

# 关于华鑫证券全天候明珠1号集合资产管理计划资产管理合同第一次变更

## 的征询意见函及临时开放期设置公告

尊敬的投资者：

由华鑫证券有限责任公司（以下简称“我司”）管理的“华鑫证券全天候明珠1号集合资产管理计划”成立于2022年2月15日。现为给投资者提供更专业的资产管理服务，我司拟对《华鑫证券全天候明珠1号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXZQQTH-2022第1号）的“重要提示、前言、释义、承诺与声明、当事人及权利义务、本计划的基本情况、本计划的募集、本计划的成立与备案、本计划的参与、退出与转让、资产管理计划的投资、利益冲突及关联交易、投资经理的指定与变更、资产管理计划的财产、投资指令的发送、确认和执行、越权交易的界定、资产管理计划财产的估值和会计核算、资产管理计划的费用与税收、资产管理计划的收益与分配、信息披露与报告、风险揭示、资产管理合同的变更、终止与清算、违约责任、争议的处理、资产管理合同的效力”等章节的部分条款及事项进行变更和修订，《华鑫证券全天候明珠1号集合资产管理计划说明书》及《华鑫证券全天候明珠1号集合资产管理计划风险揭示书》作为主合同的组成部分同步作变更，并按照合同约定向全体投资者征询意见。

我司确认并承诺更新或修改的内容不违反法律法规和中国证监会的有关规定，不损害投资者利益。我司与托管人（宁波银行股份有限公司）协商确认，通过签署《华鑫证券全天候明珠1号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXZQQTH-2022第1号-XD1）（以下简称《资管合同》）的方式对《华鑫证券全天候明珠1号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXZQQTH-2022第1号）内容进行更新或修改。

### 一、 主要变更事项的说明

（一）华鑫证券全天候明珠1号集合资产管理计划资产管理合同（合同编号：HXZQQTH-2022第1号-XD1）

本次合同变更主要内容如下，详细修订内容详见“第二章、华鑫证券全天候明珠1号集合资产管理计划资产管理合同修订前后款对照表”：

- （1）重要提示
- （2）前言
- （3）释义
- （4）承诺与声明
- （5）当事人及权利义务
- （6）本计划的基本情况
- （7）本计划的募集
- （8）本计划的成立与备案

- (9) 本计划的参与、退出与转让
- (10) 资产管理计划的投资
- (11) 利益冲突及关联交易
- (12) 投资经理的指定与变更
- (13) 资产管理计划的财产
- (14) 投资指令的发送、确认和执行
- (15) 越权交易的界定
- (16) 资产管理计划财产的估值和会计核算
- (17) 集合计划费用与税收
- (18) 资产管理计划的收益与分配
- (19) 信息披露与报告
- (20) 风险揭示
- (21) 资产管理合同的变更、终止与清算
- (22) 违约责任
- (23) 资产管理合同的效力

修改后的资产管理合同请参见华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划资产管理合同（合同编号：HXZQQTH-2022 第 1 号-XD1）。

## （二）华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划说明书

《华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划说明书》对相应资产管理合同同步变更。

## 二、华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划资产管理合同修订前后款对照表

| 变更前的条款                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 变更后的条款                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划资产管理合同<br>(编号: HXZQQTH-2022 第 1 号)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划资产管理合同<br>(编号: HXZQQTH-2022 第 1 号-XD1)                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| <b>重要提示</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <p>特别约定：《华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以纸质或中登电子签名方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者（华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以纸质或中登电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。托管人仅认可通过中国证券登记结算有限责任公司系统进行合同文本及电子数据相关传输保存。</p> <p>投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者通过销售机构认可的有效身份验证措施登录相关网络系统后，以中登电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险</p> | <p>特别约定：《华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以纸质或电子签名方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者（华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以纸质或电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。托管人仅认可通过中国证券登记结算有限责任公司系统进行合同文本及电子数据相关传输保存。</p> <p>投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者通过销售机构认可的有效身份验证措施登录相关网络系统后，以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书</p> |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。管理人同意向托管人提供中国证券登记结算公司电子合同签署有关投资者信息，供托管人完成电子合同签署的相关流程。</p> <p>本合同及管理人公告中的业绩报酬计提基准并不是管理人向客户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。在集合计划资产出现极端损失情况下，投资者可能面临无法取得收益乃至投资本金受损的风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | <p>的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。管理人同意向托管人提供中国证券登记结算公司电子合同签署有关投资者信息，供托管人完成电子合同签署的相关流程。</p> <p>本合同及管理人公告中的业绩报酬计提基准（如有）并不是管理人向客户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。在集合计划资产出现极端损失情况下，投资者可能面临无法取得收益乃至投资本金受损的风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| <p style="text-align: center;"><b>第一部分 前言</b></p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| <p>一、订立本资产管理合同的依据、目的和原则</p> <p>（一）订立本资产管理合同（以下简称“本合同”）的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发[2018]106号，以下简称《指导意见》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[第151号]，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》（证监会公告[2018]31号，以下简称《运作管理规定》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》（证监会公告[2016]13号，以下简称《暂行规定》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》、《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引（试行）》及其他有关法律法规的规定。</p> <p>若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容与届时有效的法律法规存在冲突，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时对本合同进行相应变更和调整。</p> <p>（二）订立本合同的目的是在严格遵守国家有关法律法规的前提下，保护本合同各当事人合法权益，明确本合同各当事人之间权利和义务，保证本集合资产管理业务合法、合规及有效地进行。</p> <p>（三）订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用和公平，充分保护本合同各当事人的合法权益。</p> <p>二、投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本计划存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，该投资者不再是资产管理计划的投资者和资产管理合同的当事人。</p> | <p>一、订立本资产管理合同的依据、目的和原则</p> <p>（一）订立本资产管理合同（以下简称“本合同”）的依据是《中华人民共和国民法典》、《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》）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发[2018]106号，以下简称《指导意见》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[第203号]，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》（证监会公告[2023]2号，以下简称《运作规定》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》（证监会公告[2016]13号，以下简称《暂行规定》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》、《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引（试行）》及其他有关法律法规的规定。</p> <p>若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容与届时有效的法律法规存在冲突，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时对本合同进行相应变更和调整。</p> <p>（二）订立本合同的目的是在严格遵守国家有关法律法规的前提下，保护本合同各当事人合法权益，明确本合同各当事人之间权利和义务，保证本集合资产管理业务合法、合规及有效地进行。</p> <p>（三）订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用和公平，充分保护本合同各当事人的合法权益。</p> <p>二、投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本计划存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，该投资者不再是资产管理计划的投资者和资产管理合同的当事人。</p> |
| <p>五、投资者承诺以真实身份参与集合计划，并符合《管理办法》、《运作管理规定》、《指导意见》及本合同中关于“合格投资者”的要求，保证委托资产的来源及用途合法，所披露或提供的信息和资料真实，并已阅知本合同和《说明书》全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。投资者承诺投资者为合格投资者，并配合提供相关证明</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | <p>五、本集合计划为【混合类】资产管理计划，本集合计划在投资过程中可能面临多种风险，包括但不限于市场风险、政策法律风险、金融监管风险、信用风险、管理风险、流动性风险等；此外，本集合计划可能面临提前终止的风险。</p> <p>投资者在投资本集合计划之前，请仔细阅读本集合计划的资产管理合同与风险揭示书，全面认识本集合计划的风险收益特征</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>材料。</p> <p>投资者承诺已经履行反洗钱职责，确认不存在洗钱行为，不得将自有资金和募集资金混同操作。并在签订本合同前，已经签署了风险揭示书及客户风险承受能力调查表，投资者阅知本合同全文，了解相关权利、义务和风险，并根据自身能力审慎决策参与本计划，对投资行为承担完全后果，独立承担投资风险。</p> <p>六、管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用委托资产，但不保证委托资产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。</p> <p>七、托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，保护委托资产的安全，但不保证委托资产本金不受损失或取得最低收益。</p> <p>八、本集合计划为【固收类】资产管理计划，本集合计划在投资过程中可能面临多种风险，包括但不限于市场风险、政策法律风险、金融监管风险、信用风险、管理风险、流动性风险等；此外，本集合计划可能面临提前终止的风险。投资者在投资本集合计划之前，请仔细阅读本集合计划的资产管理合同与风险揭示书，全面认识本集合计划的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。</p> <p>九、管理人与销售机构（如有）为不同法律实体，管理人已提示销售机构履行销售适当性管理义务，并已提示投资者审慎规避违规、不当销售行为，如销售机构仍然违规或不当实施销售行为，则由销售机构对投资者承担责任。</p> <p>十、本合同是规定各当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与本计划相关的涉及本合同各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本合同不一致或有冲突，均以本合同为准。</p> | <p>和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。</p> <p>六、管理人与销售机构（如有）为不同法律实体，管理人已提示销售机构履行销售适当性管理义务，并已提示投资者审慎规避违规、不当销售行为，如销售机构仍然违规或不当实施销售行为，则由销售机构对投资者承担责任。</p> <p>七、本合同是规定各当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与本计划相关的涉及本合同各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本合同不一致或有冲突，均以本合同为准。</p> <p>八、投资者同意，投资者为自然人的，管理人为履行本合同约定或遵守相关法律法规规定，有权按照《中华人民共和国个人信息保护法》处理投资者的个人信息。</p> |
| <p style="text-align: center;"><b>第二部分 释 义</b></p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <p>7、《管理办法》：指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[第151号]）。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | <p>7、《管理办法》：指中国证监会于2018年10月22日发布并于2023年1月12日修订的《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]）。</p>                                                                                                                                                                                                                                            |
| <p>8、《运作规定》：指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2018]31号）。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | <p>8、《运作规定》：指中国证监会于2018年10月22日发布并于2023年1月12日修订的《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）。</p>                                                                                                                                                                                                                                        |
| <p>20、本合同生效日、资产管理计划成立日：指资产管理计划初始募集期结束并完成验资，经资产管理人公告本计划成立之日。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | <p>20、本合同生效日、资产管理计划成立日：指资产管理计划初始募集期结束，经资产管理人公告本计划成立之日。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <p>33、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>33、7个工作日可变现资产：包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及标准化期权合约和同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。</p>                                                                                                                                                                                                              |
| <p>39、交易日：指上海证券交易所、深圳证券交易所等相关交</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | <p>39、交易日：指上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 易场所的正常交易日。<br>40、交易时间：指上海证券交易所、深圳证券交易所等相关交易场所的正常交易时间                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 交易所等相关交易场所的正常交易日。<br>40、交易时间：指上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所等相关交易场所的正常交易时间。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| <b>第三部分</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| <b>一、管理人承诺</b><br>2、已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | <b>一、管理人承诺</b><br>2、已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估。管理人应对项目的合规性负责(包括但不限于遵守关联关系禁止等外部法律法规的要求)。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| <b>二、托管人承诺</b><br>2、根据法律法规、中国证监会及协会的规定和本合同约定，对管理人的投资或清算指令进行监督。<br>3、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及本合同约定召集份额持有人大会（如有），维护投资者权益，份额持有人大会设立日常机构的除外（如有）。<br>4、根据《中华人民共和国反洗钱法》等反洗钱相关法律法规要求履行反洗钱义务，包括但不限于客户身份识别、客户身份和交易资料留存、大额交易和可疑交易报告，并为资产管理人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外。                                                                                                                                                                                                                                                        | <b>二、托管人承诺</b><br>2、根据法律法规、中国证监会及协会的规定和本合同约定，对管理人的投资或清算指令进行监督。托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，保护委托资产的安全，但不保证委托资产本金不受损失或取得最低收益。<br>3、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及本合同约定召集份额持有人大会（如有），维护投资者权益，份额持有人大会设立日常机构的除外（如有）。<br>4、托管人保证所提供的资料和信息真实、准确、完整、合法。<br>5、根据《中华人民共和国反洗钱法》等反洗钱相关法律法规要求履行反洗钱义务，包括但不限于客户身份识别、客户身份和交易资料留存、大额交易和可疑交易报告，并为资产管理人开展反洗钱工作提供充分的协助，法律法规另有规定的除外。                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>三、投资者声明</b><br>1、符合《运作规定》合格投资者的要求，以真实身份参与集合计划，保证其向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。<br>2、投资者投资于资产管理计划的财产为其拥有合法所有权或处分权的资产，财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等方式筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。<br>3、已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对本计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。<br>4、投资者保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人对该资产管理计划财产行使投资管理权；保证有完全及合法的授权委托管理人和托管人进行资产管理计划财产的投资管理和托管业务，而且该等委托不会为任何其他第三方所质疑。 | <b>三、投资者声明</b><br>1、符合《运作规定》合格投资者的要求，以真实身份参与集合计划，并配合提供相关证明材料。保证其向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。<br>2、投资者投资于资产管理计划的财产为其拥有合法所有权或处分权的资产，财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等方式筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。<br>3、已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，并在签订本合同前，已经签署了风险揭示书及客户风险承受能力调查表，知晓管理人、托管人及相关机构不应对本计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。<br>4、投资者保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人对该资产管理计划财产行使投资管理权；保证有完全及合法的授权委托管理人和托管人进行资产管理计划财产的投资管理和托管业务，而且该等委托不会为任何其他第三方所质疑。<br>5、投资者知悉并确认：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 |

