

关于西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划

资产管理合同变更的公告

尊敬的西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划投资者：

为更好满足投资者需求，经与托管人兴业银行股份有限公司协商，我司作为西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划管理人，拟对《西部证券安盈泓利6月期1号集合资产管理计划资产管理合同（第一次修订）》（以下简称“《资产管理合同》”）中的相关条款进行变更。具体变更方案如下：

一、 合同变更的主要内容

标题	变更前	变更后
	根据修订后的《资管规定》及配套文件，更新与管理人向协会、证监会及其相关派出机构等监管部门或自律组织的备案/报告工作安排相关的内容。	
	更新涉及法律法规的名称及文号	
第一部分 前言	三、…… 投资者保证委托资产的来源及用途合法，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。	三、…… 投资者保证委托资产的来源及用途合法，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，投资者阅知本合同及附件全文，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。
第一部分 前言	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	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

	<p>投资者为合格投资者,并配合提供相关证明材料。</p> <p>.....</p>	<p>投资者为合格投资者,并配合提供相关证明材料。</p> <p>投资者承诺,如委托资金为资产管理产品募集的资金时,将确保资产管理产品的投资者中不包含其他资产管理产品。如委托资金为除公募资产管理产品外的合伙企业、契约等非法人形式,最终投资者满足法律法规、监管规则规定的合格投资者要求,并向管理人提供合法募集资金的证明文件、充分披露实际投资者和最终资金来源,保证所提供证明文件真实、准确、完整、合法。</p> <p>.....</p>
<p>第三部分 承诺与声明</p>		<p>增加:</p> <p>四、本合同当事人承诺:各方都清楚并愿意严格遵守中华人民共和国有关反商业贿赂的法律规定和廉洁从业的行业规范以及行业普遍遵守的职业道德和行为准则,坚决拒绝商业贿赂、行贿及其他不正当之商业行为及违反廉洁从业的行为,各方都清楚任何违反廉洁自律要求的行为都将受到惩处;各方及其工作人员或委托人员均不得利用职务便利向其他方及其工作人员或委托人员索要、收受、提供、给予合同约定外的任何利益,既包括金钱利益和实物利益,也包括可以用金钱计算数额的财产性利益;如一方工作人员或其委托人员主动向其他方索(行)贿或索取(给予)不正当利益,被索方(被给予方)有权向其内部相关职能部门或向相关行政主管部门实名举报,并提供相关证据,配合该方对其工作人员或委托人员的查处;若一方违反前述承诺需承担法律后果,同时其他方有权采取如下措施追究其相应责任:(1)立即终止本合同且无需承担违约责任;(2)向任何</p>

		<p>第三方披露、或向社会公开其违法违规行为；</p> <p>(3) 提请行政主管部门依法追究其行政责任，或提请司法机关依法追究其刑事责任。</p>
<p>第四部分 当事人的权利与义务</p> <p>一、合同当事人</p> <p>(二) 管理人</p>	<p>名称:西部证券股份有限公司</p> <p>住所:陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室</p> <p>法定代表人:徐朝晖</p> <p>联系人:吕珂忻</p> <p>通讯地址:陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室</p> <p>联系电话:021-68867065</p> <p>传真号码:021-68866317</p> <p>网址:www.west95582.com</p>	<p>名称:西部证券股份有限公司</p> <p>住所:陕西省西安市新城区东大街319号8幢10000室</p> <p>法定代表人:徐朝晖</p> <p>联系人:吕珂忻</p> <p>通讯地址:上海市浦东新区耀体路276号1501室-1508室</p> <p>联系电话:021-68867065</p> <p>传真号码:021-68866317</p> <p>网址:www.west95582.com</p>
<p>第四部分 当事人的权利与义务</p> <p>二、合同当事人</p> <p>(三) 托管人</p>	<p>名称:兴业银行股份有限公司</p> <p>住所:福州市湖东路154号</p> <p>法定代表人:吕家进</p> <p>联系人:曾思绮</p> <p>通讯地址:上海市浦东新区银城路167号4楼</p> <p>联系电话:021-52629999</p> <p>传真号码:</p> <p>网站:www.cib.com.cn</p>	<p>名称:兴业银行股份有限公司</p> <p>住所:福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦</p> <p>法定代表人:吕家进</p> <p>联系人:林诗琪</p> <p>通讯地址:上海市浦东新区银城路167号</p> <p>联系电话:021-52629999</p> <p>传真号码:021-62535823</p> <p>网站:www.cib.com.cn</p>
<p>第四部分 当事人的权利与义务</p> <p>六、管理人的义务包括但不限于:</p>		<p>增加:</p> <p>(二十七) 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>(二十八) 除必要的信息披露及监管要求外,管理人不得以托管人的名义进行营销宣传;</p>
<p>第四部分 当事人的权利与义务</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>(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>第五部分 本计划的基本情况</p> <p>1、本计划的基本情况</p> <p>(四)本计划的投资目标</p> <p>第十一部分 资产管理计划的投资</p> <p>一、本资产管理计划的投资目标</p>	<p>本集合计划主要资产投资于固定收益类金融工具，在严格控制风险的基础上，通过对全球经济形势、中国经济发展（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况）、证券市场估值水平等的研判，动态调整计划各类资产的投资比例，力争为计划资产获取稳健回报。</p>	<p>本集合计划主要资产投资于固定收益类金融工具，在严格控制风险的基础上，通过动态调整计划各类资产的投资比例，力争为计划资产获取投资回报。</p>
<p>第五部分 本计划的基本情况</p> <p>一、本计划的基本情况</p> <p>(五)本计划的投资范围</p> <p>第十一部分 资产管理计划的投资</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>第十八部分 越权交易的界定</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：</p>	<p>本集合计划主要投资于固定收益类资产，包括国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债券）、短期融资券（含超短融）、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、资产支持票据、债券型公募基金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款、活期存款等各类存款）、债券回购（包括债券正回购和债券逆回购）、同业存单、货币市场基金等中国证监会认可的固定收益类品种。</p> <p>如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p>	<p>本集合计划主要投资于固定收益类资产，包括国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债券）、短期融资券（含超短融）、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、资产支持票据、债券型公募基金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款、活期存款等各类存款）、债券回购（包括债券正回购和债券逆回购）、同业存单、货币市场基金等中国证监会认可的固定收益类品种。</p> <p>资产管理产品，包括商业银行及商业银行理财子公司发行的公开募集银行理财产品。</p> <p>本计划所投资的可转换债券、可交换债券不进行转股操作。</p> <p>如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p>

<p>投资范围：</p>		
<p>第五部分 本计划的基本情况</p> <p>一、本计划的基本情况</p> <p>(六)本计划的投资比例</p> <p>第十一部分 资产管理计划的投资</p> <p>二、本资产管理计划的投资范围及比例</p> <p>2、投资比例</p> <p>第十八部分 越权交易的界定</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：</p> <p>投资比例：</p>	<p>(4) 本集合计划投资于同一资产的资金，不超过本集合计划资产净值的 25%；本集合计划参与债券发行申购时，所申报的金额不超过本集合计划的总资产，所申报的数量不超过拟发行公司本次发行的总量。</p>	<p>(4) 本集合计划投资于同一资产的资金，不超过本集合计划资产净值的 25%，资产管理人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；本集合计划参与债券发行申购时，所申报的金额不超过本集合计划的总资产，所申报的数量不超过拟发行公司本次发行的总量。</p>
<p>第五部分 本计划的基本情况</p> <p>一、本计划的基本情况</p> <p>(六)本计划的投资比例</p>	<p>……</p> <p>投资者同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。交易完成 5 个工作日内，管理人应通过管理人指定网站公告告知投资者和托管人，并向证券交易所、证券投资基金业协会以及中国证监会相关派出机构报告。并采取切实有效措施，防范利</p>	<p>删除。</p>

