关情况报资产管理计划管理人住所地中国证监会派出机构，及中国证券投资基金业协会备案。</p> <p>由于证券期货交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。</p>	<p>五、估值程序</p> <p>日常估值由管理人进行。管理人每个工作日将资产管理计划资产净值按照约定方式报托管人，托管人进行复核；托管人复核无误后以约定方式返回给管理人；报告期末估值复核与资产管理计划会计账目的核对同时进行。</p> <p>由于证券期货交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任，由证券期货交易所、注册登记机构承担相应职责。</p>
<p>八、差错处理</p> <p>（二）差错处理原则</p> <p>5、差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因管理人过错造成资产管理计划财产损失时，托管人应为资产管理计划的利益向管理人追偿，如果因托管人过错造成资产管理计划财产损失时，管理人应为资产管理计划的利益向托管人追偿。除管理人和托管人之外的第三方造成资产管理计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由管理人负责向差错方追偿，托管人应当给予必要的配合和协助；</p>	<p>八、差错处理</p> <p>（二）差错处理原则</p> <p>5、差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因托管人过错造成资产管理计划财产损失时，管理人应为资产管理计划的利益向托管人追偿。除管理人和托管人之外的第三方造成资产管理计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由管理人负责向差错方追偿，托管人应当给予必要的配合和协助；</p>
<p>第 21 部分 资产管理计划的费用与税收</p>	
<p>一、资产管理计划费用</p>	<p>一、资产管理计划费用</p>

<p>(一) 资产管理计划费用的种类</p> <p>2、管理人的管理费</p>	<p>(一) 资产管理计划费用的种类</p> <p>2、管理人的管理费和业绩报酬</p>
<p>一、资产管理计划费用</p> <p>(二) 费用费率、费率的调整、计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>3、投资证券交易费用</p> <p>本资产管理计划投资交易费用包括资产管理计划运作期间投资证券发生的交易费用、公募基金认(申)购和赎回费、期权费、印花税、证管费、经手费、过户费、佣金等投资运作、交易过程中可能发生的其他费用。</p>	<p>一、资产管理计划费用</p> <p>(二) 费用费率、费率的调整、计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>3、投资证券交易费用</p> <p>本资产管理计划投资交易费用包括资产管理计划运作期间投资证券发生的交易费用、公募基金认(申)购和赎回费、托管费和业绩报酬(如有)等、印花税、证管费、经手费、过户费、佣金等投资运作、交易过程中可能发生的其他费用。</p>
<p>三、管理人提取业绩报酬</p> <p>(一) 业绩报酬的计提原则</p> <p>若符合业绩报酬提取条件, 管理人于本资产管理计划分红日、投资者退出日和本资产管理计划终止日提取业绩报酬。如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率小于或等于10%, 管理人不提取业绩报酬; 如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率大于10%, 管理人将对超过部分的收益提取20%作为业绩报酬。</p>	<p>三、管理人提取业绩报酬</p> <p>(一) 业绩报酬的计提原则</p> <p>若符合业绩报酬提取条件, 管理人于本资产管理计划分红日、投资者退出日和本资产管理计划终止日提取业绩报酬。如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率小于【6】%, 管理人不提取业绩报酬; 如果投资者持有每笔资产管理计划份额的区间年化收益率等于或大于【6】%, 管理人将对超过部分的收益提取【20】%作为业绩报酬。</p>
<p>三、管理人提取业绩报酬</p> <p>(三) 业绩报酬的提取方法</p> <p>业绩报酬比例计算方法如下:</p> $H = P \times (R - 10\%) \times 20\% \times A$	<p>三、管理人提取业绩报酬</p> <p>(三) 业绩报酬的提取方法</p> <p>业绩报酬比例计算方法如下:</p> $H = P \times (R - 【6】\%) \times 【20】\% \times A$
<p><b>第 22 部分 资产管理计划的收益分配</b></p>	
<p>一、可供分配利润的构成</p> <p>本资产管理计划可供分配利润为截止至收益分配基准日计划未分配利润与未分配利润中已实现收益孰低数。</p> <p>本资产管理计划收益指资产管理计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额, 资产管理计划已实现收益指资产管理计划收益减去公允价值变动收益后的余额。</p> <p>本资产管理计划的收益分配方案依据现行法律法规及合同约定执行。</p>	<p>一、可供分配利润的构成</p> <p>本资产管理计划可供分配利润为截止至收益分配基准日计划未分配利润与未分配利润中已实现收益孰低数。</p> <p>本资产管理计划利润指资产管理计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额, 资产管理计划已实现收益指资产管理计划利润减去公允价值变动收益后的余额。</p> <p>本资产管理计划的收益分配方案依据现行法律法规及合同约定执行。</p>
<p>二、收益分配原则</p> <p>(二) 本资产管理计划收益分配方式为现金分红;</p>	<p>二、收益分配原则</p> <p>(二) 本资产管理计划收益分配方式为现金分红或红利再投资, 投资者未做选择默认现金分红, 投资者可以在权益登记日前修改分红方式;</p>
<p><b>第 23 部分 信息披露与报告</b></p>	
<p>二、向投资者提供的报告</p> <p>(二) 资产管理计划的资产管理季度报告</p> <p>管理人在每季度向投资者提供一次准确、完整的季度资产管理报告, 季度报告应当包括但不限于管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告(含非标资产投资情况(如有))、资产管理计划运用杠杆情况(如有)、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式、资产管理计划投资收益分配情况、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项、中国证监会及证券投资基金业协会规定的其他事项。上述报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站通告, 并按照规定及时向相关监管机构备案。资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的, 管理人可以不编制当季的季度报告。资产管理计划终止当季, 管理人可以不编制当季的季度报告。</p> <p>(三) 资产管理计划的资产管理年度报告</p> <p>管理人在每年度向投资者提供一次准确、完整的年度资产管理报告, 年度报告应当披露报告期内本资产管理计划运作情况, 包括但不限于管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告(含非标资产投资情况(如有))、资产管理计划运用杠杆情况(如有)、资产管理计划财务会计报告、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式、资产管理计划投资收益分配情况、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项、中国证监会及证券投资基金业协会规定的其他事项。上述报告应于每个年度结束之日起四个月内通过管理人网站通告, 并按照规定及时向相关监管机构备案。资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月时, 管理人可以不编制当期的年度报告。资产管理计划终止当年, 管理人可以不编制当年的年度报告。</p>	<p>二、向投资者提供的报告</p> <p>(二) 资产管理计划的资产管理季度报告</p> <p>管理人在每季度向投资者提供一次准确、完整的季度资产管理报告, 季度报告应当包括但不限于管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告、资产管理计划运用杠杆情况(如有)、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式、资产管理计划投资收益分配情况、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项、中国证监会及证券投资基金业协会规定的其他事项。上述报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站通告, 并按照规定及时向相关监管机构报送。资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的, 管理人可以不编制当期的季度报告。资产管理计划终止当季, 管理人可以不编制当季的季度报告。</p> <p>(三) 资产管理计划的资产管理年度报告</p> <p>管理人在每年度向投资者提供一次准确、完整的年度资产管理报告, 年度报告应当披露报告期内本资产管理计划运作情况, 包括但不限于管理人履职报告、托管人履职报告、资产管理计划投资表现、资产管理计划投资组合报告、资产管理计划运用杠杆情况(如有)、资产管理计划财务会计报告、资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式、资产管理计划投资收益分配情况、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项、中国证监会及证券投资基金业协会规定的其他事项。上述报告应于每个年度结束之日起四个月内通过管理人网站通告, 并按照规定及时向相关监管机构报送。资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月时, 管理人可以不编制当期的年度报告。资产管理计划终止当年, 管理人可以不编制当年的年度报告。</p>
<p>三、重大事项临时报告</p> <p>(五) 管理人以自有资金参与和退出(如有);</p> <p>.....</p> <p>(九) 资产管理计划投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券;</p>	<p>三、重大事项临时报告</p> <p>(五) 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与和退出(如有);</p> <p>.....</p> <p>(九) 资产管理计划投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券或者开展其他关联交易;</p>
<p><b>第 24 部分 风险揭示</b></p>	
<p>一、一般风险揭示</p>	<p>一、一般风险揭示</p>