|                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                                                           | <p>理业务的公司。投资者在此同意，如果此或有事件发生，在管理人与托管人协商一致的基础上，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述的从事资产管理业务的公司，并无需就此项变更取得投资者同意，也无需和投资者另行签订协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告投资者。管理人保障投资者退出本集合计划的权利，并在届时的通告中对相关事项做出合理安排。</p> <p>6、投资者承诺已经履行反洗钱职责，确认不存在洗钱行为，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》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于证券投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺证券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；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。</p> |
| <b>第四部分 当事人及权利义务</b>                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| <p>一、合同当事人</p> <p>（二）管理人</p> <p>名称：华鑫证券有限责任公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 20C-1 房</p> | <p>一、合同当事人</p> <p>（二）管理人</p> <p>名称：华鑫证券有限责任公司</p> <p>注册地址：深圳市福田区香蜜湖街道东海社区深南大道 7888 号东海国际中心一期 A 栋 2301A</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| <p>五、管理人的权利包括但不限于：</p> <p>（十）法律法规、中国证监会、基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。</p>                                          | <p>五、管理人的权利包括但不限于：</p> <p>（十）选择、更换律师、审计师或其他为计划提供服务的外部机构。</p> <p>（十一）有权按照《个人信息保护法》及相关法律法规的规定处理投资者的个人信息，遵循合法、正当、必要和诚信原则。根据个人信息的处理目的、处理方式、个人信息的种类以及对个人权益的影响、可能存在的安全风险等，采取必要措施确保个人信息处理活动符合法律、行政法规的规定，防止未经授权的访问以及个人信息泄露、篡改、丢失。</p> <p>（十二）法律法规、中国证监会、基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <p>六、管理人的义务包括但不限于：</p> <p>（十一）除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；</p>                                      | <p>六、管理人的义务包括但不限于：</p> <p>（十一）除规定情形或符合规定条件外，不得为本机构、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；</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| <p>（二十一）根据法律法规与本合同约定，编制向投资者披露的本计划季度、年度等定期报告；</p> <p>（二十二）办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；</p>                      | <p>（二十一）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>（二十二）根据法律法规与本合同约定，编制向投资者披露的本计划季度、年度等定期报告；</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>(二十三) 建立并保存投资者名单;</p> <p>(二十四) 组织并参加本计划财产清算小组, 参与本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配;</p> <p>(二十五) 按照法律法规和中国证监会的规定, 保存本计划的会计账册、妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据, 保存期限自本计划终止之日起不得少于 20 年;</p> <p>(二十六) 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>(二十七) 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>(二十三) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项;</p> <p>(二十四) 建立并保存投资者名单;</p> <p>(二十五) 组织并参加本计划财产清算小组, 参与本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配;</p> <p>(二十六) 按照法律法规和中国证监会的规定, 保存本计划的会计账册、妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据, 保存期限自本计划终止之日起不得少于 20 年;</p> <p>(二十七) 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>(二十八) 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>八、托管人的义务包括但不限于:</p> <p>(十五) 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>八、托管人的义务包括但不限于:</p> <p>(十五) 投资于《管理办法》第三十八条第(五)项规定资产时, 准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责, 并向投资者充分揭示;</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| <p>17、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, 并通过复核管理人季报和年报的方式向投资者充分揭示。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | <p>17、投资于《管理办法》第三十八条第(五)项规定资产时, 准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责, 并通过复核管理人季报和年报的方式向投资者充分揭示。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| <h3>第五部分 本计划的基本情况</h3>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| <p>一、本计划的基本情况:</p> <p>(二) 本计划的类别: 固收类集合资产管理计划</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | <p>一、本计划的基本情况:</p> <p>(二) 本计划的类别: 混合类集合资产管理计划</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <p>(五) 本计划的投资目标</p> <p>管理人采取稳健的资产配置策略, 通过自上而下的方法进行固收、权益、商品及金融衍生品类资产的战略及战术资产配置, 在控制组合波动的基础上, 提高组合的收益水平。</p> <p>(六) 本计划的投资方向</p> <p>主要投资方向为股票、债券、商品及金融衍生品、资产管理产品等标准化资产, 具体投资范围包括本合同约定的固定收益类资产及货币市场工具、权益类资产、商品及金融衍生品类资产、公开募集投资基金、债券正回购、融资融券、转融通证券出借业务。</p> <p>(七) 本计划的投资比例</p> <p>(1) 本计划投资于固定收益类资产及货币市场工具的比例占本资产管理计划总资产的【80%—100%】;</p> <p>(2) 本计划投资于权益类资产的比例占本资产管理计划总资产不得超过 20%;</p> <p>(3) 本计划投资于商品及金融衍生品的衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%;</p> <p>(4) 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%;</p> <p>(5) 集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%;</p> <p>(6) 投资于同一资产的资金, 不得超过计划资产净值的 25%;</p> | <p>(五) 本计划的投资目标</p> <p>管理人采取稳健的资产配置策略, 通过自上而下的方法进行固收、权益、期货和衍生品类资产的战略及战术资产配置, 在控制组合波动的基础上, 力争提高组合的收益水平。</p> <p>(六) 本计划的投资方向</p> <p>主要投资方向为股票、债券、期货和衍生品、资产管理产品等标准化资产, 具体投资范围包括本合同约定的固定收益类资产及货币市场工具、权益类资产、期货和衍生品类资产、公开募集投资基金、债券正回购、融资融券、转融通证券出借业务。</p> <p>(七) 本计划的投资比例</p> <p>(1) 本计划投资于固定收益类资产及货币市场工具的比例不超过本计划总资产的 80%; 投资于权益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%; 投资于期货和衍生品的持仓合约价值不超过本计划总资产的 80%, 或期货和衍生品账户权益占本计划总资产的比例不超过 20%;</p> <p>(2) 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%;</p> <p>(3) 集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%;</p> <p>(4) 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净资产 50%的, 本计划总资产不得超过净资产的 120%。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</p> |

资产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；

(7) 本计划参与股票、债券、可转换债券、可交换债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

(8) 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计划资产净值的 10%。

(9) 资产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（以下简称公募基金）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%。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、公募基金，以及中国证监会认定的其他投资组合可不受前述比例限制。本计划为【固收类】集合计划，主要投资于【固定收益类资产及货币市场工具】构建投资资产组合，符合《运作规定》组合投资的要求。

本计划投资范围包含【债券正回购、存托凭证、融资融券、转融通证券出借业务】，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。

本集合计划建仓期为 6 个月。在建仓期结束后，本资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。资产管理计划改变投向和比例的，将事先取得投资者的同意，并按规定履行合同变更流程。因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，证券期货经营机构应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，证券期货经营机构应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人需事先与资产托管人就清算交收、核算估值、交易监督、托管费率等事项与资产托管人书面协商一致，双方协商一致且资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

#### (八) 本计划的产品风险等级

根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为 R3，适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C3-C5】的普通投资者，具体以销售机构确认的风险等级为准。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

国证监会认可的投资品种不受前述规定的限制。

(5) 投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；资产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；

(6) 本计划参与股票、债券、可转换债券、可交换债券等证券发行申购时，申报的金额原则上不得超过集合计划的总资产，申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量；

(7) 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计划资产净值的 10%。

(8) 资产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（以下简称公募基金）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%。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、公募基金，以及中国证监会认定的其他投资组合可不受前述比例限制。

本计划为【混合类】集合计划，主要投资于【股票、债券、期货和衍生品】构建投资资产组合，符合《运作规定》组合投资的要求。

本计划投资范围包含【债券正回购、存托凭证、融资融券、转融通证券出借业务】，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。

本集合计划建仓期为 6 个月。在建仓期结束后，本资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。资产管理计划改变投向和比例的，将事先取得投资者的同意，并按规定履行合同变更流程。因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，证券期货经营机构应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，证券期货经营机构应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人需事先与资产托管人就清算交收、核算估值、交易监督、托管费率等事项与资产托管人书面协商一致，双方协商一致且资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

#### (八) 本计划的产品风险等级

根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为 R4，适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C4-C5】的普通投资者，投资者的风险承受能力等级具体以销售机构确认的为准。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>本计划的产品风险等级仅表示管理人基于产品基本情况的一般认定，未参考单一投资者特性。为详尽了解产品风险，投资者应重点关注本合同“风险揭示”部分内容，并结合自身年龄、职业、教育经历或投资经验等个性情况进行深入理解。因各种因素影响，本资产管理计划仍有可能发生超出预期之外的损失。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | <p>本计划投资所产生的全部风险。</p> <p>本计划的产品风险等级仅表示管理人基于产品基本情况的一般认定，未参考单一投资者特性。为详尽了解产品风险，投资者应重点关注本合同“风险揭示”部分内容，并结合自身年龄、职业、教育经历、投资目的、投资期限、资产状况、收入情况、投资经验、风险偏好、风险承受能力等个性情况进行深入理解。因各种因素影响，本资产管理计划仍有可能发生超出预期之外的损失。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <p>(十三) 服务机构信息</p> <p>本计划的份额登记机构为华鑫证券有限责任公司。管理人未委托其他服务机构代为办理本计划的估值与核算、信息技术服务。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | <p>(十三) 服务机构信息</p> <p>本计划的份额登记机构、估值与核算、信息技术服务机构为华鑫证券有限责任公司。管理人未委托其他服务机构代为办理本计划的估值与核算、信息技术服务。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| <p style="text-align: center;"><b>第六部分 本计划的募集</b></p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <p>一、本计划的募集对象</p> <p>本计划向合格投资者非公开募集，合格投资者不少于 2 人，且累计不得超过 200 人。</p> <p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本计划的金额不低于 30 万元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，且满足以下条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元。</p> <p>(二) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；</p> <p>(三) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国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>(四) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；</p> <p>(五) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；</p> <p>(六) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> <p>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>根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为 R3，仅适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C3-C5】的普通投资者】，具体以销售机构确认的风险等级为准。</p> | <p>一、本计划的募集对象</p> <p>本计划向合格投资者非公开募集，本计划的投资者人数不少于 2 人（含管理人），且累计不得超过 200 人。</p> <p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本计划的金额不低于 40 万元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，且满足以下条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元。</p> <p>(二) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；</p> <p>(三) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>(四) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；</p> <p>(五) 基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；</p> <p>(六) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> <p>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>根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为 R4，仅适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C4-C5】的普通投资者】，投资者的风险承受能力等级具体以销售机构确认的为准。</p> |
| <p>二、本计划的募集方式</p> <p>本计划将通过管理人的直销网点/销售机构向特定客户进行销售。本计划销售机构为华鑫证券有限责任公司，管理人有</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | <p>二、本计划的募集方式</p> <p>本计划将通过管理人的直销网点/销售机构向特定客户进行销售。本计划销售机构为华鑫证券有限责任公司直销渠道、华鑫</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

|                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>权以管理人网站公告方式增加其他销售机构。投资者认购本计划，必须与管理人和托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。投资者认购的具体金额和本计划份额以注册登记机构的确认结果为准。</p>                                                                                                                     | <p>证券有限责任公司以及管理人认可并与其签署相关协议的其他销售机构。管理人有权以管理人网站公告方式增加其他销售机构。管理人新增或变更本集合计划的销售机构时，将提前在管理人指定网站上公告，管理人网站公告后即生效，管理人无需就增加或变更销售机构事宜征求投资者意见或与投资者另行签订协议。投资者认购本计划，必须与管理人和托管人签订资产管理合同，按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。投资者认购的具体金额和本计划份额以注册登记机构的确认结果为准。</p>                                                                                                                             |
| <p>五、本计划认购申请的确认</p> <p>（四）注册登记机构可按照“时间优先，金额优先”的原则在初始募集期届满后对认购金额申请予以确认。在采用本原则进行确认时，认购时间在前者被优先确认，认购时间相同时认购金额高的投资者优先被确认。</p> <p>对未被确认的投资人，管理人应在初始募集期届满后 30 日内向投资者的资金结算账户中返还该等投资者已缴纳的认购金额，并加计银行同期活期存款利息。</p>                      | <p>五、本计划认购申请的确认</p> <p>（四）注册登记机构可按照“时间优先，金额优先”的原则在初始募集期届满后对认购金额申请予以确认。在采用本原则进行确认时，认购时间在前者被优先确认，认购时间相同时认购金额高的投资者优先被确认。</p> <p>对未被确认的投资者，管理人应在初始募集期届满后 30 日内向投资者的资金结算账户中返还该等投资者已缴纳的认购金额，并加计银行同期活期存款利息。</p>                                                                                                                                                     |
| <p>七、初始认购资金的管理及利息处理方式</p> <p>管理人应将本计划募集期间客户的资金存放于本计划募集结算专用账户，在本计划初始募集行为结束前，任何个人和机构不得动用。募集结算专用账户信息如下：</p> <p>户名：华鑫证券有限责任公司</p> <p>账号：98300153400000075</p> <p>开户行：上海浦发银行徐汇支行</p>                                               | <p>七、初始认购资金的管理及利息处理方式</p> <p>管理人应将本计划募集期间客户的资金存放于本计划募集结算专用账户，在本计划初始募集行为结束前，任何个人和机构不得动用。募集结算专用账户信息如下：</p> <p>户名：华鑫证券有限责任公司</p> <p>账号：98300153400000075</p> <p>开户行：上海浦东发展银行徐汇支行</p>                                                                                                                                                                            |
| <p>八、本计划的最低认购金额和支付方式</p> <p>认购资金应以现金形式交付。投资者初始单笔认购金额不得低于 30 万元人民币（不含认购费用）并可追加认购，追加认购金额需为 1 万元人民币的整数倍。首次参与指提出参与本集合计划申请的投资者在参与之前未持有本集合计划份额的情形。管理人可公告调整本集合计划首次参与和追加参与时的最低参与金额。</p>                                               | <p>八、本计划的最低认购金额和支付方式</p> <p>认购资金应以现金形式交付。投资者初始单笔认购金额不得低于 40 万元人民币（不含认购费用）并可追加认购，追加认购金额需为 1 万元人民币的整数倍。首次参与指提出参与本集合计划申请的投资者在参与之前未持有本集合计划份额的情形。管理人可公告调整本集合计划首次参与和追加参与时的最低参与金额。</p>                                                                                                                                                                              |
| <p>九、募集账户</p> <p>本集合计划管理人募集结算专用账户信息见上述第七条“初始认购资金的管理及利息处理方式”。其他销售机构委托募集账户信息（如有）由销售机构向投资者进行披露，投资者可在销售机构处查询。如投资者通过管理人直销渠道认购/申购本集合计划的，应将认购申购款划入【管理人直销渠道】募集结算归集专用账户（《华鑫证券直销渠道募集结算资金归集专用账户信息告知书》（附件六）将由管理人至少在销售期前一工作日在管理人网站披露）。</p> | <p>九、募集账户</p> <p>本集合计划管理人募集结算专用账户信息见上述第七条“初始认购资金的管理及利息处理方式”。其他销售机构委托募集账户信息（如有）由销售机构向投资者进行披露，投资者可在销售机构处查询。如投资者通过管理人直销渠道认购/申购本集合计划的，应将认购申购款划入【管理人直销渠道】募集结算归集专用账户（《华鑫证券直销渠道募集结算资金归集专用账户信息告知书》（附件六）将由管理人至少在销售期前一工作日在管理人网站披露）。</p> <p>华鑫证券有限责任公司作为运营服务机构，为【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户提供管理服务，对【管理人直销渠道】募集结算资金实施监督。各方确认：管理人委托的运营服务机构（华鑫证券有限责任公司）不对其直销渠道以外的募集账户承担监管义务。</p> |