	益冲突，保护客户合法权益。	
<p>第五部分 本计划的基本情况</p> <p>一、本计划的基本情况</p> <p>(六)本计划的投资比例</p>	<p>本集合计划建仓期为6个月。除变现期外，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。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15个交易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和证券投资基金业协会报告。</p>	<p>本集合计划建仓期为6个月。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20个交易日内调整至符合相关要求，法律法规另有规定的按其规定。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。</p>
<p>第六部分 本计划的募集</p> <p>一、本计划的募集对象</p>	<p>……</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)基本养老保险、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>……</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)基本养老保险、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>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，仅适合向风险承受能力等级为C3及高于C3的投资者推广，具体以销售机构确认的风险等级为准。</p>	<p>(六)中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> <p>因本计划投资范围中包含除公募基金以外的其他资管产品，因此不接受投资者以其管理的资产管理产品投资于本资产管理计划。</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，仅适合向风险承受能力等级为C3及高于C3的投资者推广，具体以销售机构确认的风险等级为准。</p>
<p>第六部分 本计划的募集</p>		<p>增加：</p> <p>十、投资者服务</p> <p>(一) 信息查询服务</p> <p>投资者可以通过管理人网站 www.west95582.com，查询本集合计划相关信息披露。具体披露信息及内容详见第二十三部分信息披露与报告。</p> <p>(二) 投诉及建议受理服务</p> <p>投资人可以通过基金管理人客户服务中心人工热线 95582 及各销售机构网点柜台等不同的渠道对管理人和销售网点所提供的服务进行投诉或提出建议。</p>
<p>第八部分 本计划的参与、退出与转让</p> <p>七、参与和退出的费用</p>	<p>2、退出费</p> <p>投资者申请退出本集合计划时，需缴纳退出费用，且退出费用全部归入集合计划资产。</p> <p>退出费用 = $\text{Max} \left\{ N \times P_0^* \times (R - R^*) \times W \times \frac{D}{365}, 0 \right\}$</p> <p>其中，N 为退出份额数，$P_0^*$ 为退出份额参与日的集合计划单位净值，R 为退出份额持有期间的年化收益率，R^* 为退出份额适用的业绩报酬计提基准，D 为退出份额的持有天数；W 为与持有天数挂钩的退出费用提取比</p>	<p>2、退出费</p> <p>本计划不收取退出费用。</p>

	<p>例，具体如下：</p> <table border="1" data-bbox="405 253 922 712"> <thead> <tr> <th>持有天数</th> <th>退出费用提取比例</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>D<273 天</td> <td>30%</td> </tr> <tr> <td>273 天≤D<364 天</td> <td>25%</td> </tr> <tr> <td>364 天≤D<546 天</td> <td>20%</td> </tr> <tr> <td>546 天≤D<728 天</td> <td>15%</td> </tr> <tr> <td>D≥728 天</td> <td>0</td> </tr> </tbody> </table>	持有天数	退出费用提取比例	D<273 天	30%	273 天≤D<364 天	25%	364 天≤D<546 天	20%	546 天≤D<728 天	15%	D≥728 天	0	
持有天数	退出费用提取比例													
D<273 天	30%													
273 天≤D<364 天	25%													
364 天≤D<546 天	20%													
546 天≤D<728 天	15%													
D≥728 天	0													
<p>第八部分 本计划的参与、退出与转让</p> <p>十、巨额退出和连续巨额退出</p> <p>(三) 告知客户方式</p>	<p>当发生巨额退出、连续巨额退出时，管理人应当及时告知投资者。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。</p>	<p>当发生巨额退出、连续巨额退出并采用超额部分延期退出或者发生暂停退出情形时，管理人应当及时告知投资者。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。</p>												
<p>第八部分 本计划的参与、退出与转让</p> <p>十六、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</p> <p>管理人以自有资金参与本计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司相关授权程序的批准。</p> <p>(二) 自有资金的参与方式</p> <p>管理人在推广期和存续期内可以以自有资金参与本计划。</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 15%。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，管理人应当依照中国证监会规定及本合同约定及时调整达标。</p> <p>(四) 自有资金的收益分配</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</p>	<p>(一) 自有资金参与的条件</p> <p>证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司相关授权程序的批准。</p> <p>(二) 自有资金的参与方式</p> <p>证券期货经营机构及其子公司在推广期和存续期内可以以自有资金参与本计划。</p> <p>(三) 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 15%。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%，中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，证券期货经营机构及其子公司应当依照中国证监会规定及本合</p>												

等权益、承担同等风险。

(五) 自有资金的责任承担

管理人以自有资金所持的本计划份额,与其他份额持有人所持的同类计划份额享有同等权益、承担同等风险。

(六) 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个工作日告知投资者和托管人。

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及协会报告。此处管理人自有资金的参与、退出并非管理人的法定或者合同约定义务,管理人享有最终选择权。

同约定及时调整达标,管理人无需事先告知和征询投资者及托管人,但事后应及时告知投资者及托管人,并向中国证监会相关派出机构报告。

(四) 自有资金的收益分配

证券期货经营机构及其子公司以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。

(五) 自有资金的责任承担

证券期货经营机构及其子公司以自有资金所持的本计划份额,与其他份额持有人所持的同类计划份额享有同等权益、承担同等风险。

(六) 自有资金的参与及退出程序

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。投资者和托管人签署本合同即视为其同意初始募集期内证券期货经营机构及其子公司可以自有资金参与本集合计划。本计划存续期间,证券期货经营机构及其子公司拟于开放期以自有资金参与、退出本集合计划的,管理人应提前5个工作日以邮件方式征询托管人并取得其同意,并通过管理人网站公告方式征询投资者。如果投资者和托管人未在征询发出后的3个工作日内提出异议的,应视为同意上述自有资金参与和退出本集合计划的安排。若投资者不同意的,可于公告日至上述自有资金参与和退出本集合计划日(含)之间的退出开放日退出本集合计划。如上述期间内无退出开放日,则管理人将上述自有资金参与和退出本集合计划当日设置为临时退出开放日,保障投资者退出的权利。逾期未退出且未有意见答复的以及答复不同意但逾期未退出的投资者,均视为同意上述自有资

		<p>金的参与和退出安排。</p> <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，证券期货经营机构及其子公司以自有资金的参与、退出可不受前述比例和持有期限限制，管理人无需事先告知和征询投资者及托管人，但应及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>此处证券期货经营机构及其子公司自有资金的参与、退出并非其法定或者合同约定义务，不构成对自有资金参与、退出的承诺，证券期货经营机构及其子公司享有最终选择权。</p>
<p>第十一部分 资产管理计划的投资</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和证券投资基金业协会报告。</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合相关要求，法律法规另有规定的按其规定。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>第十一部分 资产管理计划的投资</p>		<p>增加</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>本集合计划不设置业绩比较基准。</p>
<p>第十一部分 资产管理计划的投资</p> <p>六、本资产管理计划的投资策略</p> <p>2、债券投资策略：</p>	<p>(4) 资产支持证券投资策略</p> <p>基于对发行主体和资产支持证券风险收益特征的考察，通过对抵押的资产质量和现金流特征的研究，分析资产支持证券可能出现的提前偿付比例和违约率，选择具有投资价</p>	<p>(4) 资产支持证券及资产支持票据投资策略</p> <p>基于对发行主体和资产支持证券及资产支持票据风险收益特征的考察，通过对抵押的资产质量和现金流特征的研究，分析资产支持证券及资产支持票据可能出现的提前偿付比</p>