<p>(九) 关联交易风险</p> <p>本资产管理计划投资者已同意并授权管理人可投资于管理人、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，管理人应按规定就关联交易进行信息披露，投资者已知悉本资产管理计划存在关联交易风险。</p>	<p>(九) 关联交易风险</p> <p>管理人可以按照合同约定进行关联交易，仍存在程序不完整、不规范等风险。管理人已建立健全关联交易管理制度，根据本计划/管理人所涉关联交易的金额、比例、类型等标准对关联交易进行一般与重大关联交易的区分，并对一般与重大关联交易的审批程序进行规范。</p> <p>一般关联交易风险：投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人可以将本资管计划的资产投资一般关联交易事项，管理人无需就具体一般关联交易再行分别取得投资者的授权，可能存在投资者不认可本计划拟开展的一般关联交易但无法退出的风险。</p> <p>重大关联交易风险：对于本计划涉及的重大关联交易事项，管理人在进行重大关联交易前，应当提前以公告的方式向投资者发送征求意见，投资者应在公告指定的日期内按照指定形式回复意见，逾期未做答复的，视为同意重大关联交易事项；投资者向管理人答复不同意重大关联交易事项的，则应当在管理人发出的公告中确定的开放日内提出退出申请，逾期未提出退出申请的，则投资者其已以行为表明其对重大关联交易最终确定的意思表示应为同意公告中载明的重大关联交易事项。可能存在投资者不认可本计划拟开展的重大关联交易，但在公告中确定的开放日未提出退出申请，从而未能及时退出的风险。</p> <p>管理人根据资产管理合同约定从事关联交易的，虽然管理人积极遵循委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因管理人运用集合计划资产从事关联交易被监管部门认为存在重大风险，且管理人无法确保选择进行关联交易的实际交易结果（就投资结束后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，进而可能影响集合计划份额持有人的利益。此外，管理人运用集合计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使，进而可能影响集合计划份额持有人的利益。此外，若将来法律、行政法规及中国证监会的规定对于集合计划的关联交易做出新的监管要求的，本计划将按照届时最新的监管要求对关联交易的认定标准及合同条款（如需）进行调整，该等调整可能会对集合计划的投资收益造成影响。</p> <p>管理人对与托管人有关的关联交易的监控受限于托管人公开披露的关联方名单及关联证券名单的真实性、准确性、全面性和及时性，如托管人未能公开披露关联方名单及关联证券名单的，管理人将无法监控与托管人有关的关联交易，无法向投资者、托管人进行披露。</p> <p>此外，关联交易的风险还包括关联交易的经营风险以及关联交易的财务风险，关联交易的经营风险是指企业在关联交易的控制过程当中，由于关联双方鉴定不准确、关联交易定价不合理，以及关联交易活动中断等原因导致的各种风险，关联交易财务风险指因为关联交易会计核算不规范给企业造成的风险。</p> <p>管理人从事关联交易的，应当符合资管计划的投资目标和投资策略，遵循资管计划份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，按照市场公平合理价格及公司关联交易内部审批机制和评估机制执行，事后管理人将及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露，并向中国证监会相关派出机构报告。</p>
<p>二、本资产管理计划特有风险</p>	<p>二、本资产管理计划特有风险</p> <p>增加：</p> <p>(四) 资产管理计划运营事项涉及风险</p> <p>本资产管理计划由安信证券股份有限公司提供投资运营管理、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务和支持，因安信证券股份有限公司经营风险、技术系统故障、操作失误等，可能使资产管理计划运营事项发生差错，从而为本集合资产管理计划的运营带来风险。</p> <p>(五) 委托募集和参与涉及风险</p> <p>管理人可委托在中国证监会取得基金销售业务资格的基金业协会会员机构代销本集合资产管理计划，代销机构可能存在违法违规地向不特定对象宣传、商业贿赂、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作等行为，导致投资者合法权益受损。</p>
<p>(四) 无法退出风险</p> <p>1、本资产管理计划自成立之日起封闭运作3个月，满三个月后每个自然月自15日起连续开放5个工作日，投资者仅可于第一个开放日（T日）的正常交易时间办理退出业务（如遇法定节假日则顺延），投资者面临无法退出的风险。</p>	<p>(六) 无法退出风险</p> <p>除法律法规、监管规定、退出开放期或本资产管理合同另有约定之外，存续期其余时间不办理退出业务，投资者面临无法退出的风险。</p>
<p>(七) 强制退出风险</p> <p>投资者部分退出资产管理计划的，单笔退出最低份额为1万份，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。投资者没有一次性申请全部退出的，管理人将在退出申请确认日对该投资者所持有的全部份额做退出确认，投资者将面临全部份额被退出的风险。</p>	<p>(七) 强制退出风险</p> <p>投资者部分退出资产管理计划的，单笔退出最低份额为1万份，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。投资者没有一次性申请全部退出的，管理人将在退出申请确认日对该投资者所持有的全部份额做退出确认，投资者将面临全部份额被退出的风险。</p> <p>本资产管理计划的退出费率按照份额持有人持有该份额的时间分段设定：持有期限小于180天时退出费率为1%；持有期限大于等于180天但小于365天时退出费率为0.50%；持有期限大于等于365天时退出费率为0。当触发前述份额强制退出情形时，持有期限小于365天的份额将按照前述退出费率收取相应的赎回费。投资者面临强制退出时产生赎回费用的</p>