## 第七部分 本计划的成立与备案

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>二、本计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托符合《证券法》相关规定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。管理人应在本计划成立起 5 个工作日内报协会备案。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>二、本计划的募集金额缴足并获得资产缴付证明之日起 10 个工作日内，管理人公告本计划成立。管理人应在本计划成立起 5 个工作日内报协会备案。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>三、本计划募集失败的处理方式</p> <p>募集期届满，本计划未达到本合同约定的成立条件的，本计划募集失败，则管理人应当承担下列责任：</p> <p>（一）以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</p> <p>（二）在募集期届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准。返还完毕各方互不承担其他责任。</p> <p>由于监管政策及指导意见的不时更新与变动，本计划可能存在无法成立或无法进行备案的风险，全体投资者确认，管理人及托管人对此不承担任何责任。</p> <p>四、本计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，管理人开展投资活动前，应及时向托管人发送成立通知及计划已通过协会备案的材料。符合本合同约定，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>三、本计划募集失败的处理方式</p> <p>募集期届满，本计划未达到本合同约定的成立条件的，本计划募集失败，则管理人应当承担下列责任：</p> <p>（一）以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；</p> <p>（二）在募集期届满后 30 日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准。返还完毕各方互不承担其他责任。</p> <p>由于监管政策及指导意见的不时更新与变动，本计划可能存在无法成立、或被监管机构、基金业协会要求进行整改规范的风险，全体投资者确认，管理人及托管人对此不承担任何责任。</p> <p>四、管理人应在本计划成立起 5 个工作日内报基金业协会备案。本计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。本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> |

## 第八部分 本计划的参与、退出与转让

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>二、参与和退出的开放日和时间</p> <p>业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。管理人应当确保集合资产管理计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日内可变现资产的价值不低于本集合计划资产净值的 10%，按规定限制或暂停退出的情况除外。</p>                                                                                                                                                                                                                          | <p>二、参与和退出的开放日和时间</p> <p>业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所等相关交易场所的正常交易日的交易时间。管理人应当确保集合资产管理计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日内可变现资产的价值不低于本集合计划资产净值的 10%，按规定限制或暂停退出的情况除外。管理人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%。</p>                                                                                                                                                          |
| <p>三、参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>（五）参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取“时间优先、金额优先”原则进行确认，退出申请按“先进先出”的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。当日（T 日）在交易时间内提交的参与/退出申请，管理人及注册登记机构在收到投资者退出/参与申请的 T+1 日对该交易的有效性进行确认，投资者原则上可在 T+2 日后到销售网点查询退出/参与的确认情况。巨额退出的情形按本部分第十条巨额退出及连续巨额退出的认定及办理方式办理；</p> <p>（六）参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，为无效申请，</p> | <p>三、参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>（五）参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取“时间优先、金额优先”原则进行确认，退出申请按“先进先出”的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。当日（T 日）在交易时间内提交的参与/退出申请，管理人及注册登记机构在收到投资者退出/参与申请的 T+1 日对该交易的有效性进行确认，投资者原则上可在 T+2 日后到销售网点查询退出/参与的确认情况。巨额退出的情形按本部分“巨额退出及连续巨额退出的认定及办理方式”办理；</p> <p>（六）参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，为无效申请，</p> |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>已交付的委托款项将退回投资者指定资金账户。</p> <p>投资者退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出投资者的指定资金账户，退出款项将在 T+2 日内从托管账户划出。如集合计划出现《集合资产管理合同》所述暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                    | <p>已交付的委托款项将退回投资者指定资金账户。</p> <p>投资者退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出投资者的指定资金账户，退出款项将在 T+2 日内从托管账户划出。如集合计划出现《集合资产管理合同》所述暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。由于交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则退出款顺延至管理人及托管人无法控制的因素消除后从托管账户划出。</p>                                                                                                                                                                                                                       |
| <p>四、参与和退出的金额限制</p> <p>“金额参与”原则，即参与时以金额申请。本集合计划的单个投资者首次参与的最低金额为【30 万元（不含参与费用）】，超过部分按 1 万及 1 万整数倍递增，追加参与的最低金额为 1 万元，超过部分按 1 万元整数倍递增。首次参与指提出参与申请的投资者在参与之前未持有本计划份额的情形。</p> <p>投资者部分退出集合计划份额时，如其该笔申请退出后在该销售机构剩余的集合计划份额净值低于【30 万元】时，则管理人自动将该投资者在该销售机构的全部分额退出给投资者。</p>                                                                                                                                                                                                   | <p>四、参与和退出的金额限制</p> <p>“金额参与”原则，即参与时以金额申请。本集合计划的单个投资者首次参与的最低金额为【40 万元（不含参与费用）】，超过部分按 1 万及 1 万整数倍递增，追加参与的最低金额为 1 万元，超过部分按 1 万元整数倍递增。首次参与指提出参与申请的投资者在参与之前未持有本计划份额的情形。</p> <p>投资者部分退出集合计划份额时，如其该笔申请退出后在该销售机构剩余的集合计划份额净值低于【40 万元】时，则管理人自动将该投资者在该销售机构的全部分额退出给投资者。</p>                                                                                                                                                                                                                                                   |
| <p>八、巨额退出</p> <p>（二）退出顺序、退出价格确定和退出款项支付</p> <p>出现巨额退出时，管理人和销售机构协商一致，可以根据本计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。</p> <p>1. 全额退出：当管理人和销售机构认为有能力兑付投资者的全部退出申请时，管理人接受全额退出，并按正常退出程序执行。</p> <p>2. 部分退出：当管理人和销售机构认为支付投资者的退出申请有困难或认为因支付投资者的退出申请而进行的财产变现可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出的总份额不低于当日集合计划上一日总份额 10%的前提下，可对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理并接受的退出申请；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权并以该工作日的计划单位净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。投资者在申请退出时可选择当日未受理部分予以撤销，未进行选择的默认顺延。</p> | <p>八、巨额退出的认定和处理方式</p> <p>（二）退出顺序、退出价格确定和退出款项支付</p> <p>出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。</p> <p>1. 全额退出：当管理人认为有能力兑付投资者的全部退出申请时，管理人接受全额退出，并按正常退出程序执行。</p> <p>2. 部分退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为因支付投资者的退出申请而进行的财产变现可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出的总份额不低于当日集合计划上一日总份额 10%的前提下，可对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理并接受的退出申请；未受理部分可延迟至下一个工作日办理。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权并以该工作日的计划单位净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。投资者在申请退出时可选择当日未受理部分予以撤销，未进行选择的默认顺延。巨额退出仍遵循“先进先出”原则。退出金额以后续开放日的集合资产管理计划份额净值为依据计算，并通过管理人网站向投资者公告。</p> |
| <p>十、延期支付及延期退出的情形和处理方式</p> <p>（五）发生连续巨额退出的情形</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | <p>十、延期支付及延期退出的情形和处理方式</p> <p>（五）发生巨额退出、连续巨额退出的情形。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| <p>无</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | <p>新增</p> <p>十五、资产管理计划份额的冻结与解冻</p> <p>经人民法院、人民检察院、公安机关及其他有权机构以及资产</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | <p>管理计划份额登记机构认可且符合法律法规的其他情况下,本集合计划的资产管理计划份额方可冻结与解冻。当集合计划份额处于冻结状态时,集合计划注册登记机构或其他相关机构有权拒绝集合计划份额的退出、非交易过户等业务的申请。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| <p>十五、管理人以自有资金参与本计划</p> <p>(一) 自有资金参与的条件和方式</p> <p>在本集合计划初始募集期起始日至集合计划终止日内,管理人可以以自有资金参与本集合计划。管理人以自有资金参与本集合计划,应符合《管理办法》、《运作规定》和监管机构的相关规定。</p> <p>(三) 自有资金参与的份额比例</p> <p>自有资金参与的份额不得超过本计划总份额的 16%。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计划总份额的 50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的,不视为管理人违反此项约定,但在客观条件允许的情况下,管理人及其附属机构应当在超标情况发生后的 10 个工作日内调整自有资金参与份额,并在调整后 5 个工作日内通过管理人网站公告告知投资者和托管机构,确保符合前述约定。</p> <p>(四) 自有资金的收益分配和责任承担方式</p> <p>管理人自有资金所持的集合资产管理计划份额,应当与投资者所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。</p> <p>(五) 自有资金的退出</p> <p>管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。自有资金参与、退出时,应提前 5 个工作日告知投资者和托管人,法律法规、监管规定或自律规则另有规定的除外。集合计划存续期间,管理人有权部分或全部退出自有资金持有份额。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规规定比例的,管理人在合理期限内安排自有资金的退出,可不受上述限制。</p> <p>管理人自有资金参与部分在出现以下情况之一时,可以退出本集合计划:</p> <p>(1) 管理人自有资金参与份额,满足参与时间不少于相关法律法规、监管机构或自律组织规定的期限时,可与其他投资者同样办理退出业务。</p> <p>(2) 管理人自有资金参与本集合计划的份额及对应的资产净值,均不得超过相关法律法规、监管机构规定的比例。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划的比例被动达到相关法律法规、监管机构规定的预警标准或者不符合规定标准的,管理人应当将部分自有资金参与份额在本集合计划开放期办理退出业务或非开放期间办理份额强制退出,以使自有资金比例在相关法律法规规定的时限内符合法规要求。法律法规另有规定时,从其规定。</p> <p>(3) 法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。</p> | <p>十六、管理人以自有资金参与、退出本计划</p> <p>(一) 自有资金参与的条件和方式</p> <p>在本集合计划初始募集期起始日至集合计划终止日内,证券期货经营机构及其子公司有权以自有资金参与本集合计划。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划,应符合《管理办法》、《运作规定》和监管机构的相关规定。参与、退出时应提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人,并取得其同意(因本计划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比例被动超标,从而被动退出超限部分自有资金的情形除外,但管理人将根据最新的监管要求进行披露),本合同另有规定的,从其规定。</p> <p>证券期货经营机构及其子公司拟在募集期以其自有资金参与本集合计划的,管理人将在本集合计划募集期销售公告中进行披露。托管人在此同意证券期货经营机构及其子公司按照管理人募集期销售公告披露的情况,以其自有资金参与本集合计划。投资者按照销售公告的安排在募集期内参与本集合计划的,即视为投资者同意证券期货经营机构及其子公司按管理人销售公告披露的情况、以其自有资金参与本集合计划。投资者在开放期内参与本集合计划的,也同样视为投资者同意证券期货经营机构及其子公司按管理人募集期销售公告中披露的情况以其自有资金参与本集合计划。</p> <p>全体投资者同意,尽管有其他约定,但集合计划存续期内当法律法规或有关针对自有资金投资集合计划的政策发生变化时,管理人经与托管人协商一致,可以按照新的法律法规或有关政策,根据本合同约定对本集合计划合同及说明书的内容进行更新或修改。</p> <p>(二) 自有资金参与的份额比例</p> <p>管理人自有资金参与的份额不得超过本计划总份额的 16%。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过计划总份额的 50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的,不视为证券期货经营机构及其子公司违反此项约定,但在客观条件允许的情况下,证券期货经营机构及其子公司应当在超标情况发生后的 10 个工作日内调整自有资金参与份额,并在调整后 5 个工作日内通过管理人网站公告告知全体投资者和托管机构,确保符合前述约定。</p> <p>中国证监会对证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例另有规定的,证券期货经营机构及其子公司将从其规定。未来监管机构对自有资金参与有新规定的,本计划将按照新规定执行。</p> <p>(四) 自有资金的收益分配和责任承担方式</p> <p>证券期货经营机构及其子公司的自有资金所持的集合资产管</p> |

为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人自有资金的参与、退出可不受前述比例和持有期限限制，但应及时告知投资者和托管人，并向相关证监会派出机构报告。

十六、管理人应定期将本计划投资者变更情况报送协会。

理计划份额，应当与投资者所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。

#### （五）自有资金的退出

管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。自有资金参与、退出时，应提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意，法律法规、监管规定、自律规则及本合同另有规定的除外。集合计划存续期间，证券期货经营机构及其子公司有权部分或全部退出自有资金持有份额。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规规定比例的，管理人在合理期限内安排自有资金的退出，可不受上述限制。

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与部分在出现以下情况之一时，可以退出本集合计划：

（1）管理人自有资金参与份额，满足参与时间不少于相关法律法规、监管机构或自律组织规定的期限时，可与其他投资者同样办理退出业务。

（2）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与本集合计划的份额及对应的资产净值，均不得超过相关法律法规、监管机构规定的比例。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划的比例被动达到相关法律法规、监管机构规定的预警标准或者不符合规定标准的，管理人应当将部分自有资金参与份额在本集合计划开放期办理退出业务或非开放期间办理份额强制退出，以使自有资金比例在相关法律法规规定的时限内符合法规要求。法律法规另有规定的，从其规定。

（3）法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。

为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司自有资金的参与、退出可不受前述比例和持有期限限制，但应及时告知投资者和托管人，并向相关证监会派出机构报告。。