	<p>值的资产支持证券投资。本计划将会严格控制资产支持证券的投资比例，并且分散投资。</p>	<p>例和违约率，选择具有投资价值的资产支持证券投资及资产支持票据。本计划将会严格控制资产支持证券及资产支持票据的投资比例，并且分散投资。</p>
<p>第十一部分 资产管理计划的投资 六、本资产管理计划的投资策略</p>	<p>3、现金类资产投资策略</p> <p>本集合计划将在确定总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、银行存款的期限、债券逆回购的预期收益率来确定现金类资产的配置，并定期对现金类资产组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。</p>	<p>3、银行存款、货币市场基金、债券逆回购等现金类资产投资策略</p> <p>本集合计划将在确定总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、银行存款的期限、债券逆回购的预期收益率来确定现金类资产的配置，并定期对现金类资产组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。</p>
<p>第十一部分 资产管理计划的投资 六、本资产管理计划的投资策略</p>		<p>增加：</p> <p>5、商业银行理财产品投资策略</p> <p>本集合计划可投资于商业银行及商业银行理财子公司发行的公开募集银行理财产品，通过管理人对宏观经济和金融市场的分析判断制定资产配置方案，建立银行理财产品池作为投资的依据。</p> <p>管理人挑选市场中的银行理财产品，根据宏观经济情况确定资产配置方向，选择相应策略和风格的管理人。同时利用市场波动，动态微调不同产品间的配置结构，进一步提升产品收益。通过对投资对象的风险收益特征分析以及投资特性分析，选择符合条件的银行理财产品进行投资，并定期进行业绩跟踪和分析，适时作出相应的投资调整。</p> <p>6、债券正回购投资策略</p> <p>杠杆放大操作即以组合现有债券为基础，利用正回购等方式融入低成本资金，并购买具有较高收益的债券，以期获取超额收益的操作方式。本计划将对正回购利率与债券收益率、存款利率等进行比较，判断是否存在利</p>

		<p>差套利空间，从而确定是否进行杠杆操作。</p> <p>进行杠杆放大策略时，管理人将严格控制信用风险及流动性风险。</p>
<p>第十一部分 资产管理计划的投资</p> <p>七、投资限制和投资禁止</p> <p>(一) 投资限制</p>	<p>3、不得投资于境内二级市场公开交易的股票或与其相关的证券投资基金；不得投资于未上市企业股权和上市公司非公开发行或交易的股份；</p>	<p>3、不得投资于境内二级市场公开交易的股票以及股票型或混合型证券投资基金；不得投资于未上市企业股权和上市公司非公开发行或交易的股份；</p>
<p>第十一部分 资产管理计划的投资</p> <p>七、投资限制和投资禁止</p> <p>(一) 投资限制</p>	<p>6、本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过本集合计划资产净值的 25%；本集合计划参与债券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p>	<p>6、本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过本集合计划资产净值的 25%，资产管理人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；本集合计划参与债券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p>
<p>第十一部分 资产管理计划的投资</p> <p>七、投资限制和投资禁止</p> <p>(一) 投资限制</p>		<p>增加</p> <p>8、本集合计划不投资于资产支持证券劣后级、资产支持票据劣后级。</p> <p>9、本集合计划拟投资的资产支持证券基础资产不包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权。</p> <p>10、若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%，则本计划的总资产不得超过其净资产的 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限制；</p> <p>11、资产管理计划投资于其他资产管理产品的，所投资的资产管理产品不再投资除公募</p>

		基金以外的其他资产管理产品；
第十一部分 资产管理计划的投资	<p>七、本资产管理计划的建仓期为计划成立之日起【6个月】。建仓期的投资活动，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。</p> <p>除变现期外，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。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，由此造成投资比例、投资范围不符合投资比例及限制规定的，视为变现期间被动超标，不属于管理人违反本合同的情形，不做另行调整安排。</p>	<p>八、本资产管理计划的建仓期为计划成立之日起【6个月】。建仓期的投资活动，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。</p> <p>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>
第十一部分 资产管理计划的投资		<p>增加：</p> <p>九、资产管理计划的特定风险</p> <p>投资者知晓并同意，集合计划存续期间，为规避特定风险，投资于固定收益类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%。</p> <p>“特定风险”主要指市场趋势性风险，例如，基于股市、债市、衍生品市场风险判断，调整资产配置比例。</p>
第十四部分 利益冲突及关联交易	<p>一、在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定并严格遵守管理人内部有关投资决策管理及关联交易管理等制度的前提下，本产品可能投资于投资者、管理</p>	<p>一、关联方范围</p> <p>资产管理计划关联方包括：</p> <p>（一）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</p>

人、托管人及其关联方所发行、管理、保
荐、托管、销售或存在其他法律关系或利
益联系的金融产品，或者与该等金融产品
以公平合理的价格进行交易，但投资者或
托管人各自就其自身或其关联方另有限制
并书面通知管理人的除外。投资者知悉并
同意本计划从事上述关联交易，管理人事
后将及时、全面、客观向投资者和托管人
进行披露。

二、投资者同意并授权管理人可将集合计
划的资产投资于管理人、托管人及其控股
股东、实际控制人或者与其有其他重大利
害关系的公司发行或者承销期内承销的证
券，或者从事其他重大关联交易。管理人
应当遵循法律、行政法规、中国证监会的
规定和合同约定，有充分的证据证明未损
害投资者利益，遵循投资者利益优先原则。
交易完成5个工作日内，管理人应通过管
理人指定网站公告告知投资者和托管人，
并向证券交易所、证券投资基金业协会以
及中国证监会相关派出机构报告。并采取
切实有效措施，防范利益冲突，保护客户
合法权益。

三、本计划存在利益冲突的处理方式、披
露方式、披露内容和披露频率

(一) 管理人依照恪尽职守、诚实信用、
谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财
产，公平对待全体投资者，实现在公司、
股东和员工个人的利益与投资者的利益发
生冲突时，优先保障投资者的利益，不同
投资者之间的利益发生冲突时，公平对待
不同投资者。

(二) 公司制定了利益冲突管理制度，按
照内外部管控要求识别、报告、评估、解

决》的规定确定)；

(二) 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)；

(三) 法律法规、监管机构、行业协会规定
的其他情形。

管理人已在本计划资产管理合同附件中披露
管理人关联方名单及托管人关联方名单，后
续更新管理人的关联方以管理人官网公告为
准，托管人关联方以托管人官网、年报或其
他方式披露为准。

二、资产管理计划存在的或可能存在的关联
交易的情形，包括但不限于：

(一) 投资于资产管理计划关联方所设立的
资产管理产品；

(二) 投资于资产管理计划关联方发行的证
券或者承销期内承销的证券；

(三) 资产管理计划与关联方开展交易；

(四) 法律法规、监管规定、自律规则等规
定为关联交易的其他事项。

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。

(一) 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上述关联交易情形
金额在3,000万元人民币以上(不含本数)
且超过资产管理产品总资产的20%；