	<p>风险。</p> <p>因份额强制退出可能会导致投资者发生实际的投资损益，投资者承诺已知悉并自愿承担强制退出的风险。</p>
	<p>新增：</p> <p>(八) 参与新股申购的风险</p> <p>新股申购风险是指获配新股上市后其二级市场交易价格下跌至申购价以下的风险。由于网下获配新股有一定的锁定期，锁定期内股票价格受各种市场因素、宏观因素等的影响，股票价格有可能下跌到申购价以下。投资者需注意此风险。</p>
	<p>新增：</p> <p>(十二) 通过第三方销售平台投资开放式基金的风险</p> <p>本资产管理计划可以通过第三方销售平台投资开放式基金，相关数据的取得均依赖于第三方销售平台，可能存在第三方销售平台操作风险、委托财产被挪用、开放式基金认（申）购份额难以核对等风险。</p>
<p>删除：</p> <p>(十) 参与转融通证券出借业务的风险</p> <p>本资产管理计划作为出借人，参加转融通证券出借业务，可能面临如下风险：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、证券出借期间，因借入人违约、标的证券停牌等，出借人可能将面临无法在合约到期前提前收回出借证券的风险。</li> <li>2、证券出借期间，如果发生标的证券暂停交易或者终止上市等情况，出借人可能面临合约提前了结或者延迟了结等风险。</li> <li>3、转融通出借交易为信用交易，借入人是以自身信用向出借人借入证券，并不向其提供任何抵押品。</li> <li>4、出借人出借的证券，可能存在借入人到期不能归还、相应权益补偿和借券费用不能支付等违约风险。</li> <li>5、出借人在从事转融券交易期间，如果因证券账户中拟出借证券日终余额不足导致证券交收失败的，将面临支付违约金的风险，由此造成的后果由出借人承担。</li> <li>6、如果出借的转融通标的证券具有权利瑕疵，出借人将会面临承担相应赔偿责任，或被代办证券公司暂停、终止转融通证券出借业务并计入出借人诚信档案的风险，由此造成的后果由出借人承担。</li> </ol>	
	<p>增加：</p> <p>(十五) 参与科创板股票投资的特殊风险</p> <p>本集合资产管理计划的投资范围包括科创板股票，科创板股票在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他板块不同，本集合资产管理计划还将面临以下特有风险，包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、科创板股票的流动性风险</li> <p>科创板投资门槛高，个人投资者需要满足一定条件才可参与科创板股票投资，科创板股票流动性可能弱于其他市场板块，若机构投资者对个股形成一致性预期，存在股票无法成交的风险。</p> <li>2、科创板企业退市风险</li> <p>科创板有更为严格的退市标准，且不设暂停上市、恢复上市和重新上市制度，科创板上市企业退市风险更大，可能给本集合资产管理计划带来不利影响。</p> <li>3、投资集中的风险</li> <p>因科创板上市企业均为科技创新成长型，其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似，基本难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值波动。</p> <li>4、科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。 <li>5、科创板企业可能存在首次公开发行前最近 3 个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形。 <li>6、科创板新股发行价格、规模、节奏等坚持市场化导向，询价、定价、配售等环节由机构投资者主导。科创板新股发行全部采用询价定价方式，询价对象限定在证券公司等七类专业机构投资者，而个人投资者无法直接参与发行定价。同时，因科创板企业普遍具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，市场可比公司较少，传统估值方法可能不适用，发行定价难度较大，科创板股票上市后可能存在股价波动的风险。 <li>7、初步询价结束后，科创板发行人预计发行后总市值不足其在招股说明书中明确选择的市值与财务指标上市标准的，将按规定中止发行。 <li>8、科创板股票网上发行比例、网下向网上回拨比例、申购单位、投资风险特别公告发布等与目前上交所主板股票发行规则存在差异。 <li>9、首次公开发行股票时，发行人和主承销商可以采用超额配售选择权，不受首次公开发行股票数量条件的限制，即存在超额配售选择权实施结束后，发行人增发股票的可能性。</li> </li></li></li></li></li></ol>