十六、管理人应定期将本计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

## 第十一部分 资产管理计划的投资

|                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                             |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>一、本资产管理计划的投资目标</p> <p>管理人采取稳健的资产配置策略，通过自上而下的方法进行固收、权益、商品及金融衍生品类资产的战略及战术资产配置，在控制组合波动的基础上，提高组合的收益水平。</p>                                                                                 | <p>一、本资产管理计划的投资目标</p> <p>管理人采取稳健的资产配置策略，通过自上而下的方法进行固收、权益、期货和衍生品类资产的战略及战术资产配置，在控制组合波动的基础上，力争提高组合的收益水平。</p>                                                                                   |
| <p>二、本资产管理计划的投资范围及比例</p> <p>1、投资范围：</p> <p>（3）商品及金融衍生品类资产：股指期货、商品期货、国债期货、场内期权、商品基金（含商品期货基金和商品 ETF）；</p> <p>（4）公开募集投资基金（包括封闭式基金、开放式基金、上市开放式基金（LOF）和交易型开放式指数基金（ETF）、基础设施证券投资基金（REITs））。</p> | <p>二、本资产管理计划的投资范围及比例</p> <p>1、投资范围：</p> <p>（3）期货和衍生品类资产：股指期货、商品期货、国债期货、场内期权、期货和衍生品基金（含商品期货基金和期货 ETF）；</p> <p>（4）公开募集投资基金（包括封闭式基金、开放式基金、上市开放式基金（LOF）和交易型开放式指数基金（ETF）、基础设施证券投资基金（REITs））。</p> |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>上述各类基金均包括场内 QDII 基金, 含 QDII 股票型及混合型基金、QDII 债券型基金、QDII 商品基金。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | <p>上述各类基金均包括场内 QDII 基金, 含 QDII 股票型及混合型基金、QDII 债券型基金、QDII 商品期货基金。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| <p>2、投资比例</p> <p>(1) 本计划投资于固定收益类资产及货币市场工具的比例占本资产管理计划总资产的【80%—100%】;</p> <p>(2) 本计划投资于权益类资产的比例占本资产管理计划总资产不得超过 20%;</p> <p>(3) 本计划投资于商品及金融衍生品的衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%;</p> <p>(4) 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%;</p> <p>(5) 集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%;</p> <p>(6) 投资于同一资产的资金, 不得超过计划资产净值的 25%; 资产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;</p> <p>(7) 本计划参与股票、债券、可转换债券、可交换债券等证券发行申购时, 申报的金额不得超过集合计划的总资产, 申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量;</p> <p>(8) 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计划资产净值的 10%;</p> <p>(9) 资产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(以下简称公募基金)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%。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、公募基金, 以及中国证监会认定的其他投资组合可不受前述比例限制。本计划为【固收类】集合计划, 主要投资于【固定收益类资产及货币市场工具】构建投资资产组合, 符合《运作规定》组合投资的要求。</p> <p>本计划投资范围包含【债券正回购、存托凭证、融资融券、转融通证券出借业务】, 为提升组合收益提供了可能, 但也存在一定风险。</p> | <p>2、投资比例</p> <p>(1) 本计划投资于固定收益类资产及货币市场工具的比例不超过本计划总资产的 80%; 投资于权益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%; 投资于期货和衍生品的持仓合约价值不超过本计划总资产的 80%, 或期货和衍生品账户权益占本计划总资产的比例不超过 20%;</p> <p>(2) 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%;</p> <p>(3) 集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%;</p> <p>(4) 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净资产 50%的, 本计划总资产不得超过净资产的 120%。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的限制;</p> <p>(5) 投资于同一资产的资金, 不得超过计划资产净值的 25%; 资产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;</p> <p>(6) 本计划参与股票、债券、可转换债券、可交换债券等证券发行申购时, 申报的金额原则上不得超过集合计划的总资产, 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>(7) 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计划资产净值的 10%;</p> <p>(8) 资产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(以下简称公募基金)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%。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、公募基金, 以及中国证监会认定的其他投资组合可不受前述比例限制。</p> <p>本计划为【混合类】集合计划, 主要投资于【股票、债券、期货和衍生品】构建投资资产组合, 符合《运作规定》组合投资的要求。</p> <p>本计划投资范围包含【债券正回购、存托凭证、融资融券、转融通证券出借业务】, 为提升组合收益提供了可能, 但也存在一定风险。</p> |
| <p>三、投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>除本合同另有约定外, 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资产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, 资产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十五个交易日</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | <p>三、投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>除本合同另有约定外, 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资产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, 资产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二十个交易日内调整至符</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | <p>合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <p>五、本资产管理计划的风险收益特征：</p> <p>根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为【R3】，适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C3-C5】的普通投资者】，具体以销售机构确认的风险等级为准。</p> <p>本计划的产品风险等级仅表示管理人基于产品基本情况的一般认定，未参考单一投资者特性。为详尽了解产品风险，投资者应重点关注本合同“风险揭示”部分内容，并结合自身年龄、职业、教育经历或投资经验等个性情况进行深入理解。因各种因素影响，本资产管理计划仍有可能发生超出预期之外的损失。</p>                                                                                                                                                                                                               | <p>五、本资产管理计划的风险收益特征：</p> <p>根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为【R4】，适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C4-C5】的普通投资者】，投资者的风险承受能力等级具体以销售机构确认的为准。</p> <p>本计划的产品风险等级仅表示管理人基于产品基本情况的一般认定，未参考单一投资者特性。为详尽了解产品风险，投资者应重点关注本合同“风险揭示”部分内容，并结合自身年龄、职业、教育经历、投资目的、投资期限、资产状况、收入情况、投资经验、风险偏好、风险承受能力等个性情况进行深入理解。因各种因素影响，本资产管理计划仍有可能发生超出预期之外的损失。</p>                                                                                                                                         |
| <p>七、本资产管理计划的投资策略</p> <p>本计划采取稳健的资产配置策略，通过自上而下的方法进行固定收益类品种与权益类品种、商品及金融衍生品类资产等其他资产类别的战略及战术资产配置，在控制资产净值波动、追求收益稳定的基础上，提高组合的收益水平。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | <p>七、本资产管理计划的投资策略</p> <p>本计划采取稳健的资产配置策略，通过自上而下的方法进行固定收益类品种与权益类品种、期货和衍生品类资产等其他资产类别的战略及战术资产配置，在控制资产净值波动、追求收益稳定的基础上，力争提高组合的收益水平。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| <p>八、投资限制和投资禁止</p> <p>（一）投资限制</p> <p>为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、本计划直接投资的信用债主体评级不得低于 AA 级，无主体评级的信用债，债项评级不得低于 AA 级；</li> <li>2、本计划直接投资的单只债券的金额（以成本计算）不得超过资产管理计划净值的 25%；</li> <li>3、本计划不得直接投资于 ST、*ST、SST、S*ST 上市公司公开发行的证券；</li> <li>4、本计划直接投资的单只股票价值不得超过资产管理计划净值的 10%；</li> <li>5、本计划不得投资于资产支持证券（ABS）及资产支持票据（ABN）次级，仅可投资信用级别主体或债项评级为 AA+（含）以上的资产支持证券（ABS）及资产支持票据（ABN），其基础资产不得为资管产品或其收/受益权；</li> <li>6、大额可转让存单、通知存款的发行主体评级为银行 AA+及以上。</li> <li>7、相关法律法规、国家政策和本合同约定限制从事的其他投资。</li> </ol> | <p>八、投资限制和投资禁止</p> <p>（一）投资限制</p> <p>为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、本计划直接投资的信用债主体评级不得低于 AA 级，无主体评级的信用债，债项评级不得低于 AA 级；评级数据使用国内评级机构（不包含中债资信）；</li> <li>2、本计划不得直接投资于 ST、*ST、SST、S*ST 上市公司公开发行的股票；</li> <li>3、本计划直接投资的单只股票价值不得超过资产管理计划净值的 10%；</li> <li>4、本计划不得投资于资产支持证券（ABS）及资产支持票据（ABN）次级，仅可投资信用级别主体或债项评级为 AA+（含）以上的资产支持证券（ABS）及资产支持票据（ABN），其基础资产不得为资管产品或其收/受益权；</li> <li>5、大额可转让存单、通知存款的发行主体评级为银行 AA+及以上。</li> <li>6、相关法律法规、国家政策和本合同约定限制从事的其他投资。</li> </ol> |
| <p>（二）投资禁止行为</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>10、利用产品为集合计划委托人之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送；</li> </ol>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | <p>（二）投资禁止行为</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>10、利用产品为集合计划投资者之外的任何第三方谋取不正当利益、进行利益输送；</li> </ol>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <p>十、建仓期</p> <p>本资产管理计划的建仓期为计划成立之日起【6 个月】。建仓</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | <p>十、建仓期</p> <p>本资产管理计划的建仓期为计划成立之日起【6 个月】。建仓</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                                               |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>期的投资活动,应当符合本资产管理合同约定的投向和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。在建仓期结束后,本资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。</p> <p>本计划到期终止或提前终止前1个月为本计划变现期,管理人在变现期内可安排对计划中未变现资产提前进行变现。</p> <p>本计划存续期间,为规避特定风险并经全体投资者同意的,投资于【固定收益类资产及货币市场工具】资产的比例可以低于计划总资产80%,但不得持续6个月低于计划总资产80%,管理人应详细列明上述相关特定风险。上述相关特定风险包括但不限于以下内容:</p> <p>(1) 市场风险,指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动,导致收益水平变化,产生风险。(2) 流动性风险,资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因,不能迅速转变成现金,或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的的风险。</p> | <p>期的投资活动,应当符合本资产管理合同约定的投向和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。在建仓期结束后,本资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。</p> <p>本计划到期终止或提前终止前1个月为本计划变现期,管理人在变现期内可安排对计划中未变现资产提前进行变现。</p> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

#### 第十四部分 利益冲突及关联交易

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>(一) 关联交易及利益冲突情形</p> <p>投资者在此同意授权管理人可以将集合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关联交易,将遵循客户利益优先原则,交易完成5个工作日内,管理人应当书面通知托管人,通过管理人的网站告知投资者并向中国证监会相关派出机构报告,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,并采取切实有效的措施,防范利益冲突,保护客户合法权益。管理人承诺不以本集合计划的资金,直接或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,或与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场,包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。投资者已明确知悉并愿意承担因上述关联交易可能导致的管理人/管理人关联方双重管理及收费等事项及风险。本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形,包括但不限于:本计划可租用管理人关联方提供的证券交易单元;管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突;管理人管理的其他资管产品(包括本计划投资经理管理的其他资管产品)基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为,或者在买卖同一只证券的时间上存在先后;其他可能产生利益冲突的情况等。</p> <p>此外,管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资,该等投资也可能与本计划存在相同、</p> | <p>一、关联方范围</p> <p>资产管理计划关联方包括:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方(关联方范围按照《企业会计准则》的规定确定);</li> <li>2、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方(关联方范围按照《企业会计准则》的规定确定);</li> <li>3、法律法规、监管机构、行业协会规定的其他情形。</li> </ol> <p>管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方具体以管理人、托管人提供的关联方名单为准;在管理人收到托管人提供的关联方名单前以托管人定期报告公开市场信息等相关方式确定的名单为准。</p> <p>管理人、托管人均应事前将其关联方名单明确告知相对方,并在关联方名单更新时及时通知相对方。因一方未及时提供关联方名单导致另一方监控不及时的,由违约方承担相关责任。</p> <p>管理人已在本计划资产管理合同中披露管理人关联方名单和托管人关联方名单。具体披露方式详见资产管理合同及其附件。</p> <p>二、本计划或可产生利益冲突的关联交易情形</p> <p>关联交易是指本计划在进行投资或运作时,与关联方发生的转移资源或义务的事项,包括但不限于:</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 本计划投资于关联方发行的证券;</li> <li>(2) 本计划投资于关联方承销期内承销的证券</li> <li>(3) 本计划投资于关联方管理的资产管理产品;</li> <li>(4) 证券期货经营机构及其子公司有自有资金参与本计划;</li> <li>(5) 法律法规、监管规定、自律规则等规定为关联交易的其</li> </ol> |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。

## （二）关联交易及利益冲突的应对及处理

资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，管理人应当坚持投资者利益优先原则，从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生损害投资者利益的利益冲突时，管理人应当视具体利益冲突情形和重要程度选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对投资者利益的影响等。管理人承诺谨慎勤勉地管理资产管理计划财产、公平对待各投资组合。

他事项。

## 三、重大关联交易和一般关联交易的界定

资产管理计划的关联交易分为重大关联交易和一般关联交易。

### 1、本计划重大关联交易包括但不限于：

（1）将本计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构控股股东、实际控制人或者其它关联方发行或者承销期内承销的证券，且单笔交易金额超过人民币 3000 万元且占该资产管理计划资产净值 20%以上（不含本数）；

（2）本计划与关联方从事单笔交易金额达到或超过本计划净资产的 25%。涉及投资标的的关联交易金额按照买入/申购/认购等增加持仓的单边方向计算；

（3）有关法律法规、中国证监会、中国证券投资基金业协会等相关监管部门或自律组织规定的其他资产管理计划重大关联交易。

### 2、本计划一般关联交易包括但不限于：

（1）将本集合计划的资产投资于由管理人或其关联方发行的资产管理产品；

（2）证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划；

（3）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划；

（4）本计划与关联方从事单笔交易金额未达到本部分第 1 款第（1）、（2）的其他关联交易。

## 四、关联交易的内部管控机制及利益冲突处理方式

管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，采取有效措施，做好充分的信息披露和利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范和管控可能的利益冲突。

以资管计划的资产从事关联交易的，由管理人根据《华鑫证券资产管理业务关联交易管理办法》（或后续更新的类似管理办法或内部制度）按照以下程序进行评审：

### 1、关联交易审批程序

（1）事前管理人应履行内部适当审批程序，遵守维护投资者权益、公平和诚信以及合法性原则，按照内部制度规定由相关部门对关联交易的合法合规性以及公允性进行审核。

（2）资产管理计划从事重大关联交易的，管理人就重大关联交易提交专项报告，经公司私募资产管理业务投资决策小组表决通过。

本计划从事重大关联交易的，均应事先采取逐笔征求意见的方式取得投资者同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

本计划从事重大关联交易的，均应事先采取逐笔征求意见的方式取得投资者同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。管理人将选择通过管理人网站、短信等方式向全体投资者征询意见。若投资者不同意该笔重大关