2、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。

(二) 除重大关联交易之外的关联交易为一
般关联交易。

四、利益冲突及关联交易内部控制机制

(一) 管理人建立了关联交易管理及审批机

决利益冲突事项，包括采取相应的措施防止产生利益冲突；采取相应措施以确保公司、公司关联方以及员工不得因自己的利益导致投资者损失或使投资者处于不利地位；对于法律法规、监管规定允许的的利益冲突事项，公司以符合法律法规、监管规定或相关合同约定的方式向投资者披露、揭示或者报告。

制，明确关联交易认定标准、交易定价方法、交易审批程序，并按照关联交易类型、金额等要素将以资产管理计划资产从事的关联交易划分为一般关联交易和重大关联交易。管理人对关联交易的内部审批、管理机制由管理人根据《西部证券股份有限公司资产管理业务关联交易管理办法》按以下要求执行：

1、资产管理计划从事重大关联交易的，由资产管理计划的投资经理提交上述关联交易说明，至公司资产管理业务投资决策委员会审议；

2、资产管理计划从事一般关联交易的，由资产管理计划的投资经理在一般关联交易发生后向公司资产管理业务部门/分支机构负责人、公司相关内部控制部门报送上述关联交易说明备查；

3、其他法律法规、监管规定及管理人内部管理制度规定的审批要求。

如相关法律法规、监管规定及管理人内部管理制度发生变更的，关联交易的审批、管理等内部控制机制以更新后的规范要求执行。

（二）管理人明确要求不得以资产管理计划的资产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、向本机构注资等法律、行政法规或中国证监会禁止的行为。

五、处理方式

（一）当管理人利益与投资者利益冲突时，以保护投资者利益为原则；

（二）当投资者之间利益冲突时，以公平对待为原则；

（三）投资者同意，管理人可以将本计划的资产投资于本部分“三、重大关联交易和一

般关联交易的界定”中属于管理人内部管控机制认定的一般关联交易，管理人进行一般关联交易后，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。如属于管理人重大关联交易的，管理人应事先逐笔征询投资者意见。管理人应提前通过管理人网站公告的方式征询投资者。如果投资者未在公告发出后的3个工作日内提出异议的，应视为其同意该重大关联交易。投资者不同意的，可在公告发出后的3个工作日内退出开放日提出退出申请，如上述期间无退出开放日，则管理人将公告发出后的第3个工作日设置为临时退出开放日；逾期未退出且未有意见答复的以及答复不同意但逾期未退出的投资者，均视为同意本次重大关联交易。管理人进行关联交易后，应事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

六、信息披露

（一）披露方式

资产管理人应当通过电话、邮件或各方认可的其他方式向投资者、资产托管人进行信息披露。

（二）披露内容

资产管理人应当将本计划当期涉及的关联交易内容、关联方、处理方式等进行披露。

（三）披露频率

资产管理人应当根据本合同“第二十三部分、信息披露与报告”的相关内容履行信息披露义务。发生关联交易的，管理人应充分证明未损害投资者利益，并应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，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。

		<p>七、其他事项</p> <p>管理人、托管人应于合同生效前向对方提供关联方名单，并在该名单有变化时及时予以更新并明确告知对方。</p> <p>如法律法规、监管规定及自律规则等相关文件中，对一般、重大关联交易的分类标准及管控要求另有规定的，从其规定。</p>
<p>第十五部分 投资经理的指定与变更</p>	<p>一、资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。</p> <p>二、本计划的投资经理的资料如下： 本计划的投资经理由张超先生担任。 张超先生，华中科技大学工学学士，上海财经大学金融学硕士，10年债券从业经历，曾任国泰君安证券研究所债券研究员，东莞证券固定收益部债券投资经理。2016年1月加入西部证券股份有限公司上海第二分公司，任投资经理。</p> <p>本计划投资经理无外部兼职、已具备证券从业与基金从业资格，近三年未有被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>三、在本集合计划存续期间内，管理人可以根据需要变更投资经理。投资经理变更后，资产管理人应及时通知投资者，并及时书面通知销售机构。资产管理人应当于5日内在其网站上发布公告即视为履行了向投资者通知的义务。投资经理发生变更时，原投资经理应当妥善保管投资业务资料，及时办理投资业务的移交手续，新投资经理或者临时投资经理应当及时接收。投资经理的选任与变更情况应报中国证券投资基金业协会备案。</p>	<p>一、资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。</p> <p>二、本计划的投资经理的资料如下： 本计划的投资经理由耿帅先生和杨政祎先生担任。</p> <p>耿帅先生，中国人民大学农林经济管理硕士，自2014年起从事固定收益业务，曾任厦门国际银行金融市场部交易员、投资助理，西部证券证券投资部投资经理助理、投资经理。现任西部证券股份有限公司上海证券资产管理分公司投资经理。</p> <p>杨政祎先生，上海财经大学金融硕士，自2014年起从事固定收益业务，曾任珠海农商行理财银行部债券配置岗、太平洋证券资产管理总部助理投资主办、云南国际信托债券投资经理、朝阳永续任基金研究员。2020年12月加入西部证券股份有限公司上海证券资产管理分公司，担任投资经理。</p> <p>本计划投资经理无外部兼职、已具备证券从业资格和基金从业资格，近三年未有被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>三、在本集合计划存续期间内，管理人可以根据需要变更投资经理。投资经理变更后，资产管理人应及时通知投资者，并及时通知销售机构。资产管理人应当于5日内在其网站上发布公告即视为履行了向投资者通知的</p>

		义务。投资经理发生变更时，原投资经理应当妥善保管投资业务资料，及时办理投资业务的移交手续，新投资经理或者临时投资经理应当及时接收。
<p>第十八部分 越权交易的界定</p> <p>三、托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>2、对本计划以下投资限制进行监督：</p>	<p>(3) 不得投资于境内二级市场公开交易的股票或与其相关的证券投资基金；不得投资于未上市企业股权和上市公司非公开发行或交易的股份；</p> <p>……</p> <p>(6) 本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过本集合计划资产净值的 25%；本集合计划参与债券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p>	<p>(3) 不得投资于境内二级市场公开交易的股票以及股票型或混合型证券投资基金；不得投资于未上市企业股权和上市公司非公开发行或交易的股份；</p> <p>……</p> <p>(6) 本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过本集合计划资产净值的 25%，资产管理人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；本集合计划参与债券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p>
<p>第十八部分 越权交易的界定</p> <p>三、托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>2、对本计划以下投资限制进行监督：</p>		<p>新增</p> <p>(8) 本集合计划不投资于资产支持证券劣后级、资产支持票据劣后级。</p>
<p>第二十部分 资产管理计划财产的估值和会计核算</p> <p>三、估值方法</p>	<p>1、债券估值</p> <p>(1) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大</p>	<p>(一) 债券估值</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全价进行估值。</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全价或推荐估值全</p>

	<p>变化因素或参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(2) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素或参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>(4) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。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固定收益品种，按成本估值</p> <p>(5) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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。当情况发生变化，管理人认为成本法不能公允计量该资产的价值时，管理人应当及时进行调整。</p> <p>(6) 非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>(7) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p> <p>(8) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1) - (7)小项规定的方法对计划资</p>	<p>价进行估值。</p> <p>3、对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券、可交换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，实行全价交易的债券选取最近交易日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取最近交易日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或债券发行机构发生影响债券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；对于非公开发行的可转债、可交换债，采用第三方估值机构提供的价格数据确定公允价值。若第三方估值机构未提供估值价格，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，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>4、对于首次发行未上市债券采用第三方机构提供的估值价格确定公允价值；若第三方估值机构未提供估值价格，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>5、对于只在上海证券交易所固定收益平台或者深圳证券交易所综合协议平台交易的债券，选取估值日第三方估值机构提供的相应</p>
--	---	---