10、科创板制度允许上市公司设置表决权差异安排。上市公司可能根据此项安排，存在控制权相对集中，以及因每一特别表决权股份拥有的表决权数量大于每一普通股份拥有的表决权数量等情形，而使普通投资者的表决权及对公司日常经营等事务的影响力受到限制。

11、出现《上海证券交易所科创板股票上市规则》以及上市公司章程规定的情形时，特别表决权股份将按 1:1 的比例转换为普通股份。股份转换自相关情形发生时即生效，并可能与相关股份转换登记时点存在差异。

12、相对于主板上市公司，科创板上市公司的股权激励制度更为灵活，包括股权激励计划所涉及的股票比例上限和对象有所扩大、价格条款更为灵活、实施方式更为便利。实施该等股权激励制度安排可能导致公司实际上市交易的股票数量超过首次公开发行时的数量。

13、科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%，因此可能产生股价波动的风险。

14、科创板在条件成熟时将引入做市商机制。

15、科创板股票交易的单笔申报数量、最小价格变动单位、有效申报价格范围等与上交所主板市场股票交易存在差异，可能产生无效申报。

16、科创板股票交易方式包括竞价交易、盘后固定价格交易及大宗交易，不同交易方式的交易时间、申报要求、成交原则等存在差异。科创板股票大宗交易，不适用上交所主板市场股票大宗交易中固定价格申报的相关规定。

17、科创板股票上市首日即可作为融资融券标的，与上交所主板市场存在差异。

18、科创板股票交易盘中临时停牌情形和严重异常波动股票核查制度与上交所主板市场规定不同。

19、符合相关规定的红筹企业可以在科创板上市。红筹企业在境外注册，可能采用协议控制架构，在信息披露、分红派息等方面可能与境内上市公司存在差异。红筹公司注册地、境外上市地等地法律法规对当地投资者提供的保护，可能与境内法律为境内投资者提供的保护存在差异。

20、红筹企业可以发行股票或存托凭证在科创板上市。存托凭证由存托人签发，以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。红筹公司存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但不能等同于直接持有境外基础证券，在交易和持有红筹公司股票或存托凭证过程中可能存在风险。

21、科创板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件（以下简称法律法规）和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改，或者制定新的法律法规和业务规则。

#### （十六）参与创业板股票投资的特殊风险

本计划的投资范围包括创业板股票，创业板股票在发行、上市、交易、退市等方面的规则存在一定特殊性，本计划还将面临以下特有风险，包括但不限于：

##### 1、创业板企业退市风险

创业板有更为严格的退市标准，且不设暂停上市、恢复上市和重新上市制度，创业板上市企业退市风险更大，可能给本计划带来不利影响。

##### 2、投资集中的风险

因创业板上市企业均为成长型创新型，其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似，基本难以通过分散投资降低投资风险，若股票价格同向波动，将引起基金净值波动。

3、创业板企业所处行业和业务具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有不确定性。

4、创业板企业未来可能存在首次公开发行前最近 3 个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形。