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>联交易的,应当按照管理人通知中要求的方式并在管理人通知中限定的期限内及时向管理人明确反馈不同意的意见。</p> <p>如果投资者未按照管理人通知中要求的方式进行反馈,或未在管理人通知中限定的期限内及时反馈,或在反馈中意见表示不明确的,则均视为资者同意进行该重大关联交易。</p> <p>(3) 资产管理计划从事一般关联交易的, 应经资产管理业务投资部门、合规风控部门等相关部门审批。</p> <p>投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人以本计划资产从事一般关联交易, 资产管理人无需就此分别取得投资者的个别授权, 但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与, 公平对待受托财产, 并依据相关要求履行信息披露和监管报告义务。管理人应于一般关联交易完成后及时向投资者和托管人披露, 并向中国证监会相关派出机构报告。管理人可通过定期报告、通知或监管部门规定的其他方式向投资者和托管人披露一般关联交易。</p> <p>五、涉及利益冲突的关联交易管控机制调整</p> <p>关于关联方范围、关联交易情形、关联交易的界定、信息披露要求等约定, 如遇有关法律、法规、监管文件或管理人内部规定作出调整且与本计划合同约定不一致时, 在符合监管规定的前提下, 管理人有权自行调整关联交易管控机制, 并向投资者、托管人充分披露。如果中国证监会、中国证券基金业协会等相关监管部门或自律组织对资产管理计划关联交易另有规定的, 管理人将按照最新的监管规定执行。管理人通过管理人网站、电子邮件、邮寄或其他方式告知向投资者和托管人相关事宜, 无需另行履行合同变更程序。</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

第十五部分 投资经理的指定与变更

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>二、本计划的投资经理的资料如下:</p> <p>本计划的投资经理由【肖龙敏、周凡、赵睿】担任。</p> <p>肖龙敏</p> <p>投资总监, 南京大学经济学硕士, 8 年组合投资实盘管理经验, 专注于量化资产配置和多资产策略组合管理, 熟悉海内外各类主流投资策略。曾任万家共赢资产管理有限公司组合基金管理部投研副总监, 大类资产配置及宏观均衡系列投资经理, 负责系统性宏观对冲策略及多资产组合策略的投资管理。累计管理规模超过 30 亿元。</p> <p>取得基金从业资格, 最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。</p> <p>周凡</p> <p>投资经理, 金融工程硕士, CFA 持证人, 八年的量化研究及投资经验, 曾在财信证券担任量化投资经理, 负责量化中性策略投资及 FOF 投资, 熟悉组合多因子量化对冲策略、商品期货 CTA 策略等。</p> <p>取得基金从业资格, 最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。</p> | <p>二、本计划的投资经理的资料如下:</p> <p>本计划的投资经理由【肖龙敏、周凡、赵睿】担任。</p> <p>肖龙敏</p> <p>投资总监, 南京大学经济学硕士, 8 年组合投资实盘管理经验, 专注于量化资产配置和多资产策略组合管理, 熟悉海内外各类主流投资策略。曾任万家共赢资产管理有限公司组合基金管理部投研副总监, 大类资产配置及宏观均衡系列投资经理, 负责系统性宏观对冲策略及多资产组合策略的投资管理。累计管理规模超过 30 亿元。</p> <p>已取得基金从业资格并在基金业协会完成登记, 具备良好的诚信记录和职业操守, 且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>周凡</p> <p>投资经理, 金融工程硕士, CFA 持证人, 八年的量化研究及投资经验, 曾在财信证券担任量化投资经理, 负责量化中性策略投资及 FOF 投资, 熟悉组合多因子量化对冲策略、商品期货 CTA 策略等。</p> <p>已取得基金从业资格并在基金业协会完成登记, 具备良好的诚</p> |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>赵睿</p> <p>投资经理，利物浦大学金融数学学士，伦敦卡斯商学院数理金融与交易硕士，曾先后任职于浙江温州鹿城农商银行和华融证券固定收益部门，历任银行自营、资管投资经理和券商资管投资主办人，长期从事一线固收交易与投资工作，具有资深固定收益投资经验。</p> <p>取得基金从业资格，最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。</p> | <p>信用记录和职业操守，且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>赵睿</p> <p>投资经理，利物浦大学金融数学学士，伦敦卡斯商学院数理金融与交易硕士，曾先后任职于浙江温州鹿城农商银行和华融证券固定收益部门，历任银行自营、资管投资经理和券商资管投资主办人，长期从事一线固收交易与投资工作，具有资深固定收益投资经验。</p> <p>已取得基金从业资格并在基金业协会完成登记，具备良好的信用记录和职业操守，且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> |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 第十六部分 资产管理计划的财产

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>二、资产管理计划财产相关账户的开立和管理</p> <p>托管人按照规定开立资产管理计划财产的托管账户、证券账户，管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。管理人按照规定开立资产管理计划投资所需其他账户。证券账户和期货账户（如有）的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定，应当是“证券期货经营机构名称—托管人名称—资产管理计划名称”，具体以实际开立为准。托管人应在资产管理计划成立前将资金账户信息以邮件等书面方式通知管理人。资产管理计划财产进入银行间债券市场开展投资前，管理人应提前通知托管人，提供所需资料，由托管人以资产管理计划名义向银行间市场登记结算机构申请开立债券托管账户和资金结算账户（DVP 账户）。管理人负责以本计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表本计划进行交易。当本合同项下托管账户被有权机关查询、冻结或扣划款项时，托管人按照有权机关要求依法予以执行，因此影响托管账户资金划付的，托管人不负任何责任。冻结或扣划相关手续办理完毕后，托管人应根据业务需要通知管理人，但法律法规或监管要求另有规定的除外。托管人应为集合计划在其营业机构开立托管账户，托管账户名称为“资产管理计划名称”，具体账户名称以实际开立账户为准。托管人根据有关规定以二级户的形式为委托资产开立专门用于保管货币形式存在的委托资金及清算交收的银行账户，二级户的预留印鉴以一级账户的预留印鉴为准。该账户应遵循托管人的《单位银行结算账户管理协议》规定。托管账户由托管人负责管理，托管账户内的银行存款利息按托管人公布的活期存款利率计算。每半年或遇到重大市场调整时，如有需要，管理人及托管人可对账户利率进行重新议价。托管人应在资产管理计划成立前将托管账户信息以邮件等书面方式通知管理人。</p> | <p>二、资产管理计划财产相关账户的开立和管理</p> <p>托管人按照规定开立资产管理计划财产的托管账户、证券账户，管理人应给予必要的配合，并提供所需资料。管理人按照规定开立资产管理计划投资所需其他账户。证券账户和期货账户（如有）的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构以及证券投资基金业协会的有关规定，具体以实际开立为准。托管人应在资产管理计划成立前将资金账户信息以邮件等书面方式通知管理人。资产管理计划财产进入银行间债券市场开展投资前，管理人应提前通知托管人，提供所需资料，由托管人以资产管理计划名义向银行间市场登记结算机构申请开立债券托管账户和资金结算账户（DVP 账户）。管理人负责以本计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表本计划进行交易。当本合同项下托管账户被有权机关查询、冻结或扣划款项时，托管人按照有权机关要求依法予以执行，因此影响托管账户资金划付的，托管人不负任何责任。冻结或扣划相关手续办理完毕后，托管人应根据业务需要通知管理人，但法律法规或监管要求另有规定的除外。托管人应为集合计划在其营业机构开立托管账户，托管账户名称应当按照证券投资基金业协会有关规定命名，具体账户名称以实际开立账户为准。托管人根据有关规定以二级户的形式为委托资产开立专门用于保管货币形式存在的委托资金及清算交收的银行账户，二级户的预留印鉴以一级账户的预留印鉴为准。该账户应遵循托管人的《单位银行结算账户管理协议》规定。托管账户由托管人负责管理，托管账户内的银行存款利息按托管人公布的活期存款利率计算。每半年或遇到重大市场调整时，如有需要，管理人及托管人可对账户利率进行重新议价。托管人应在资产管理计划成立前将托管账户信息以邮件等书面方式通知管理人。</p> |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

## 第十七部分 投资指令的发送、确认和执行

|                                                                               |                                                                                |
|-------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|
| <p>（一）交易清算授权</p> <p>2、集合计划管理人向集合计划托管人发出的授权通知应加盖管理人公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代</p> | <p>（一）交易清算授权</p> <p>2、集合计划管理人向集合计划托管人发出的授权通知应加盖管理人公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表</p> |
|-------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------|