产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果资产管理人认为按本项第(1)-(7)小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的,资产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,资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

2、债券逆(正)回购按首期实付金额作为成本列示,按合同利率扣除(增加)费用后在实际持有期间内逐日确定利息收入(利息支出)。

3、银行存款、同业存单以成本列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化,在知悉当日进行账务调整,不做追溯调整。

4、货币市场基金在持有期间内以成本估值,以基金管理公司公布的前一日收益计提收益。

5、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的,管理人可根据具体情况,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,在与托管人商议后,按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。如:银行间债券估值如遇特殊情况,由管理人和托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。

6、如有新增事项或变更事项,按国家最新规定估值。

7、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因其他原因暂停营业时,或因其他任何不可抗力(包括

品种当日的估值价格进行估值,若第三方估值机构未提供估值价格,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,管理人与托管人协商,并按相关法规的规定,谨慎确定公允价值,按最能反映公允价值的价格估值。

6、在对银行间市场的固定收益品种估值时,应主要依据中债登公司提供的相应品种当日的估值价格估值。对银行间市场未上市,且中债登公司未提供估值价格的固定收益品种,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,管理人与托管人协商,并按相关法规的规定,谨慎确定公允价值,按最能反映公允价值的价格估值。

7、对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券、资产支持票据和非公开发行债券,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值价格进行估值。若第三方估值机构未提供估值价格,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,管理人与托管人协商,并按相关法规的规定,谨慎确定公允价值,按最能反映公允价值的价格估值。

8、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值;

9、在任何情况下,资产管理人如采用本项第1-8小项规定的方法对计划资产进行估值,均应被认为采用了适当的估值方法。但是,如果资产管理人认为按本项第1-8小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的,资产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,资产管理人

但不限于战争、自然灾害)致使集合计划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,集合计划管理人必须按规定完成估值工作。

可根据具体情况与资产托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(二) 债券逆(正)回购按首期实付金额作为成本列示,按合同利率扣除(增加)费用后在实际持有期间内逐日确定利息收入(利息支出)。有客观证据表明该证券回购资产的价值发生重大变化时,参考重大变化因素确定公允价值进行估值,应充分考虑其特点及其对信用风险的风险缓释作用,合理确认损失准备,对质押券的公允价值高于买入返售金融资产账面价值的回购交易,在计量预期信用损失时可认为违约损失率接近于零,在出现质押券的公允价值不足以覆盖买入返售金融资产账面价值的情况时,计量预期信用损失,以中国结算为中央对手方的债券质押式逆回购除外,以中国结算为中央对手方的债券质押式逆回购,在计量预期信用损失时可认为预期信用损失率接近于零。

(三) 银行存款及结算备付金、存出保证金、券商保证金等金融资产以本金列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入,应合理确认损失准备。结算备付金、存出保证金、券商保证金等金融资产以及对于提前支取利息不受损的定期存款和协议存款,参照活期存款,在计量预期信用损失时可认为违约损失率接近于零。如提前支取或利率发生变化,在知悉当日进行账务调整,不做追溯调整。

(四) 应收股利、应收申购款等期限极短的应收款项、以及应收采用足额担保交收或类似交收保障机制的证券登记结算机构(如中国结算)或交易对手方的清算款,参照活期存款,在计量预期信用损失时可认为违约损失率接近于零。

(五) 同业存单按估值日第三方估值机构提

供的估值价格估值，若第三方估值机构未提供估值价格，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值。

(六) 持有的货币市场基金，以基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益每日计提红利。

(七) 投资证券投资基金的估值方法

1、持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

2、持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF))，按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；

3、场内申购获得的ETF基金按【转出股票价值+现金替代+现金差额-可收替代】确认成本，其中，转出股票价值按估值日各转出股票收盘价计算；基金公司未公布估值日现金替代的，按基金公司公布的估值日预估现金部分计算，并于估值日现金差额公布后调整ETF基金成本；可收替代款于收到退补数据后调整ETF基金成本；如果现金差额公布日或者退补数据公布日，已无ETF持仓，该部分差额直接计入产品收益。场内赎回ETF基金获得的成分股票按【当日收盘价，如果停牌取最近日收盘价】确认成本，管理人应

按时向托管机构提供退补数据；持有的 ETF 基金，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

4、场内持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的，按照本条第 1 款规定的方法估值，即按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。不能在交易所交易的，按照本条 2 款规定的方法估值，即按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；

（八）持有的商业银行及商业银行理财子公司发行的银行理财产品，按照以下方法估值：

1、按面值及每万份收益计价的银行理财产品，按银行理财产品管理人提供的最新（含节假日）每万份收益每日计提收益；

2、按份额净值计价的银行理财产品，按银行理财产品管理人估值日提供的份额净值估值。估值日未提供最新份额净值的，按此前最近交易日提供的银行理财份额净值估值；

3、银行理财管理人出具的相关文件能够提供固定收益率的，每日加计应收利息进行估值；

（九）本集合计划可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格

		<p>数据，具体估值机构由管理人与托管人另行协商约定。</p> <p>(十) 如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，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，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。如：银行间债券估值如遇特殊情况，由管理人和托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。</p> <p>(十一) 如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。</p> <p>(十二) 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因其他原因暂停营业时，或因其他任何不可抗力（包括但不限于战争、自然灾害）致使集合计划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，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。</p>
<p>第二十部分 资产管理计划财产的估值和会计核算</p> <p>十、特殊情况的处理</p>	<p>(一) 管理人或托管人按估值方法的第(七)款进行估值时，所造成的误差不作为计划财产估值错误处理。</p>	<p>(一) 管理人或托管人按估值方法的第(十)款进行估值时，所造成的误差不作为计划财产估值错误处理。</p>
<p>第二十一部分 资产管理计划的费用与税收</p> <p>一、资产管理计划的费用种类</p>	<p>(五) 银行结算费用、开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费、注册登记机构收取的其他相关费用等本计划运营过程中发生的相关费用</p>	<p>(五) 银行结算费用、银行收取的询证函费、开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费、注册登记机构收取的其他相关费用等本计划运营过程中发生的相关费用</p>