5、创业板新股发行价格、规模、节奏等坚持市场化导向，询价、定价、配售等环节由机构投资者主导。同时，因创业板企业具有技术新、前景不确定、业绩波动大、风险高等特征，市场可比公司较少，传统估值方法可能不完全适用，发行定价难度较大，股票上市后可能存在股价波动的风险。

6、初步询价结束后，创业板发行人预计发行后总市值不满足其在招股说明书中明确选择的市值与财务指标上市标准的，将按规定中止发行。

7、创业板股票网上发行比例、网下向网上回拨比例、申购单位、投资风险特别公告发布等与目前深交所主板股票发行规则存在差异。

8、首次公开发行股票时，发行人和主承销商可以采用超额配售选择权，存在发行人增发股票的可能性。

9、创业板制度允许上市公司设置表决权差异安排。上市公司可能根据此项安排，存在控制权相对集中，以及因每一特别表决权股份拥有的表决权数量大于每一普通股份拥有的表决权数量等情形，而使普通投资者的表决权及对公司日常经营等事务的影响力受到限制。

10、出现《深圳证券交易所创业板股票上市规则》以及上市公司章程规定的情形时，特别表决权股份将按 1:1 的比例转换为普通股份。

11、相对于主板上市公司，创业板上市公司的股权激励制度更为灵活，包括股权激励计划所涉及的股票比例上限和对象有所扩大、价格条款更为灵活、实施方式更为便利。实施该等股权激励制度安排可能导致公司实际上市交易的股票数量超过首次公开发行时的数量。

	<p>12、创业板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，上市后的前 5 个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 20%，因此可能产生股价波动的风险。</p> <p>13、创业板股票交易的单笔申报数量、最小价格变动单位、有效申报价格范围等与深交所主板市场股票交易存在差异，可能产生无效申报。</p> <p>14、创业板股票交易方式包括竞价交易、盘后固定价格交易，不同交易方式的交易时间、申报要求、成交原则等存在差异。创业板股票大宗交易，不适用上交所主板市场股票大宗交易中固定价格申报的相关规定。</p> <p>15、创业板股票上市首日即可作为融资融券标的，与深交所主板市场存在差异。</p> <p>16、创业板股票交易盘中临时停牌情形和严重异常波动股票核查制度与上交所主板市场规定不同。</p> <p>17、符合相关规定的红筹企业可以在创业板上市。红筹企业在境外注册，可能采用协议控制架构，在信息披露、分红派息等方面可能与境内上市公司存在差异。红筹公司注册地、境外上市地等地法律法规对当地投资者提供的保护，可能与境内法律为境内投资者提供的保护存在差异。</p> <p>18、红筹企业可以发行股票或存托凭证在创业板上市。存托凭证由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行，代表境外基础证券权益。红筹公司存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当，但不能等同于直接持有境外基础证券，在交易和持有红筹公司股票或存托凭证过程中可能存在风险。</p> <p>19、创业板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件（以下简称法律法规）和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改，或者制定新的法律法规和业务规则。</p>
<p>删除： （十三）非公开发行债券投资风险</p> <p>非公开发行债券的流动性风险在于该类债券采取非公开方式发行和交易，由于不公开资料，外部评级机构一般不对这类债券进行外部评级，可能会降低市场对该类债券的认可度，从而影响该类债券的市场流动性。</p> <p>非公开发行债券的信用风险在于该类债券发行主体的资产规模较小、经营的波动性较大，同时，各类材料（包括募集说明书、审计报告）不公开发布，也大大提高了分析并跟踪发债主体信用基本面的难度。</p> <p>当持有的该类或某只债券出现重大价格波动，非公开发行债券的上述风险会影响组合的风险特征，特别是由于信用风险会带来该类或某只债券价格的大幅下跌。由于该类债券的流动性较差，如果对该类债券的持仓比例较高，将会给资产管理计划资产带来较大的流动性冲击。</p> <p>（十四）非公开定向债务融资工具风险</p> <p>非公开定向债务融资工具的利率水平一般根据市场的利率水平和信用评级水平确定。受国民经济运行状况和国家宏观政策等因素的影响，市场利率存在波动的不确定性。非公开定向债务融资工具在存续期限内，不排除市场利率波动的可能，利率的波动将给投资定向工具的收益水平带来一定的不确定性。</p> <p>非公开定向债务在存续期发行后，将限定在银行间市场特定数量的机构投资者范围内流通转让，存在一定的流动性风险。此外，非公开定向债务融资工具的存续期间，如果由于不能控制的市场及环境变化，发行人不能从预期的还款来源中获得足够资金，可能使定向工具不能按期得到偿付。</p>	
<p>删除： （十六）可转换债券和可交换债券投资风险</p> <p>1、正股价格波动的风险。可转债价格、可交换债价格与股票市场价格有正向联动性，当股票市场价格下跌时，一定期间内可转债价格、可交换债价格下跌甚至跌破票面价的情况也时有发生。虽然不影响到期收益，但正股价格一直下跌，会增加可转债、可交换债的持有风险，也会增加持有的时间成本。</p> <p>2、利息损失的风险。当公司股价一直下跌，转股价（换股价）高于正股价格时，可转债（可交换债）投资者若大部分都不愿转股，造成上市公司短期内面临巨大的偿债压力，最终偿付的利率可能不达预期。</p> <p>3、提前赎回的风险。发行人在发行可转债、可交换债时就会明确在特定条件下将以某一价格赎回债券，而赎回债券往往限定了投资者收益率上限，计划投资可转债、可交换债可能面临机会成本的损失。</p> <p>（十七）永续债投资风险</p> <p>1、永续债没有约定债务偿还期限且条款设置可能较为灵活，融资人有权无限递延偿还本金及利息。这一特点可能导致永续债流动性低从而增大变现难度，本资产管理计划如无法及时变现所投资的永续债，导致在开放期不足以支付投资者退出款项，投资者将可能面临无法及时退出的风险。</p> <p>2、永续债赋予发行人延期选择权及赎回选择权，同时还可设置利息递延支付条款，投资永续债面临本金及收益存在较大不确定性的风险。</p> <p>3、永续债一般设有利率重置条款，当债券行权日，如果发行人不赎回或是选择延期，债券票面利率往往会重置，如重置后带来票面利率的提升，将增加发行人财务负担，若发行人无法付息，投资者面临无法获得利息甚至收回本金的风险。</p>	