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>表签署，还应附上法定代表人的授权书。管理人以原件的方式向托管人寄送授权通知书。管理人向托管人发出授权通知后，需向托管人电话确认授权通知已收妥原件。授权通知自其载明授权的起始日期或管理人电话确认托管人已收妥原件的日期中较晚之日起生效。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | <p>签署，还应附上法定代表人的授权书。管理人以原件的方式向托管人寄送授权通知书。管理人向托管人发出授权通知后，需向托管人电话确认授权通知已收妥原件。授权通知自其载明授权的起始日期或管理人电话确认托管人已收妥原件的日期中较晚之日起生效。托管人收到的授权通知（或授权变更通知）原件的日期晚于通知中载明的生效日期，通知自托管人收到之日起生效。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| <p>（三）投资指令的发送、确认及执行时间与程序</p> <p>1、投资指令由“授权通知”确定的指令发送人员代表集合计划管理人用电子邮件、加密传真的方式或其它管理人和托管人双方确认的方式向集合计划托管人发送(管理人的传真号码为 021-54967280，邮箱地址为 qiuwq@cfsc.com.cn、liqx@cfsc.com.cn、qiuyq@cfsc.com.cn、niqin@cfsc.com.cn、luowj@cfsc.com.cn、lilt@cfsc.com.cn、zangxy@cfsc.com.cn，托管人只接受此传真号码/邮箱的划款指令。若管理人传真号码/邮箱地址变更，应提前一个工作日以书面形式告知托管人，并且获得托管行确认开始生效)。集合计划托管人依照“授权通知”中的预留印鉴样本及签字（章）样本对指令上的印鉴/签字进行一致性审核，审核无误的方可执行指令。对于指令发送人员发出的指令，集合计划管理人不得否认其效力。但如果集合计划管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权，且管理人已经以原件形式通知集合计划托管人并与托管人确认收悉的，则对于此后该指令发送人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，集合计划管理人不承担责任。如集合计划管理人撤销或更改发送至集合计划托管人时，集合计划托管人已经执行了撤销或更改之前的指令，则集合计划托管人不承担责任。</p> | <p>（三）投资指令的发送、确认及执行时间与程序</p> <p>1、投资指令由“授权通知”确定的指令发送人员代表集合计划管理人用电子邮件、加密传真的方式或其它管理人和托管人双方确认的方式向集合计划托管人发送(管理人的传真号码为 021-54967280，邮箱地址为 qiuwq@cfsc.com.cn、liqx@cfsc.com.cn、zhaoqian@cfsc.com.cn、niqin@cfsc.com.cn、luowj@cfsc.com.cn、lilt@cfsc.com.cn、zangxy@cfsc.com.cn，托管人只接受此传真号码/邮箱的划款指令。若管理人传真号码/邮箱地址变更，应提前一个工作日以书面形式告知托管人，并且获得托管行确认开始生效)。集合计划托管人依照“授权通知”中的预留印鉴样本及签字（章）样本对指令上的印鉴/签字进行一致性审核，审核无误的方可执行指令。对于指令发送人员发出的指令，集合计划管理人不得否认其效力。但如果集合计划管理人已经撤销或更改对指令发送人员的授权，且管理人已经以原件形式通知集合计划托管人并与托管人确认收悉的，则对于此后该指令发送人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，集合计划管理人不承担责任。如集合计划管理人撤销或更改发送至集合计划托管人时，集合计划托管人已经执行了撤销或更改之前的指令，则集合计划托管人不承担责任。</p> |
| <p align="center"><b>第十八部分 越权交易的界定</b></p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <p>一、越权交易的界定</p> <p>越权交易是指管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下计划份额持有人的授权而进行的投资交易行为。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | <p>一、越权交易的界定</p> <p>越权交易是指管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下计划投资者的授权而进行的投资交易行为。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| <p>二、越权交易的处理程序</p> <p>（一）违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为</p> <p>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报告监管机构。</p> <p>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、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并有权报告监管机构。</p> <p>管理人应向计划份额持有人和托管人主动报告越权交易。在限期内，计划份额持有人和托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对计划份额持有人和托管人</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                         | <p>二、越权交易的处理程序</p> <p>（一）违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为</p> <p>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报告监管机构。</p> <p>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、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并有权报告监管机构。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，托管人应报告监管机构。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告监管机构。</p> <p>(二) 越权交易的例外</p> <p>非因管理人主动投资行为导致的下列不符合投资政策的情形不构成本章所述越权交易，应当属于被动超标：</p> <p>(1) 由于管理人之外的原因导致的投资比例出现不符合本合同约定的投资政策的情形（包括但不限于证券市场波动、上市公司或发行人合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到监管机关处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等，视投资政策中的具体约定而确定），为被动超标，不属于越权交易。发生上述情形时，管理人应在发生超标涉及的相关资产可出售、可转让或可交易之日起的 15 个交易日内进行调整，以达到投资政策的要求，法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。</p>                                                                       | <p>(二) 越权交易的例外</p> <p>非因管理人主动投资行为导致的下列不符合投资政策的情形不构成本章所述越权交易，应当属于被动超标：</p> <p>(1) 由于管理人之外的原因导致的投资比例出现不符合本合同约定的投资政策的情形（包括但不限于证券市场波动、上市公司或发行人合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到监管机关处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等，视投资政策中的具体约定而确定），为被动超标，不属于越权交易。发生上述情形时，管理人应在发生超标涉及的相关资产可出售、可转让或可交易之日起的 20 个交易日内进行调整，以达到投资政策的要求，法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。</p>                                                                                                         |
| <p>三、托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>(一) 托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督：</p> <p>1. 对本计划以下投资范围和投资比例进行监督：托管人仅按照本第十八部分第（三）条“托管人对管理人投资运作的监督”的内容履行投资监督义务，若本第十八部分第（三）条“托管人对管理人投资运作的监督”与本合同其他章节约定不一致的，以本第十八部分第（三）条“托管人对管理人投资运作的监督”约定为准。</p> <p>投资范围</p> <p>(3) 商品及金融衍生品类资产：股指期货、商品期货、国债期货、场内期权、商品基金（含商品期货基金和商品 ETF）；</p> <p>(4) 公开募集投资基金（包括封闭式基金、开放式基金、上市开放式基金（LOF）和交易型开放式指数基金（ETF）、基础设施证券投资基金（REITs））；</p> <p>上述各类基金均包括场内 QDII 基金，含 QDII 股票型及混合型基金、QDII 债券型基金、QDII 商品基金。</p> | <p>三、托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>(一) 托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督：</p> <p>1. 对本计划以下投资范围和投资比例进行监督：托管人仅按照本第十八部分第三条“托管人对管理人投资运作的监督”的内容履行投资监督义务，若本第十八部分第三条“托管人对管理人投资运作的监督”与本合同其他章节约定不一致的，以本第十八部分第三条“托管人对管理人投资运作的监督”约定为准。</p> <p>投资范围</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产：股指期货、商品期货、国债期货、场内期权、期货和衍生品基金（含商品期货基金和期货 ETF）；</p> <p>(4) 公开募集投资基金（包括封闭式基金、开放式基金、上市开放式基金（LOF）和交易型开放式指数基金（ETF）、基础设施证券投资基金（REITs））；</p> <p>上述各类基金均包括场内 QDII 基金，含 QDII 股票型及混合型基金、QDII 债券型基金、QDII 商品期货基金。</p> |
| <p>投资比例</p> <p>(1) 本计划投资于固定收益类资产及货币市场工具的比例占本资产管理计划总资产的【80%—100%】；</p> <p>(2) 本计划投资于权益类资产的比例占本资产管理计划总资产不得超过 20%；</p> <p>(3) 本计划投资于商品及金融衍生品的衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%；</p> <p>(4) 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%；</p> <p>(5) 集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%；</p> <p>(6) 投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；</p> <p>资产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>投资比例</p> <p>(1) 本计划投资于固定收益类资产及货币市场工具的比例不超过本计划总资产的 80%、权益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%；投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例不超过本计划总资产的 80%，或期货和衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%；</p> <p>(2) 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%；</p> <p>(3) 集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%；</p> <p>(4) 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净资产 50%的，本计划总资产不得超过净资产的 120%。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</p>                                                                                                         |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>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；</p> <p>(7) 本计划参与股票、债券、可转换债券、可交换债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>(8) 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计划资产净值的 10%。</p> <p>本计划为【固收类】集合计划，主要投资于【固定收益类资产及货币市场工具】构建投资资产组合，符合《运作规定》组合投资的要求。</p> <p>本计划投资范围包含【债券正回购、存托凭证、融资融券、转融通证券出借业务】，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。</p>                                                       | <p>国证监会认可的投资品种不受前述规定的限制。</p> <p>(5) 投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；资产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；</p> <p>(6) 本计划参与股票、债券、可转换债券、可交换债券等证券发行申购时，申报的金额原则上不得超过集合计划的总资产，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>(7) 资产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（以下简称公募基金）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%。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、公募基金，以及中国证监会认定的其他投资组合可不受前述比例限制。</p> <p>(8) 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计划资产净值的 10%。</p> <p>本计划为【混合类】集合计划，主要投资于【股票、债券、期货和衍生品】构建投资资产组合，符合《运作规定》组合投资的要求。</p> <p>本计划投资范围包含【债券正回购、存托凭证、融资融券、转融通证券出借业务】，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。</p> |
| <p>投资限制</p> <p>1、本计划直接投资的信用债主体评级不得低于 AA 级，无主体评级的信用债，债项评级不得低于 AA 级；</p> <p>2、本计划直接投资的单只债券的金额（以成本计算）不得超过资产管理计划净值的 25%；</p> <p>3、本计划不得直接投资于 ST、*ST、SST、S*ST 上市公司公开发行的证券；</p> <p>4、本计划直接投资的单只股票价值不得超过资产管理计划净值的 10%；</p> <p>5、本计划不得投资于资产支持证券（ABS）及资产支持票据（ABN）次级，仅可投资信用级别主体或债项评级为 AA+（含）以上的资产支持证券（ABS）及资产支持票据（ABN），其基础资产不得为资管产品或其收/受益权；</p> <p>6、大额可转让存单、通知存款的发行主体评级为银行 AA+及以上。</p> <p>7、相关法律法规、国家政策约定限制从事的其他投资。</p> | <p>投资限制</p> <p>1、本计划直接投资的信用债主体评级不得低于 AA 级，无主体评级的信用债，债项评级不得低于 AA 级；评级数据使用国内评级机构（不包含中债资信）；</p> <p>2、本计划不得直接投资于 ST、*ST、SST、S*ST 上市公司公开发行的股票；</p> <p>3、本计划直接投资的单只股票价值不得超过资产管理计划净值的 10%；</p> <p>4、本计划不得投资于资产支持证券（ABS）及资产支持票据（ABN）次级，仅可投资信用级别主体或债项评级为 AA+（含）以上的资产支持证券（ABS）及资产支持票据（ABN），其基础资产不得为资管产品或其收/受益权；</p> <p>5、大额可转让存单、通知存款的发行主体评级为银行 AA+及以上。</p> <p>6、相关法律法规、国家政策约定限制从事的其他投资。</p>                                                                                                                                                                                                               |
| <p><b>第十九部分 资产管理计划财产的估值和会计核算</b></p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <p>三、估值方法</p> <p>估值坚持公允价值计量，符合本合同、《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《指导意见》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定、资产管理计划净值计价及风险控制要求及其他法律、法规、自律组织的规定，应当按照《企业会计准则第 22 号——</p>                                                                                                                                                                                                                                                     | <p>三、估值方法</p> <p>估值坚持公允价值计量，符合本合同、《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《指导意见》、《资管产品相关会计处理规定》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定、资产管理计划净值计价及风险控制要求及其他法律、法规、自律组织的规定，应当按照《企业</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>金融工具确认和计量》的规定，对以摊余成本计量的金融资产和分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产，以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | <p>会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的规定，对以摊余成本计量的金融资产和分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产，以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| <p>(二)、投资固定收益品种的估值方法</p> <p>本节所指的固定收益品种，是指在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、商业银行金融债、可转换债券、中小企业私募债、证券公司短期债、资产支持证券、非公开定向债务融资工具、同业存单等债券品种。</p> <p>1、交易所市场交易品种估值处理</p> <p>(1) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；</p> <p>(2) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值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进行估值；</p> <p>(3) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价；</p> <p>(4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券(票据)、私募债券、永续债、次级债、二级资本债，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估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值；未公开发行上市的资产支持证券(票据)、私募债券、永续债、次级债、二级资本债，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，按成本法估值。</p> <p>(5) 对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估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本法估值。</p> <p>2、首次公开发行未上市的债券，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>3、银行间市场交易品种估值处理</p> <p>(1) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相</p> | <p>(二) 投资固定收益品种的估值方法</p> <p>本节所称的固定收益品种，包括在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、可交换债券、私募债、证券公司短期债、资产支持证券、非公开定向债务融资工具、同业存单等债券投资品种，以及同业存款、债券回购等其他在活跃市场中没有报价但回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。</p> <p>1) 对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，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全价，管理人应根据相关法律、法规的规定进行涉税处理(下同)。</p> <p>2) 对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，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全价或推荐估值全价。</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>3) 对于在交易所市场上市交易的公开发行的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建议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，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>应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，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>（2）对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，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、基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方机构未提供估值价格的，按成本估值。</p> <p>5、同一债券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>管理人采用上述估值方法对固定收益品种进行估值，应被认为采用了适当的估值方法，但是如果管理人认为上述估值方法不能客观反应其公允价值的，管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，管理人可以根据具体情况与托管人商定后，按最能反应其公允价值的价格估值。</p> <p>逆回购以成本列示，按照预期收益逐日计提利息。</p> |                                                                                                                                                                                                                                              |
| <p>（三）、证券投资基金估值方法</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>（三）、证券投资基金估值方法</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；</p>                                                                                                                                                                                    |
| <p>（四）、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息，在利息到账日以实收利息入账，如有差额，不做追溯调整；</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | <p>（四）、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息，在利息到账日以实收利息入账，如有差额，不做追溯调整；逆回购以成本列示，按照预期收益率逐日计提利息。</p>                                                                                                                                                   |
| <p>（五）投资证券衍生品的估值方法</p> <p>1、国债期货、股指期货以估值日期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的结算价估值。</p> <p>2、对于股票期权合约，按照估值日结算价估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</p> <p>3、融资融券估值方法因融资融券持有或者融入的证券，应参照上述交易所上市的有价证券的估值方法进行估值，计入交易性金融资产或者负债，并每日计提融资\融券息费。</p>                                                                                                                                                                                                                             | <p>（五）投资期货和衍生品的估值方法</p> <p>1、国债期货、股指期货以估值日期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的结算价估值。</p> <p>2、对于股票期权合约，按照估值日结算价估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</p> <p>3、融资融券估值方法因融资融券持有或者融入的证券，应参照上述交易所上市的有价证券的估值方法进行估值，计入交易性金融资产或者负债，并每日计提融资\融券息费。</p> |
| <p>（九）暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其他原因暂停营业时，或因其他任何不可抗力致使管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | <p>无</p>                                                                                                                                                                                                                                     |
| <p>六、估值错误的处理</p> <p>（二）估值错误的处理原则和方法</p> <p>2. 估值错误的处理方法</p> <p>（1）管理人计算的资产管理计划净值已由托管人复核确认，但因资产估值错误给计划份额持有人造成损失的，由管理人与托管人按照过错各自承担相应的责任。因估值导致资产管理计划份额净值出现错误时，管理人应当立即纠正，并采取</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                            | <p>六、估值错误的处理</p> <p>（二）估值错误的处理原则和方法</p> <p>2. 估值错误的处理方法</p> <p>（1）管理人计算的资产管理计划净值已由托管人复核确认，但因资产估值错误给投资者造成损失的，由管理人与托管人按照过错各自承担相应的责任。因估值导致资产管理计划份额净值出现错误时，管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止</p>                                                              |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                          |      |          |        |   |     |        |     |                          |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|------|----------|--------|---|-----|--------|-----|--------------------------|
| 合理的措施防止损失进一步扩大。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 损失进一步扩大。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                          |      |          |        |   |     |        |     |                          |
| 八、暂停估值的情形<br>(五) 中国证监会和本合同认定的其它情形。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | 八、暂停估值的情形<br>(五) 当前一估值日占本集合计划资产净值【50%】以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性并经与托管人协商确认后暂停估值：<br>(六) 中国证监会和本合同认定的其它情形。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                          |      |          |        |   |     |        |     |                          |
| 十一、资产管理计划的会计政策<br>(五) 本计划财产独立建帐、独立核算；                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | 十一、资产管理计划的会计政策<br>(五) 本计划财产独立建账、独立核算；                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                          |      |          |        |   |     |        |     |                          |
| 第二十部分 资产管理计划的费用与税收                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                          |      |          |        |   |     |        |     |                          |
| 二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式<br>(一) 资产管理人的管理费<br>(2) 业绩报酬：<br>业绩报酬计提日：本计划的业绩报酬计提日为分红日、投资者退出日和计划终止日。<br>业绩报酬的计提，以上一个实际提取到业绩报酬的业绩报酬计提日（以下简称“上一个业绩报酬计提日”，如投资者该笔份额未发生业绩报酬计提，初始募集期认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内申购的，以确认当日为上一个业绩报酬计提日，下同）至本次业绩报酬计提日的期间为基准。投资者赎回时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔申购份额应收的管理人业绩报酬。<br>管理人将在销售公告中公告初始募集期内参与的集合计划份额适用的业绩报酬计提基准。存续期内，管理人可以至少在每个常规开放期前 1 个工作日公告该常规开放期参与的份额适用的业绩报酬计提基准。如果不公告的，则该常规开放期参与的份额适用最近一次公告的业绩报酬计提基准（如无最近一次公告的业绩报酬计提基准的，则为初始募集期内参与份额适用的业绩报酬计提基准）。每笔参与份额适用的业绩报酬计提基准在本计划存续期间保持不变。<br>在业绩报酬计提日，若每笔参与份额在该期间内的实际年化收益率 S 大于业绩报酬计提基准，管理人将对超过部分收益的部分分段进行计提业绩报酬，剩余部分归投资者所有。<br>其中：<br>每笔参与份额的年化收益率： $S = \frac{(C'' - C')}{C'} \times \frac{365}{D}$<br>C''：在业绩报酬计提日的该笔份额的累计单位净值；<br>C'：为上一个业绩报酬计提日该笔份额的累计单位净值；<br>C：为上一个业绩报酬计提日该笔份额的单位净值；<br>D：为本次计提业绩报酬区间天数，即该笔份额上一个业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的间隔天数；<br>H：业绩报酬计提日管理人应计提的业绩报酬；<br>Q：业绩报酬计提日投资者退出份额数或计划分红、终止时 | 二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式<br>(一) 资产管理人的管理费<br>(2) 业绩报酬：<br>业绩报酬计提日：本计划的业绩报酬计提日为分红日、投资者退出日和计划终止日。<br>业绩报酬应当从分红资金、退出资金或清算资金中提取。<br>业绩报酬的计提，以上一个实际提取到业绩报酬的业绩报酬计提日（以下简称“上一个业绩报酬计提日”，如投资者该笔份额未发生业绩报酬计提，初始募集期认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内申购的，以确认当日为上一个业绩报酬计提日，下同）至本次业绩报酬计提日的期间为基准。投资者赎回时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔申购份额应收的管理人业绩报酬。<br>在业绩报酬计提日，若每笔参与份额在该期间内的实际年化收益率 S 大于业绩报酬计提基准，管理人将对超过部分收益的部分分段进行计提业绩报酬，剩余部分归投资者所有。<br>其中：<br>每笔参与份额的年化收益率： $S = \frac{(C'' - C')}{C'} \times \frac{365}{D}$<br>C''：在业绩报酬计提日的该笔份额的累计单位净值；<br>C'：为上一个业绩报酬计提日该笔份额的累计单位净值；<br>C：为上一个业绩报酬计提日该笔份额的单位净值；<br>D：为本次计提业绩报酬区间天数，即该笔份额上一个业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的间隔天数；<br>H：业绩报酬计提日管理人应计提的业绩报酬；<br>Q：业绩报酬计提日投资者退出份额数或计划分红、终止时持有份额数；<br>业绩报酬计算方法如下： <table><tr><td>实际年化收益率 S</td><td>计提比例</td><td>业绩报酬计算方法</td></tr><tr><td>S≤6.5%</td><td>0</td><td>H=0</td></tr><tr><td>6.5%&lt;S</td><td>20%</td><td>H=Q×C×(S-6.5%)×20%×D/365</td></tr></table> 业绩报酬计提办法： | 实际年化收益率 S                | 计提比例 | 业绩报酬计算方法 | S≤6.5% | 0 | H=0 | 6.5%<S | 20% | H=Q×C×(S-6.5%)×20%×D/365 |
| 实际年化收益率 S                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 计提比例                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 业绩报酬计算方法                 |      |          |        |   |     |        |     |                          |
| S≤6.5%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 0                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | H=0                      |      |          |        |   |     |        |     |                          |
| 6.5%<S                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 20%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            | H=Q×C×(S-6.5%)×20%×D/365 |      |          |        |   |     |        |     |                          |