<p>第二十一部分 资产管理计划的费用与税收</p> <p>二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式</p> <p>(2) 业绩报酬:</p>	<p>.....</p> <p>在业绩报酬计提日,若投资者在该期间内的实际年化收益率 R 小于或等于该笔份额适用的业绩报酬计提基准R*,管理人不计提业绩报酬;若在该期间内的实际年化收益率 R 大于业绩报酬计提基准R*,管理人将对超过部分收益的 30%计提业绩报酬,剩余部分归投资者所有。</p> <p>.....</p> <table border="1" data-bbox="406 683 917 873"> <thead> <tr> <th>本期实际年化收益率 R</th> <th>计提比例</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R \leq R^*$</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td>$R > R^*$</td> <td>30%</td> </tr> </tbody> </table> <p>业绩报酬计提公式:</p> $R = \frac{(P - P_0)}{P_0^*} \times \frac{365}{D}$ $H = N \times P_0^* \times (R - R^*) \times \frac{D}{365} \times 30\%$	本期实际年化收益率 R	计提比例	$R \leq R^*$	0	$R > R^*$	30%	<p>.....</p> <p>在业绩报酬计提日,若投资者在该期间内的实际年化收益率 R 小于或等于该笔份额适用的业绩报酬计提基准R*,管理人不计提业绩报酬;若在该期间内的实际年化收益率 R 大于业绩报酬计提基准R*,管理人将对超过部分收益的 60%计提业绩报酬,剩余部分归投资者所有。</p> <p>.....</p> <table border="1" data-bbox="957 683 1492 873"> <thead> <tr> <th>本期实际年化收益率 R</th> <th>计提比例</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R \leq R^*$</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td>$R > R^*$</td> <td>60%</td> </tr> </tbody> </table> <p>业绩报酬计提公式:</p> $R = \frac{(P - P_0)}{P_0^*} \times \frac{365}{D}$ $H = N \times P_0^* \times (R - R^*) \times \frac{D}{365} \times 60\%$	本期实际年化收益率 R	计提比例	$R \leq R^*$	0	$R > R^*$	60%
本期实际年化收益率 R	计提比例													
$R \leq R^*$	0													
$R > R^*$	30%													
本期实际年化收益率 R	计提比例													
$R \leq R^*$	0													
$R > R^*$	60%													
<p>第二十一部分 资产管理计划的费用与税收</p> <p>二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式</p> <p>(六) 其他费用</p>	<p>银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、注册登记机构相关费用(包括认购登记结算费、服务月费、年度电子合同服务费)等集合计划运营过程中发生的相关费用。</p> <p>银行结算费用,一次计入集合计划费用;</p> <p>开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用;</p>	<p>银行结算费用、银行收取的询证函费、银行间市场账户维护费、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、注册登记机构相关费用(包括认购登记结算费、服务月费、年度电子合同服务费)等集合计划运营过程中发生的相关费用。</p> <p>银行结算费用,一次计入集合计划费用;</p> <p>开户费、银行收取的询证函费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用;</p>												
<p>第二十一部分 资产管理计划的费用与税收</p> <p>二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式</p>		<p>新增</p> <p>法律法规或监管规定对上述费用另有限制性要求等规定的,从其规定。</p>												

(八) 费率的调整		
<p>第二十二部分 资产管理计划的收益分配</p> <p>五、收益分配的执行方式</p>	<p>收益分配方案确定后,管理人依据具体方案的规定进行收益分配,托管人依据收益分配方案配合执行管理人收益分配划款指令。</p> <p>计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,计划登记机构可将计划份额持有人的现金红利自动转为计划份额。</p>	<p>收益分配方案确定后,管理人依据具体方案的规定进行收益分配,托管人依据收益分配方案配合执行管理人收益分配划款指令。托管人仅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、销售机构/推广机构(管理人或销售机构/推广机构统一分配),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>第二十三部分 信息披露与报告</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>(二) 季度报告和年度报告</p>	<p>2. 年度报告内容应包括但不限于下列信息:</p> <p>(1) 管理人履职报告;</p> <p>(2) 托管人履职报告;</p> <p>(3) 资产管理计划投资表现;</p> <p>(4) 资产管理计划投资组合报告;</p> <p>(5) 资产管理计划运用杠杆情况;</p> <p>(6) 资产管理计划财务会计报告;</p> <p>(7) 资产管理计划支付的管理费、托管费等费用的计提基准、计提方式和支付方式;</p> <p>(8) 资产管理计划投资收益分配情况;</p> <p>(9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项;</p> <p>(10) 中国证监会规定的其他事项。</p>	<p>2. 年度报告内容应包括但不限于下列信息:</p> <p>(1) 管理人履职报告;</p> <p>(2) 托管人履职报告;</p> <p>(3) 资产管理计划投资表现;</p> <p>(4) 资产管理计划投资组合报告;</p> <p>(5) 资产管理计划运用杠杆情况;</p> <p>(6) 资产管理计划财务会计报告;</p> <p>(7) 资产管理计划支付的管理费、托管费等费用的计提基准、计提方式和支付方式;</p> <p>(8) 资产管理计划投资收益分配情况;</p> <p>(9) 关联交易事项;</p> <p>(10) 投资经理变更等涉及投资者权益的重大事项;</p> <p>(11) 中国证监会规定的其他事项。</p>
<p>第二十三部分 信息披露与报告</p> <p>三、临时报告</p>	<p>发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时,在事项发生之日起5日内向投资者披露。临时报告的情形包括但</p>	<p>发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时,在事项发生之日起5日内向投资者披露。临时报告的情形包括但不限</p>

	<p>不限于：</p> <p>(1) 集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资经理发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；</p> <p>(2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>(3) 发生巨额退出并延期支付；</p> <p>(4) 集合计划终止和清算；</p> <p>(5) 合同的补充、修改与变更；</p> <p>(6) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>(7) 负责本集合计划的销售机构发生变更；</p> <p>(8) 管理人以自有资金参与或退出本集合计划；</p> <p>(9) 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>(10) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>(11) 集合计划管理人或托管人变更；</p> <p>(12) 本计划资产净值计算错误偏差达到本计划资产净值 0.5%时；</p> <p>(13) 集合计划收益分配；</p> <p>(14) 集合计划发生关联交易；</p> <p>(15) 法律法规、监管机构、自律组织规定的其它事项。</p>	<p>于：</p> <p>1. 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；</p> <p>2. 集合计划终止和清算；</p> <p>3. 合同的补充、修改与变更；</p> <p>4. 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>5. 负责本集合计划的代理销售机构发生变更；</p> <p>6. 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>7. 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>8. 管理人认为重大的其他事项。</p>
<p>第二十四部分 风险揭示</p> <p>一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：</p> <p>(一) 一般风险揭示</p>	<p>10、关联交易的风险</p> <p>经投资者事同意，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、实际控制人或者其它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。</p>	<p>10、关联交易的风险</p> <p>(1) 重大关联交易风险</p> <p>本计划进行重大关联交易时，管理人应遵守法律法规、监管规定、行业自律组织要求、合同约定及管理人相关内控制度，保护投资者的合法权益，但投资者仍有可能面临重大</p>

关联交易存在相关投资风险、未能取得预期效果等情况，导致投资者利益受到损害的风险。

另外，管理人从事重大关联交易的，会事先以公告形式通知全体投资者并征询投资者意见，可能存在投资者未及时查阅相关信息导致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，从而可能存在一定风险，请投资者充分关注。

(2) 一般关联交易风险

根据本合同约定，投资者同意管理人可以将本计划的资产投资于“第十四部分 利益冲突及关联交易”“三、重大关联交易和一般关联交易的界定”中属于管理人内部管控机制认定的一般关联交易，管理人无需就该等具体关联交易事先征询投资者的意见。虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但管理人进行一般关联交易亦可能存在利益冲突的情形，并存在相关投资风险，请投资者充分关注。

第二十四部分 风险揭示

一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：
(二) 特定风险揭示

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

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，并抄报中国证监会相关派出机构。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

1、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案的相关风险

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、投资者名单与认购金额、资产缴付证明等材料报证券投资基金业协会备案。证券投资基金业协会按照法律、行政法规和中国证监会规定对证券期货经营机构资产管理计划实施备案管理和监测监控，本计划可能出现被要求整改的情形，可能导致本计划合同变更或提前终止，请投