(十八)投资融资融券的风险

1、融资融券交易除具有普通证券交易所具有的政策风险、市场风险、违约风险、系统风险、上市公司经营风险等各种风险外，还有其特有的投资风险放大的风险。因本资产管理计划向证券公司借入资金或证券进行信用交易具有财务杠杆放大效应，如标的证券价格未如本资产管理计划预期的那样运行，则有可能产生远远超出普通交易可能带来的损失，该损失将由投资者自行承担。

2、本资产管理计划在从事融资融券交易期间，如果不能按照约定的期限清偿债务，或因上市证券价格波动导致其维持担保比例达到或低于平仓线，且不能按照约定的时间、数量追加担保物时，将面临担保物被强制平仓的风险。本资产管理计划出现其他严重违约或危及证券公司债权的情况，也可能导致强制平仓。一旦实施强制平仓，本资产管理计划部分或全部未了结的融资融券合约将可能被提前了结，并由证券公司根据合同约定自主选择平仓的时间、品种、价格、数量等，投资者将承担由此产生的经济损失。

3、在融资融券交易期间，如本资产管理计划信用资质状况降低、出现违约情况，证券公司有权降低或取消投资者的授信额度，或者提高警戒线、平仓线，上述措施可能会导致本资产管理计划保证金可用余额不足、引发强制平仓风险，由此产生的损失将由投资者自行承担。

4、本资产管理计划在从事融资融券交易期间，如果中国人民银行规定的同期金融机构贷款基准利率提高，证券公司将相应提高融资利率或融券费率，本资产管理计划将面临融资融券成本增加的风险。

5、本资产管理计划在从事融资融券交易期间，如发生融资融券标的证券范围调整、标的证券暂停交易、终止上市或要约收购等情形时，本资产管理计划将可能面临被提前了结融资融券合约、强制平仓的风险，由此产生的损失将由投资者自行承担。

6、本资产管理计划在从事融资融券交易期间，由于现行有关法律、法规、规章以及中国证券业协会、证券交易所和中国结算公司业务规则发生变更等原因，可能给本资产管理计划造成损失，该损失将由投资者自行承担。

删除：

(二十一)场内期权的投资风险

1、期权属于高风险高收益的金融衍生品，由于高杠杆特征，当出现不利行情时，所投资期权合约品种微小的变动就可能使本集合计划遭受较大损失。

2、如本集合计划作为期权合约的买方，当出现不利行情时，如本集合计划选择不执行期权则本集合计划可能损失权利金/期权费及相应的时间成本，如本集合计划选择执行期权则可能因为不利行情因素导致本集合计划投资遭受损失；如本集合计划作为期权合约的卖方，如果买方决定行使权利，卖方就有义务配合，存在因履行义务而使集合计划资产产生较大的损失。

3、当前，我国的场内期权交易品种及相关法律法规、交易规则尚未完全建立，不排除该等法律法规、交易规则的实施可能导致本集合计划无法参与期权交易。

(二十二)资产支持证券的投资风险

1、主体和信用风险

(1)原始权益人破产风险

原始权益人破产可能对经营产生不良影响，营业收入无法按时实现，从而影响纳入专项计划合同债权的最终实现。

(2)监管账户被查封、冻结的风险

若原始权益人开立的监管账户在专项计划存续期间被查封、冻结等，将影响基础资产现金流的接收以及划转，从而威胁到基础资产现金流的安全。

(3)保证人信用风险

若保证人未按相关担保协议的规定提供相应担保，则可能对优先级资产支持证券的本金和预期收益支付带来不利影响。

2、与资产支持证券相关的风险

(1)评级风险

评级机构对资产支持证券的评级不是购买、出售或持有资产支持证券的建议，而仅是对资产支持证券预期收益和/或本金偿付的可能性作出的判断，不能保证资产支持证券的评级将一直保持在该等级，评级机构可能会根据未来具体情况撤销资产支持证券的评级。评级机构撤销或降低资产支持证券的评级可能对其价值带来负面影响。