|               |          |                          |
|---------------|----------|--------------------------|
| 持有份额数；        |          |                          |
| 业绩报酬计算方法如下：   |          |                          |
| 实际年化<br>收益率 S | 计提<br>比例 | 业绩报酬计算方法                 |
| S≤6.5%        | 0        | H=0                      |
| 6.5%<S        | 20%      | H=Q×C×(S-6.5%)×20%×D/365 |

| 业绩报酬计提办法： | | |
| 本集合计划在分红日计提业绩报酬的，业绩报酬金额上限为分红金额；即若按照上述公式计算的业绩报酬金额大于该次分红金额的，该次业绩报酬金额以分红金额为限，超出部分管理人予以免收。 | | |
| 业绩报酬的提取频率不超过 6 个月一次，因投资者退出资产管理计划，管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受上述提取频率的限制。 | | |
| 业绩报酬的支付，由托管人根据管理人发送的业绩报酬划付指令于 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。 | | |
| 由于涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人根据管理人的划款指令进行划款。 | | |
| 业绩报酬计提基准不是预期收益或者保证收益率，不构成管理人、销售机构、托管人对委托财产收益状况的任何承诺和担保，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。 | | |
| 本集合计划在分红日计提业绩报酬的，业绩报酬金额上限为分红金额；即若按照上述公式计算的业绩报酬金额大于该次分红金额的，该次业绩报酬金额以分红金额为限，超出部分管理人予以免收。 | | |
| 业绩报酬的提取频率不超过 6 个月一次，因投资者退出资产管理计划，管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受上述提取频率的限制。 | | |
| 业绩报酬的支付，由托管人根据管理人发送的业绩报酬划付指令于 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。 | | |
| 由于涉及注册登记数据，业绩报酬的计算工作由管理人完成，托管人根据管理人的划款指令进行划款。 | | |
| 业绩报酬计提基准不是预期收益或者保证收益率，不构成管理人、销售机构、托管人对委托财产收益状况的任何承诺和担保，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。 | | |

## 第二十一部分 资产管理计划的收益与分配

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>五、收益分配的执行方式</p> <p>资产管理计划托管人根据资产管理计划管理人的收益分配方案和提供的红利金额的数据，在收益分配日根据资产管理计划管理人的划款指令进行处理。</p> <p>本集合计划的收益分配方式为投资者可选择红利再投资方式或现金分红方式。</p> <p>投资者若未进行选择，则默认分红方式为：红利再投资。</p> <p>采取现金分红方式的，在该收益分配日之日起 2 个工作日内，将现金红利划转到投资者的交易账户；采取红利再投资方式的，分红资金按分红权益登记日的份额净值转成相应的集合计划单位。</p> <p>收益分配由托管人将分红款划至管理人帐户（管理人统一分配）。收益分配方案中需载明的内容包括但不限于收益范围、分配对象、分配原则、分配时间、分配方式等。托管人依据合同约定及管理人指令，对收益分配方案中的收益范围、分配方式、分配金额等要素进行核对。若划至管理人统一分配，托管人对于收益分配方案的复核内容仅限于对收益分配的总金额进行复核，对于在不同投资者之间分配的金额、分配顺序不承担复核义务，托管人不对向受益人划转资金本息的及时性、准确性负责。</p> |  | <p>五、收益分配的执行方式</p> <p>资产管理计划托管人根据资产管理计划管理人的收益分配方案和提供的红利金额的数据，在收益分配日根据资产管理计划管理人的划款指令进行处理。</p> <p>本集合计划的收益分配方式为投资者可选择红利再投资方式或现金分红方式。</p> <p>投资者若未进行选择，则默认分红方式为：红利再投资。根据现有规则，投资者在同一销售机构处多次参与本集合计划且选择不同分红方式的，其所持有的在该销售机构处认购和申购的且未赎回的全部份额的分红方式以其最后选择的分红方式为准。</p> <p>采取现金分红方式的，在该收益分配日之日起 2 个工作日内，将现金红利划转到投资者的交易账户；采取红利再投资方式的，分红资金按分红权益登记日的份额净值转成相应的集合计划单位。</p> <p>收益分配由托管人将分红款划至管理人账户（管理人统一分配）。收益分配方案中需载明的内容包括但不限于分配对象、分配原则、分配时间、分配方式等。托管人依据合同约定及管理人指令，对收益分配方案中的分配方式、分配金额等要素进行核对。若划至管理人统一分配，托管人对于收益分配方案的复核内容仅限于对收益分配的总金额进行复核，对于在不同投</p> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | <p>投资者之间分配的金额、分配顺序不承担复核义务，托管人不对向受益人划转资金本息的及时性、准确性负责。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| <p align="center"><b>第二十二部分 信息披露与报告</b></p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| <p>二、资产管理计划运作期间，管理人应向投资者披露以下信息：</p> <p>（三）托管人履职报告</p> <p>1. 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。</p> <p>2. 管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 10 日内向管理人反馈复核意见。</p> | <p>二、资产管理计划运作期间，管理人应向投资者披露以下信息：</p> <p>（三）托管人履职报告</p> <p>1. 托管人履职报告由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。</p> <p>2. 管理人应当在每季度结束后 25 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 5 日内向管理人反馈复核意见。</p> |
| <p>三、临时报告</p> <p>（八）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划，应向投资者充分披露。</p> <p>（九）其他管理人认为的重大事项。</p>                                                                                                                                                                                                                                                   | <p>三、临时报告</p> <p>（八）其他管理人认为的重大事项。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| <p align="center"><b>第二十三部分 风险揭示</b></p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| <p>（一）一般风险揭示</p> <p>1、本金损失风险</p> <p>资产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资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。</p> <p>根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为【R3】，适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C3-C5】的普通投资者】。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。</p>                                                              | <p>（一）一般风险揭示</p> <p>1、本金损失风险</p> <p>资产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资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为【R4】，适合合格投资者中的【专业投资者和风险承受能力评估结果为【C4-C5】的普通投资者】。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。</p>                                                |
| <p>10、关联交易的风险</p> <p>经投资者同意，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。本计划可能因上述关联交易造成损失。管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行，投资者认可此等关联交易情形的存在并自愿承担相关投资风险。</p> <p>此外，管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响资产管理计划财产的投资收益。</p>                                                                                         | <p>10、关联交易的风险</p> <p>管理人可能运用资产管理计划财产从事关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、充分关注。</p> <p>托管人关联方名单由托管人提供，可能存在托管人不提供前述名单或提供的名单不完整的情形。投资者可能面临因本计划关联方名单的获取、界定、识别不准确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关重大关联交易以至于本集合计划从事前述相关重大关联交易未事先再单独征询投资者意见及其他可能的相关风险，以及投资者认知的本计划关联方、一般和重大关联交易的区分标准与管理人采用的名单和标准不完</p>                                                           |

|                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                                                           | <p>全一致的风险。</p> <p>(1) 一般关联交易的风险</p> <p>虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的区分标准,并根据重要性原则采取分层管理,但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐笔征询并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险,在此提示投资者特别注意。</p> <p>(2) 重大关联交易的风险</p> <p>管理人从事重大关联交易的,将遵循投资者利益优先原则,事先通知全体投资者并征询投资者的意见,但管理人征询的方式、投资者反馈的方式和时限均由管理人确定,可能存在投资者在管理人或销售机构留存的通讯信息(包括但不限于联系电话/手机、通讯地址、住所地、电子邮箱等)不准确、不更新的,将导致管理人无法及时通知到投资者,或发生投资者未及时查阅相关信息导致最终未及时反馈意见的风险;或发生因投资者未按照管理人通知中要求的时间和方式进行反馈、或在反馈中意见表示不明确,而被视为反馈了同意意见的情形,从而可能存在进行该笔重大关联交易与投资者主观意愿不相符的风险。另外,虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则,对重大关联交易进行事前内部审查,逐笔征询投资者意见,但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险,在此提示投资者特别注意。</p> |
| <p>(二) 特定风险揭示</p> <p>1、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险</p> <p>管理人应当在资产管理计划成立之日起五个工作日内,将资产管理合同、验资报告或者资产缴付证明等材料报证券投资基金业协会备案。资产管理计划完成备案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。若计划出现不予备案情形,可能导致本计划提前终止,请投资者注意此风险。</p> | <p>(二) 特定风险揭示</p> <p>1、资产管理计划备案相关风险</p> <p>管理人应当在资产管理计划成立之日起五个工作日内,将资产管理合同、投资者名单和认购金额、资产缴付证明等材料报证券投资基金业协会备案。若本计划不符合法律、行政法规和中国证监会规定,可能会被证券投资基金业协会要求整改规范,请投资者注意此风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 无                                                                                                                                                                                                                                                         | <p>新增条款</p> <p>23、通过第三方基金销售机构投资开放式基金的风险</p> <p>本资产管理计划可通过第三方基金销售机构投资开放式基金,资产管理人负责选择销售机构,并确保在销售机构预留的备案回款账户为银行托管账户。资产托管人对于通过第三方基金销售机构投资开放式基金不承担任何风险。</p> <p>由于通过第三方销售平台购买,可能会存在认(申)购、赎回(现金分红)基金时资金被挪用的风险;第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资者持有基金份额不准确的风险;认(申)购款未能用于购买指定基金的风险;以及第三方基金销售平台无基金销售资质的风险。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 管理人应当单独编制风险揭示书作为合同附件。投资者应充分了解并谨慎评估自身风险承受能力,并做出自愿承担风险                                                                                                                                                                                                      | 管理人应当单独编制风险揭示书,投资者应充分了解并谨慎评估自身风险承受能力,并做出自愿承担风险的陈述和声明。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 的陈述和声明。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>第二十四部分 资产管理合同的变更、终止与清算</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 二、本合同发生变更的，管理人应按照基金业协会要求及时向基金业协会备案。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | 二、本合同发生变更的，管理人应自合同变更之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <p>四、资产管理计划的展期</p> <p>（三）展期的程序与期限</p> <p>2. 投资者答复</p> <p>投资者应根据管理人指定网站上公告要求在规定的期限内明确意见。若投资者明确回复同意本集合计划展期或未回复意见的，视为同意展期；投资者明确回复不同意本集合计划展期的，视为不同意展期。</p> <p>3. 投资者不同意展期的处理办法</p> <p>若投资者明确回复不同意展期，投资者有权按照管理人公告内容在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续或按本合同规定办理集合计划份额转让手续；若投资者未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理本计划份额退出、转让手续，则由管理人决定对上述份额于存续期届满之日做自动退出处理。若投资者未回复意见或回复意见不明确的，并未在上述期限内办理转让或退出手续，视为不同意展期，管理人不再另行通知确认。</p> | <p>四、资产管理计划的展期</p> <p>（三）展期的程序与期限</p> <p>2. 投资者答复</p> <p>投资者应根据管理人指定网站上公告要求在规定的期限内明确意见。若投资者明确回复同意本集合计划展期或未回复意见或回复意见不明确的，视为同意展期；投资者明确回复不同意本集合计划展期的，视为不同意展期。</p> <p>3. 投资者不同意展期的处理办法</p> <p>若投资者明确回复不同意展期，投资者有权按照管理人公告内容在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续或按本合同规定办理集合计划份额转让手续；若投资者未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理本计划份额退出、转让手续，则由管理人决定对上述份额于存续期届满之日做自动退出处理。若投资者未回复意见或回复意见不明确的，并未在上述期限内办理转让或退出手续，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。</p> |
| <p>七、资产管理计划的清算</p> <p>（四）资产管理计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>1. 本计划终止时已计提但尚未支付的管理费、托管费等，经清算小组复核后从清算财产中支付。</p> <p>2. 依据资产管理计划财产清算的分配方案，将计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后，按本计划投资者持有的计划份额比例以现金形式进行分配，本合同另有约定的除外。</p>                                                                                                                                                                                                | <p>七、资产管理计划的清算</p> <p>（四）资产管理计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>1. 资产管理计划财产按如下顺序进行清偿：</p> <p>（1）支付资产管理计划财产清算费用；</p> <p>（2）缴纳资产管理计划所欠税款；</p> <p>（3）清偿资产管理计划债务；</p> <p>（4）清算后如有余额，按资产管理计划份额持有人持有的资产管理计划份额比例进行分配并分别扣除应计提业绩报酬（如有）。</p> <p>2. 依据资产管理计划财产清算的分配方案，将计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用后，按本计划投资者持有的计划份额比例原则上以现金形式进行分配，本合同另有约定的除外。</p>                                                                                  |
| <p>（六）资产管理计划财产清算报告的告知安排</p> <p>清算小组在本计划终止后20个工作日内编制计划财产清算报告，由管理人或销售机构按照投资者提供的联系方式或由管理人通过其公司网站告知投资者。投资者在此同意，上述报告不再另行审计，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。</p> <p>管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算结果报基金业协会备案。</p>                                                                                                                                                                                                    | <p>（六）资产管理计划财产清算报告的告知安排</p> <p>清算小组在本计划终止后20个工作日内编制计划财产清算报告，由管理人或销售机构按照投资者提供的联系方式或由管理人通过其公司网站告知投资者。投资者在此同意，上述报告不再另行审计，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算报告报基金业协会备案。</p>                                                                                                                                                                                                                   |
| <b>第二十五部分 违约责任</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 一、本合同当事人违反合同，应当承担违约责任。给其他当事人造成经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 一、本合同当事人违反合同，应当承担违约责任。给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>二、管理人、托管人及其他第三方机构在履行各自职责的过程中，因违反法律法规或者本合同约定，给计划财产或者投资者造成损害的，应按过错原则分别对各自的行为承担赔偿责任。</p> <p>发生下列情况的，当事人可以免责：</p> <p>（一）不可抗力；</p> <p>（二）管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；</p> <p>（三）管理人由于按照本合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；</p> <p>（四）因投资者采信其他机构或人员作出的与本合同记载内容不符或相冲突的意思表示而造成的损失等；</p> | <p>二、管理人、托管人及其他第三方机构在履行各自职责的过程中，因违反法律法规或者本合同约定，给计划财产或者投资者造成损害的，应按过错原则分别对各自的行为承担赔偿责任。</p> <p>发生下列情况的，当事人可以免责：</p> <p>（一）不可抗力；</p> <p>（二）管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；</p> <p>（三）管理人由于按照本合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；</p> <p>（四）托管人对于存放在托管人之外的委托财产的任何损失，及资产管理计划管理人、资产管理计划托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、中登公司、中国期货市场监控中心等）发送或提供的数据错误给本集合计划资产造成的损失等；</p> |
| <p>六、本合同一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。</p>                                                                                                                                                                                                                                                | <p>六、本合同一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接经济损失。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