	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。	投资者注意此风险。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。
第二十四部分 风险揭示 一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于： (二) 特定风险揭示		增加： 5、逆回购风险 本计划投资于债券逆回购，存在交易对手的信用风险，交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有利息和分红，从而对本计划的资产净值造成不利影响的风险。
第二十四部分 风险揭示 一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于： (二) 特定风险揭示	<p>6、投资资产支持证券的特有风险</p> <p>(1) 交易结构风险</p> <p>若发起人的资产出售是作为资产负债表内融资处理，则当发起人破产时，其他债权人对证券化资产仍享有追索权，从而导致资产支持证券的投资者面临本息损失的风险。</p> <p>(2) 信用风险</p> <p>也称为违约风险。由于资产支持证券的信用链结构，投资者可能面临资产证券化参与主体违背合约的风险。在资产支持证券合约到期之前或在可接受的替代方接任之前，任何参与主体对合约规定职责的放弃，都会给投资者带来损失的风险。</p> <p>(3) 提前偿还风险</p> <p>资产支持证券一般有提前偿还条款，发行人有权在债券到期前提前偿还全部或部分债券，可能使得投资者在现金流的时间管理上面临不确定性，同时面临再投资风险。</p>	<p>7、投资资产支持证券及资产支持票据的特有风险</p> <p>(1) 交易结构风险</p> <p>若发起人的资产出售是作为资产负债表内融资处理，则当发起人破产时，其他债权人对证券化资产仍享有追索权，从而导致资产支持证券及资产支持票据的投资者面临本息损失的风险。</p> <p>(2) 信用风险</p> <p>也称为违约风险。由于资产支持证券及资产支持票据的信用链结构，投资者可能面临资产证券化参与主体违背合约的风险。在资产支持证券及资产支持票据合约到期之前或在可接受的替代方接任之前，任何参与主体对合约规定职责的放弃，都会给投资者带来损失的风险。</p> <p>(3) 提前偿还风险</p> <p>资产支持证券及资产支持票据一般有提前偿还条款，发行人有权在债券到期前提前偿还全部或部分债券，可能使得投资者在现金流的时间管理上面临不确定性，同时面临再投资风险。</p>

第二十四部分 风险揭示

一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：
(二) 特定风险揭示

增加：

11、公募基金的投资风险

1) 价格波动风险，由于投资标的的价格会有波动，基金的净值也会因此发生波动。封闭式基金的价格与基金的净值之间是相关的，一般来说基本是同方向变动的，如果基金净值严重下跌，一般封闭式基金的价格也会下跌。而开放式基金的价格就是基金份额净值，开放式基金的申购和赎回价格会随着净值的下跌而下跌。所以本计划会面临基金价格变动的风险。如果基金价格下降到买入成本之下，在不考虑分红因素影响的情况下，本计划会面临亏损风险。

2) 流动性风险，对于封闭式基金而言，当要卖出基金的时候，可能会面临在一定的价格下无法卖出而要降价卖出的风险；另外，巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请超过基金总份额的百分之十时，本计划将可能无法及时赎回持有的全部基金份额，影响本计划的资金安排。

12、投资商业银行理财产品的风险

1) 由于多种原因，投资的商业银行理财产品的基础投资标的可能无法变现，使得理财产品无法实现收益，从而带来风险。

2) 由于大部分银行理财产品无公开交易市场，可能无法及时变现，从而给本集合计划带来流动性风险。

3) 管理人对发行银行理财产品的商业银行或商业银行理财子公司内控信息无法随时全面获取，控制力不强，并且所投资的理财产品的投资经理的知识、经验、判断、决策等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融

		<p>市场价格走势的判断，如变更投资经理、投资经理判断有误、投资经理的行为违反法律法规规定、投资经理获取信息不全或对投资工具使用不当等，可能会影响理财产品的收益水平，从而产生风险。</p> <p>13、投资货币市场基金的风险</p> <p>货币市场基金主要投资于债券、央行票据、回购等安全性极高的短期金融品种，主要存在利率风险。当市场利率突然发生变化而短期债券的利息随之发生变化，而货币市场基金没有做出及时的调整时，货币市场基金存在整体收益下跌的风险。另一方面，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者利益受到影响，这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等等。监管政策变化也可能影响货币基金运作风险，极端情况下赎回提现限制影响资产流动性风险。</p>
<p>第二十四部分 风险揭示</p> <p>一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：</p> <p>(二) 特定风险揭示</p>	<p>11、争议解决方式的风险</p> <p>采用仲裁方式解决争议，具有自愿、专业、灵活和保密等特点，但仲裁活动所依据的法律与诉讼法律活动相比，客观存在着局限性；受限于客观条件，仲裁过程依赖于特定程序和实体认定，可能无法完全符合客观真实；经仲裁正当程序调查出的结果，由仲裁员作居中裁决者的制度设置也可能导致裁决结果的不确定性。此外，与诉讼法律活动相比，仲裁过程还具有复杂性和变异性等特点。根据我国法律规定，当事人约定仲裁方式进行争议解决的，不得就该争议向人民法院提起诉讼，仲裁结果可能是终局的，上述安排均可能影响当事各方的权益，各方当事人均已知悉并自愿选</p>	<p>15、投资比例暂时不符合合同约定的风险</p> <p>投资者知晓并同意，集合计划存续期间，为规避特定风险，投资于固定收益类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%。“特定风险”主要指市场趋势性风险，例如，基于股市、债市、衍生品市场风险判断，调整资产配置比例，从而产生一定的风险。</p> <p>本计划存续期间，因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素导致本计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交</p>

	择仲裁方式进行争议解决。	易的二十个交易日调整至符合相关要求，法律法规另有规定的按其规定，从而产生一定的风险。
第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算 一、资产管理合同的变更	<p>(一) 本计划存续期间，存在以下情形的：</p> <p>1、因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的；</p> <p>2、资产管理计划认购或参与、非交易过户的原则、时间、业务规则等变更；</p> <p>3、对资产管理合同的变更不涉及合同当事人权利义务关系发生重大变化，且对投资者利益无实质性不利影响。</p> <p>管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。管理人有权作出上述调整并及时在管理人网站公告，无需另行征求投资者意见。</p>	<p>(一) 本计划存续期间，存在以下情形的：</p> <p>1、因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的；</p> <p>管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。管理人有权作出上述调整并及时在管理人网站公告，无需另行征求投资者意见。</p>
第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算 三、或有事项	<p>1、当管理人独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司时投资者在此同意，如果此或有事件发生，在管理人与托管人书面协商一致的基础上，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如上所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和投资者另行签订专项协议。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作出合理安排。</p> <p>管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。</p> <p>管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。</p>	<p>1、当管理人独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司时投资者在此同意，如果此或有事件发生，在管理人与托管人书面协商一致的基础上，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如上所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和投资者另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告投资者。</p> <p>管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。</p> <p>管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。</p>