(2)专项计划提前终止的风险

交易文件规定，专项计划进入加速清偿程序或发生违约事件的，资产支持证券提前到期的，原始权益人应按照《资产买卖协议》的约定回购剩余基础资产。专项计划的提前终止可能导致投资者所持有的优先级资产支持证券提前到期，给投资者带来风险。

(3)流动性风险

资产支持证券将在深交所综合协议交易平台的技术支持下进行转让，若该交易系统不能满足投资者的活跃交易要求、或资产支持证券交易本身不够活跃，则资产支持证券存在因流动性不足而导致投资者无法在合理的

<p>时间内以公允价格出售资产支持证券的风险。</p> <p>(4) 现金流分配机制风险</p> <p>专项计划如果采用了优先级/次级产品结构化分层的增信措施,在每期偿付的资金确认日,如果当期从监管账户收到的现金款项未能全额兑付优先级资产支持证券预期应付本金和收益时,由计划管理人使用专项计划账户中次级资产支持证券占有的现金流进行分级支持,如该支持无法成功实现,可能会对优先级资产支持证券预期应付本金和收益的兑付造成风险。</p> <p>3、与专项计划管理相关的风险</p> <p>(1) 计划管理人违规风险</p> <p>在专项计划存续期间,计划管理人如出现严重违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的情形,计划管理人可能会被取消资格,监管部门也可能对资产支持证券采取暂停和终止转让服务等处理措施,从而可能给投资者带来风险。</p> <p>(2) 监管人、托管人违规风险</p> <p>在专项计划存续期间,监管人对监管账户进行监督管理,并根据专项计划文件的约定负责将监管账户中的资金向专项计划账户中进行划转。若监管银行出现违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的情形,可能会影响资产支持证券投资者按时、足额获得本金和预期收益。</p> <p>专项计划在存续期内的托管、分配等所有现金收支活动均涉及托管人。若托管人出现严重违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的情形,亦可能会影响资产支持证券持有人按时、足额获得本金和预期收益。</p> <p>(3) 专项计划运作风险</p> <p>在专项计划运作过程中,计划管理人的知识、经验、判断、决策、技能等,会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断,如计划管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响专项计划的收益水平,从而产生风险。</p>	
<p>第 25 部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p>	
	<p>一、资产管理合同变更的情形</p> <p>新增:</p> <p>(二) 经管理人与托管人协商一致,可通过公告的方式调低管理费率、调低托管费率、调高业绩报酬计提基准、调低业绩报酬计提比例。</p>
<p>一、资产管理合同变更的情形</p> <p>(三)除上述(一)所述情形外,因其他原因需要变更资产管理合同的,管理人应与托管人经书面达成一致后在管理人网站公告,并应在公告后 5 个工作日内以管理人网站公告方式或其他方式告知(具体由管理人决定)向投资者发送合同变更征询意见函,并采取如下权利保障措施及安排:</p> <p>1、投资者不同意变更的,管理人保障其退出权利,具体退出安排以管理人公告为准;</p> <p>2、投资者不同意变更且逾期未退出的,则管理人有权在征询意见函或公告中说明的意见回复期限届满后将相关份额强制退出计划(退出价格为退出当日资产管理计划相应份额的单位净值),由此发生的相关税费或或有损失由投资者自行承担;</p> <p>3、投资者未回复意见且逾期未退出,视同投资者同意本合同变更,管理人不再另行通知;</p> <p>4、投资者回复意见不明确的,则视为该投资者不同意变更,按照上述 1-2 处理。</p> <p>(四)资产管理计划改变投向和比例的,应当事先取得投资者同意。</p> <p>(五)本合同的变更满足法律法规要求的资产管理计划成立要件后,本合同变更生效。自合同变更生效之日起,变更后的内容即成为本合同组成部分。</p> <p>(六)管理人自资产管理合同变更之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案,并抄报中国证监会相关派出机构。</p>	<p>一、资产管理合同变更的情形</p> <p>(三)除上述(一)(二)所述情形外,因其他原因需要变更资产管理合同的,管理人应与托管人经书面达成一致后在管理人网站公告,并应在公告后 5 个工作日内以管理人网站公告方式或其他方式告知(具体由管理人决定)向投资者发送合同变更征询意见函,并采取如下权利保障措施及安排:</p> <p>1、投资者不同意变更的,管理人保障其退出权利,具体退出安排以管理人公告为准;</p> <p>2、投资者不同意变更且逾期未退出的,则管理人有权在征询意见函或公告中说明的意见回复期限届满后将相关份额强制退出计划(退出价格为退出当日资产管理计划相应份额的单位净值),由此发生的相关税费或或有损失由投资者自行承担;</p> <p>3、投资者未回复意见且逾期未退出,视同投资者同意本合同变更,管理人不再另行通知;</p> <p>4、投资者回复意见不明确的,则视为该投资者不同意变更,按照上述 1-2 处理。</p> <p>(四)资产管理计划改变投向和比例的,应当事先取得投资者同意。</p> <p>(五)资产管理合同的变更事项自管理人公告中确定的合同变更生效日起生效。自合同变更生效之日起,变更后的内容即成为本合同组成部分,对合同各方均具有法律效力。</p> <p>(六)管理人自资产管理合同变更之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案。</p>
<p>三、资产管理计划的展期</p> <p>(一)展期的条件</p> <p>删除:</p> <p>2、管理人和托管人协商一致同意展期</p>	
<p>三、资产管理计划的展期</p> <p>(五)展期情况备案</p> <p>本资产管理计划展期后 5 个工作日内,管理人将展期情况向证券投资基金业协会备案,同时抄报中国证监会相关派出机构。</p>	<p>三、资产管理计划的展期</p> <p>(五)展期情况备案</p> <p>本资产管理计划展期后 5 个工作日内,管理人将展期情况向证券投资基金业协会备案。</p>
<p>四、资产管理计划终止的情况</p> <p>管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案,并抄报中国证监会相关派出机构,前述第(七)项约定的情形除外。</p>	<p>四、资产管理计划终止的情况</p> <p>管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案,前述第(七)项约定的情形除外。</p>
<p>五、资产管理计划的清算</p> <p>(二)资产管理计划财产清算程序</p> <p>6、将清算报告报中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会备案并公告;</p>	<p>五、资产管理计划的清算</p> <p>(二)资产管理计划财产清算程序</p> <p>6、将清算报告报证券投资基金业协会备案并公告;</p>