## 第二十七部分 资产管理合同的效力

|                                                                                                                        |                                                                                                                             |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>一、资产管理合同签署的方式</p> <p>本合同以电子签名方式签署，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者作为本合同一方，以电子签名或纸质方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款。</p> | <p>一、资产管理合同签署的方式</p> <p>本合同以电子签名方式或纸质合同签署，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者作为本合同一方，以电子签名或纸质方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款。</p> |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

### 附件一：专用清算账户及资金划拨专用账户

|                                                                   |                                                                                                                                 |
|-------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>托管账户</p> <p>户名：华鑫证券全天候明珠1号集合资产管理计划</p> <p>账号：</p> <p>开户银行：</p> | <p>托管账户</p> <p>户名：华鑫证券全天候明珠1号集合资产管理计划</p> <p>账号：709701220000220540077</p> <p>开户银行：宁波银行股份有限公司上海分行</p> <p>大额支付行号：313290010012</p> |
|-------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

### 附件二：管理人关联方名单

|                            |              |                                                 |                            |              |                                                 |
|----------------------------|--------------|-------------------------------------------------|----------------------------|--------------|-------------------------------------------------|
| <p>华鑫证券有限责任公司主要关联关系信息表</p> |              |                                                 | <p>华鑫证券有限责任公司主要关联关系信息表</p> |              |                                                 |
| <p>持有本公司 5%以上股份的股东情况</p>   |              |                                                 | <p>持有本公司 5%以上股份的股东情况</p>   |              |                                                 |
| 序<br>号                     | 名称           | 营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构）/身份证号（个人）/护照号（外籍个人） | 序<br>号                     | 名称           | 营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构）/身份证号（个人）/护照号（外籍个人） |
| 1                          | 上海华鑫股份有限公司   | 9131000013220382XX                              | 1                          | 上海华鑫股份有限公司   | 9131000013220382XX                              |
| <p>本公司的控股股东情况</p>          |              |                                                 | <p>本公司的控股股东情况</p>          |              |                                                 |
| 1                          | 上海华鑫股份有限公司   | 9131000013220382XX                              | 1                          | 上海华鑫股份有限公司   | 9131000013220382XX                              |
| <p>本公司的控股股东控制的其他子公司情况</p>  |              |                                                 | <p>本公司的控股股东控制的其他子公司情况</p>  |              |                                                 |
| 序<br>号                     | 名称           | 营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构）                    | 序<br>号                     | 名称           | 营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构）                    |
| 1                          | 上海金欣联合发展有限公司 | 91310101132352737T                              | 1                          | 上海金欣联合发展有限公司 | 91310101132352737T                              |
| 2                          | 上海金陵投资有限公司   | 91310115132310625R                              | 2                          | 上海金陵投资有限公司   | 91310115132310625R                              |

|                              |                     |                              |                              |                   |                              |
|------------------------------|---------------------|------------------------------|------------------------------|-------------------|------------------------------|
| 3                            | 上海择励实业有限公司          | 91310230057678883Q           | 3                            | 上海择励实业有限公司        | 91310230057678883Q           |
| 4                            | 上海普林电路板有限公司         | 310104000015714              | 4                            | 上海鑫敦实业有限公司        | 9131023008009785XR           |
| 5                            | 上海普林电子有限公司          | 310000400435444              | 5                            | 上海力敦行房地产经纪有限公司    | 91310115787820407L           |
| 6                            | 上海鑫敦实业有限公司          | 9131023008009785XR           | 6                            | 华鑫思佰益融资租赁（上海）有限公司 | 91310000MA1FL02T7J           |
| 7                            | 上海力敦行房地产经纪有限公司      | 91310115787820407L           | 7                            | 上海鑫之众投资管理有限公司     | 91310000MA1FL3EG5U           |
| 8                            | 华鑫思佰益融资租赁（上海）有限公司   | 91310000MA1FL02T7J           | 8                            | 上海全创信息科技有限公司      | 91310104MA1FRJB1XP           |
| 9                            | 上海鑫之众投资管理有限公司       | 91310000MA1FL3EG5U           | 9                            | 天津东疆基金管理有限公司      | 91120118MA06EA4NX9           |
| 10                           | 上海全创信息科技有限公司        | 91310104MA1FRJB1XP           | 本公司的控股子公司及本公司能够实施重大影响的其他公司情况 |                   |                              |
| 11                           | 烟台山基金小镇（烟台）运营管理有限公司 | 91370602MA3QWYREXU           | 序 号                          | 名称                | 营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构） |
| 12                           | 天津东疆基金管理有限公司        | 91120118MA06EA4NX9           | 1                            | 华鑫期货有限公司          | 91310000132110746J           |
| 本公司的控股子公司及本公司能够实施重大影响的其他公司情况 |                     |                              | 2                            | 华鑫证券投资有限公司        | 913100000841449245           |
| 序 号                          | 名称                  | 营业执照号/统一社会信用代码（机构）/注册号（境外机构） | 3                            | 华鑫宽众投资有限公司        | 91310000351133569C           |
| 1                            | 华鑫期货有限公司            | 91310000132110746J           | 4                            | 摩根士丹利证券（中国）管理有限公司 | 913100007178847982           |
| 2                            | 华鑫证券投资有限公司          | 913100000841449245           | 5                            | 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司   | 91440300746637454W           |
| 3                            | 华鑫宽众投资有限公司          | 91310000351133569C           |                              |                   |                              |
| 4                            | 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司     | 913100007178847982           |                              |                   |                              |
| 5                            | 摩根士丹利华鑫基金管理有限公司     | 91440300746637454W           |                              |                   |                              |

附件三：托管人关联方名单

| 名称                | 关联关系 | 公司名称           | 关联关系 |
|-------------------|------|----------------|------|
| 宁波开发投资集团有限公司      | 主要股东 | 宁波开发投资集团有限公司   | 主要股东 |
| 新加坡华侨银行有限公司       | 主要股东 | 新加坡华侨银行有限公司    | 主要股东 |
| 雅戈尔集团股份有限公司       | 主要股东 | 雅戈尔集团股份有限公司    | 主要股东 |
| 华茂集团股份有限公司        | 主要股东 | 永赢金融租赁有限公司     | 子公司  |
| 香港中央结算有限公司        | 主要股东 | 永赢基金管理有限公司     | 子公司  |
| 宁波富邦控股集团有限公司      | 主要股东 | 永赢资产管理有限公司     | 子公司  |
| 新加坡华侨银行有限公司（QFII） | 主要股东 | 浙江永欣资产管理有限公司   | 子公司  |
| 宁兴（宁波）资产管理有限公司    | 主要股东 | 永赢国际资产管理有限公司   | 子公司  |
| 宁波市轨道交通集团有限公司     | 主要股东 | 宁银理财有限责任公司     | 子公司  |
| 中央汇金资产管理有限责任公司    | 主要股东 | 浙江宁银消费金融股份有限公司 | 子公司  |
| 永赢基金管理有限公司        | 子公司  |                |      |
| 永赢金融租赁有限公司        | 子公司  |                |      |
| 宁银理财有限责任公司        | 子公司  |                |      |

#### 附件四：预留印鉴授权书

华鑫证券有限责任公司（作为管理人）、宁波银行股份有限公司（作为托管人）已签署编号为【HXZQQTH-2022 第 1 号】的《华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划资产管理合同》。以下为管理人的预留印鉴，该印鉴用于集合资产管理业务运作过程中用于业务往来确认所盖印章的预留印鉴。

管理人预留印鉴

(用章样本)

上述预留印鉴如需更换，应提供加盖管理人公章的新的预留印鉴样本。新的预留印鉴样本相应替代原有预留印鉴样本。未提供加盖公章的新预留印鉴样本的，预留印鉴不得更换。

管理人：华鑫证券有限责任公司（公章）

法定代表人或其授权签字人（签字或盖章）：

年 月 日

华鑫证券有限责任公司（作为管理人）、宁波银行股份有限公司（作为托管人）已签署编号为【HXZQQTH-2022 第 1 号-XD1】的《华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划资产管理合同》。以下为管理人的预留印鉴，该印鉴用于集合资产管理业务运作过程中用于业务往来确认所盖印章的预留印鉴。

管理人预留印鉴

(用章样本)

上述预留印鉴如需更换，应提供加盖管理人公章的新的预留印鉴样本。新的预留印鉴样本相应替代原有预留印鉴样本。未提供加盖公章的新预留印鉴样本的，预留印鉴不得更换。

管理人：华鑫证券有限责任公司（公章）

法定代表人或其授权签字人（签字或盖章）：

年 月 日

#### 附件五：投资监督事项表

资产管理人向资产托管人发送投资指令的指定邮箱如下：

qiuwq@cfsc.com.cn

2、niqin@cfsc.com.cn

3、luowj@cfsc.com.cn

4、zangxy@cfsc.com.cn

5、lilt@cfsc.com.cn

资产管理人向资产托管人发送投资指令的指定邮箱如下：

qiuwq@cfsc.com.cn

2、gaoxy@cfsc.com.cn

3、luowj@cfsc.com.cn

4、zangxy@cfsc.com.cn

5、lilt@cfsc.com.cn

6、liqx@cfsc.com.cn

7、zhaoqian@cfsc.com.cn

#### 附件六：华鑫证券直销渠道募集结算资金归集专用账户信息告知书

尊敬的投资者：

华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划投资者通过【管理人直销渠道】申购本集合资产管理计划的，基金投资者应当将申购款以其境内开立的银行账户划款至【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户。本集合资产管理计划【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户由管理人委托运营服务机构开立，该账户仅用于华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划存续期间【管理人直销渠道】申购和赎回资金的统一归集与支付。

【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户信息如下：

账户名：

账号：

开户行：

大额支付号：

尊敬的投资者：

华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划投资者通过【管理人直销渠道】申购本集合资产管理计划的，基金投资者应当将申购款以其境内开立的银行账户划款至【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户。本集合资产管理计划【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户由管理人委托运营服务机构开立，该账户仅用于华鑫证券全天候明珠 1 号集合资产管理计划存续期间【管理人直销渠道】申购和赎回资金的统一归集与支付。

【管理人直销渠道】募集结算资金归集专用账户信息如下：

账户名：华鑫证券有限责任公司

账号：6232593599000009370

开户行：广发银行上海徐汇支行

大额支付号：306290003526

#### 三、本计划托管人对本次合同变更的意见

托管人宁波银行股份有限公司同意本次合同变更事宜，请参见《关于华鑫证券全天候明珠 1 号集合资

资产管理计划资产管理合同第一次变更的征询函及回函》。

#### 四、向全体投资者征询意见及后续安排

根据《华鑫证券全天候明珠1号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXZQQTH-2022第1号）

#### 第二十四部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算中第一条第3点

“除前文第1项、第2项所述之外的其余事项如需发生变更的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以管理人指定网站公告或邮寄等方式向投资者发送合同变更征询意见函。投资者不同意变更的，应在征询意见函发出后的最近一个开放期或管理人设置的合同变更临时开放期内（以下统称“指定开放期”）提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意合同变更。投资者不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

投资者不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划份额净值）。”之约定。

本征询意见函及临时开放期设置公告将通过管理人网站公告向各投资者征询意见。我司将设置临时开放期合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利，临时开放期为2023年6月6日，1个工作日。

投资者应在临时开放期内以邮件形式回复意见并发送至我司邮箱：zcglb@cfsc.com.cn

投资者不同意变更的，应在2023年6月6日内提出退出本集合计划的申请；投资者未在指定日期内即临时开放期内回复意见或未在指定日期内提出退出本集合计划申请的，视为投资者不同意合同变更，管理人有权在征询意见函或公告中规定的意见回复期限届满后将相关份额强制退出本计划，由此产生的相关税费或者损失由委托人自行承担。如投资者同意变更，则变更事项自征询意见函（或通知）指定的日期届满的下一工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。

#### 五、合同变更的效力及生效时间

本征询意见函及临时开放期设置公告构成变更后合同的组成部分，变更后的合同将于2023年6月7日（含）正式生效。

如有疑问，请拨打客服热线：95323。

特此公告。