<p>第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>四、资产管理计划的展期</p> <p>4、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>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>第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>五、资产管理计划终止的情形,包括但不限于下列事项:</p>	<p>.....</p> <p>(五) 未在基金业协会完成备案或不予备案的情形;</p> <p>(六) 当资产管理计划出现以下情况之一,管理人有权与托管人协商一致提前终止本计划:(1) 没有债券持仓;(2) 出现债券违约;(3) 资产净值少于1000万;</p> <p>(七) 经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的;</p> <p>(八) 法律、行政法规、中国证监会规定或资产管理合同约定的其他情形。</p> <p>.....</p>	<p>.....</p> <p>(五) 在证券投资基金业协会备案时被要求整改导致本计划提前终止的情形;</p> <p>(六) 当资产管理计划出现以下情况之一,管理人有权与托管人协商一致提前终止本计划:(1) 没有债券持仓;(2) 出现债券违约;(3) 资产净值少于1000万;</p> <p>(七) 经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的;</p> <p>(八) 如因后续法律、法规、监管机构要求发生变更,导致交易系统不能继续使用且无法更换其他合适的交易系统,资管计划提前终止;</p> <p>.....</p>
<p>第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</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</p>	<p>3、因持有流通受限证券及其他投资品种等原因导致本计划财产无法及时变现的,管理人应将已变现部分先行分配,并于本计划终止后对计划财产进行延期清算。清算期间将不再提取管理费、托管费等相关费用及业绩报酬(如本合同已明确约定业绩报酬的收取)。待上述资产可以变现时,管理人应及时完成剩余可变现计划资产的变现操作</p>	<p>3、因持有流通受限证券及其他投资品种等原因导致本计划财产无法及时变现的,管理人应将已变现部分先行分配,并于本计划终止后对计划财产进行延期清算。清算期间将继续按合同约定提取管理费、托管费等相关费用及业绩报酬(如本合同已明确约定业绩报酬的收取)。待上述资产可以变现时,管理人</p>

分配	<p>后进行延期清算,并在扣除相关费用和业绩报酬(如有)后将该剩余财产分配给全体投资者。本计划持有只流通受限的证券及其他投资产品的,管理人按本款约定进行多次变现及清算。管理人应在剩余计划财产变现并完成清算后3个工作日内向托管人发送指令,托管人按指令将剩余计划财产划至指定账户。</p>	<p>应及时完成剩余可变现计划资产的变现操作后进行延期清算,并在扣除相关费用和业绩报酬(如有)后将该剩余财产分配给全体投资者。本计划持有只流通受限的证券及其他投资产品的,管理人按本款约定进行多次变现及清算。管理人应在剩余计划财产变现并完成清算后3个工作日内向托管人发送指令,托管人按指令将剩余计划财产划至指定账户。本计划财产仍无法变现的,管理人有权以计划财产现状方式向投资者返还。</p>
<p>第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>七、资产管理计划的清算</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,并抄报中国证监会相关派出机构。</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。</p> <p>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。</p>
<p>第二十七部分 争议的处理</p>	<p>一、对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议,合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的,采取以下第(一)种方式解决:</p> <p>(一)向上海国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁,以该会当时有效的仲裁规则为准,仲裁裁决是终局性的,并对各方当事人具有约束力,仲裁费由败诉方承担;</p> <p>(二)向被告所在地有管辖权的人民法院提起诉讼。</p>	<p>一、对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议,合同当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的,采取以下第(二)种方式解决:</p> <p>(一)向上海国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁,以该会当时有效的仲裁规则为准,仲裁裁决是终局性的,并对各方当事人具有约束力,仲裁费由败诉方承担;</p> <p>(二)向管理人住所地有管辖权的人民法院提起诉讼。</p>
<p>第二十八部分 资产管理合同的效力</p> <p>二、资产管理合同的生效</p>	<p>本合同经管理人、托管人和投资者签署后成立。</p> <p>本合同成立后,同时满足以下条件时生效:</p>	<p>本合同经管理人、托管人和投资者签署后成立。</p> <p>本合同成立后,同时满足以下条件时生效:</p>

<p>效条件</p>	<p>(1) 投资者参与资金实际交付并确认； (2) 本集合计划成立。</p> <p>本集合计划终止，本合同终止。但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。</p>	<p>(1) 投资者参与资金实际交付并确认； (2) 本集合计划成立。</p> <p>本集合计划终止，本合同终止。但本合同项下的费用及税收条款、清算条款、违约责任条款、争议解决条款、保密条款仍然有效。</p>
<p>第二十八部分 资产管理合同的效力 四、资产管理合同的有效期限</p>	<p>资管合同的有效期限为自生效之日起至本集合计划清算完成。</p>	<p>本计划终止，本合同终止。但合同项下的费用及税收条款、清算条款、违约责任条款、争议解决条款、保密条款仍然有效。</p>
<p>第二十九部分 其他事项</p>		<p>增加</p> <p>四、除本合同另有约定外，任何与本合同有关的通知、报告应以书面形式作出，由本合同一方以专人递送给其他当事人，或以传真、电子邮件、邮递方式发出。该等通知以专人递送，于递交时视为送达；以传真方式发出，于收件人传真机显示收到时视为送达；以电子邮件方式发出，以发送方电脑显示成功发送的当日为收到日；以邮递方式发出，收件人签收之日视为送达。</p> <p>合同各方一致确认本合同“第四部分 当事人及权利义务”中的通讯地址和联系方式为各方履行合同、解决合同争议时接收其他方商业文件、信函、通知或司法机关(法院、仲裁机构)诉讼、执行、仲裁等文书的送达地址和联系方式。</p> <p>上述通讯地址和联系方式适用至本合同履行完毕，若发生争议则适用于全部诉讼及执行阶段或仲裁程序直至案件执行终结，除非合同双方/各方依下款告知变更。</p> <p>任何一方通讯地址和联系方式需要变更的，应提前五个工作日以书面方式向合同其他方送交书面变更告知书。若争议已进入司法或仲裁程序，该方还需同步向司法仲裁机关送</p>

		<p>交。</p> <p>合同各方均承诺：上述确认的通讯地址和联系方式真实有效。若因存在错误而导致商业文件、信函、通知或诉讼及执行文书、仲裁文书无法送达的，产生的法律后果由其自行承担。</p> <p>合同各方均明知：因各方提供或确认的送达地址或联系方式不准确、或送达地址变更后未及时依程序告知对方/其他方和司法机关、或当事人及其指定接收人拒绝签收等原因，导致相关文书未能被当事人实际接收的，邮寄送达以文书退回之日视为送达之日；直接送达以送达人当场在送达回证上记明情况之日视为送达之日。</p>
附件一	更新管理人关联方名单	
附件二	更新托管人关联方名单	
附件三	新增《风险揭示书》作为附件	

二、合同变更方案的安排

本次合同变更已获得托管人书面许可，根据《资产管理合同》约定，合同变更内容应当及时在管理人网站通告投资者。如果投资者未在通告发出后的3日内即2023年8月25日至2023年8月29日提出异议的，应视为其同意管理人对本合同做出变更。投资者不同意管理人对合同进行变更的，可于本集合计划的开放日2023年8月29日提出退出申请；逾期未退出且未有意见答复的以及答复不同意合同变更但逾期未退出的投资者，均视为同意本合同变更。

三、合同变更的生效

合同变更内容在征询意见结束后，若同意合同变更的投资者不少于2人，则本次合同变更内容将于2023年8月30日生效，具体时间见管理人网站公告。

自变更生效之日起，公告内容即成为合同组成部分。投资者、管理人和托管人无需就本次合同变更另行签字。合同变更生效后，委托人、管理人和托管人应

当按照变更生效后的内容行使各自相关权利，履行相应义务。

四、咨询方式及信息查询

1、联系电话：95582、021-50772859；

2、电子邮箱：xbzgkf@xbzqzg.com；

3、投资者可登陆管理人网站：<http://www.west95582.com>，完成注册后可查询自身所持产品份额明细和有关产品信息。



西部证券股份有限公司

2023年8月29日