<p>五、资产管理计划的清算</p> <p>(五) 延期清算的处理方式</p> <p>资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的, 管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。管理人可针对该部分未能流通变现证券制定延期清算方案, 该方案应经资产管理计划清算小组认可, 并通过管理人网站进行披露。管理人应根据延期清算方案的规定, 对前述未能流通变现的财产在可流通变现后进行清算, 并将变现后的财产扣除相关费用后按照投资者持有对应份额的比例或者资产管理合同的约定, 以货币形式全部分配给投资者, 并注销资产管理计划专用证券账户和资金账户。在进行延期清算的变现过程中, 变现的资金以现金保存, 不得再进行投资。</p> <p>管理人应当在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案, 并抄报中国证监会相关派出机构。</p>	<p>五、资产管理计划的清算</p> <p>(五) 延期清算的处理方式</p> <p>资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的, 管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。管理人可针对该部分未能流通变现证券制定延期清算方案, 该方案应经资产管理计划清算小组认可, 并通过管理人网站进行披露。管理人应根据延期清算方案的规定, 对前述未能流通变现的财产在可流通变现后进行清算, 并将变现后的财产扣除相关费用后按照投资者持有对应份额的比例或者资产管理合同的约定, 以货币形式全部分配给投资者, 并注销资产管理计划专用证券账户和资金账户。在进行延期清算的变现过程中, 变现的资金以现金保存, 不得再进行投资。</p> <p>管理人应当在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案。</p>
<p>第 26 部分 违约责任</p>	
<p>删除:</p> <p>三、管理人对外交给其他机构负责清算移交的资产管理计划资产及其收益, 因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给资产管理计划资产造成的损失等。</p>	
<p>第 28 部分 资产管理合同的效力</p>	
<p>三、合同的有效期限</p> <p>本合同自合同成立起生效, 至本资产管理计划终止日终止。在符合法律法规、监管规定和本合同约定的条件下, 本计划可提前终止或展期, 本合同一并提前终止或展期。终止日以管理人公告为准, 但合同项下有关清算、违约责任、争议解决的条款仍然有效。</p> <p>四、合同的组成</p> <p>《安信研究精选集合资产管理计划说明书》是管理人对本资产管理计划重要事项的说明, 是本合同重要附件, 与合同具有同等法律效力。</p>	<p>三、合同的有效期限</p> <p>本合同的有效期限自成立之日起, 至本资产管理计划终止日终止。在符合法律法规、监管规定和本合同约定的条件下, 本资产管理计划可提前终止或展期, 本合同一并提前终止或展期。终止日以管理人公告为准, 但合同项下有关清算、违约责任、争议解决的条款仍然有效。</p> <p>四、合同的组成</p> <p>《安信资管策略优选 5 号集合资产管理计划说明书》是管理人对本资产管理计划重要事项的说明, 是本合同重要附件, 与合同具有同等法律效力。</p>
<p>删除:</p> <p>第 28 部分 或有事件</p> <p>根据相关法律法规的规定, 管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。</p> <p>投资者、托管人在此同意, 如果或有事件发生, 管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司, 并无须就此项变更与投资者、托管人另行签订专项协议。但管理人应及时将此项变更书面通知托管人, 并以管理人网站公告的形式通告投资者。</p> <p>管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格, 并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。</p> <p>管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。</p>	
<p>增加合同附件 (相关账户信息、管理人发送的投资指令格式、投资监督表和风险揭示书)</p>	

附件二

## 关于安信研究精选集合资产管理计划合同变更的 回复意见函

本委托人同意/不同意安信证券资产管理有限公司于2023年6月8日发布的《关于安信研究精选集合资产管理计划合同变更的公告》中有关安信研究精选集合资产管理计划合同变更相关事项。

特此函复。

委托人：

证件号码：

手机号码：

日期：

注：委托人在签署完毕后，请拍照或扫描发送至邮箱：[axzg@essence.com.cn](mailto:axzg@essence.com.cn)。