

关于世纪证券双周盈 001 号集合资产管理计划 合同变更的确认函

兴业银行股份有限公司：

为维护客户利益，我司拟为托管在贵行的“世纪证券双周盈 001 号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）进行合同变更，主要变更内容体现为以下方面（具体变更内容详见本确认函之附件《世纪证券双周盈 001 号集合资产管理计划资产管理合同变更明细表》）：

- 1、修订了投资范围和投资限制
- 2、修订了估值方法
- 3、修订了利益冲突及关联交易相关内容
- 4、修订了信息披露与报告途径
- 5、默认分红方式改为红利再投

根据本集合计划资产管理合同的约定，本次合同变更程序安排如下：

- 1、我司与贵行就本次合同变更内容达成书面一致；
- 2、我司以短信或其他方式通知委托人，并在我司网站发布合同变更公告。

委托人不同意合同变更的，应在公告发布之日起至合同变更成立日内的开放日或特别开放日（具体开放日或特别开放日以管理人网站公告为准）提出退出申请。未提出退出申请的，视同委托人已经同意本次合同变更。上述开放日或特别开放日结束后的下一个工作日，若



同意合同变更的客户数量不少于 2 人(含)，则我司约定该工作日为合同变更生效日；若同意合同变更的客户数量少于 2 人，则本次合同变更失败。

3、如合同变更成立，则我司将于合同变更生效日后的 5 个工作日内将合同变更的情况报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送我司住所地中国证监会派出机构。

鉴于贵行为本集合计划的托管人，请贵行对本次变更内容予以确认。


世纪证券有限责任公司
2023年8月21日

附件 1：世纪证券双周盈 001 号集合资产管理计划资产管理合同变更明细表

确 认 函 回 执

我行已知悉，并同意你司在《关于世纪证券双周盈 001 号集合资产管理计划合同变更的确认函》中所提及的合同相关条款的变更。



附件：世纪证券双周盈 001 号集合资产管理计划资产管理合同变更明细表

序号	位置	原合同	变更后合同
1	“二、释义”	<p>《管理办法》 中国证券监督管理委员会在 2018 年 10 月 22 日发布的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；</p>	<p>《管理办法》 指中国证监会发布的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（2023 年 1 月 12 日证监会公告（2023）2 号修订并于 2023 年 3 月 1 日施行）；</p>
2	“二、释义”	<p>《运作规定》 中国证券监督管理委员会在 2018 年 10 月 22 日发布的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》；</p>	<p>《运作规定》 指中国证监会发布的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（2023 年 1 月 12 日证监会令 203 号修订并于 2023 年 3 月 1 日施行）；</p>
3	“二、释义”	<p>合格投资者 （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（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产管理公司、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； （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； （五）基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老金、慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、</p>	<p>合格投资者 （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（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、商业保理公司、资产管理公司、信托公司、财务公司、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； （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； （五）基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老金、慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、</p>
4	“二、释义”	<p>临时开放期 指仅在合同变更、合同展期、业绩报酬计提基准变更、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限四种情况下，管理人临时设置的投资者仅可以办理退出业务的日期，临时开放期的具体安排以管理人公告或管理人</p>	<p>临时开放期 指因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订或因本计划运作的实际情况需要变更合同及在发生其他必要情况时，管理人临时设置的投资者仅可以办理退出业务的日期，</p>

		向投资者发出的通知为准；如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放期时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排执行；	临时开放期的具体安排以管理人公告为准；
5	“二、释义”	托管协议 指《世纪证券双周盈 001 号集合资产管理计划资产托管协议》及其对其的任何修订和补充；	托管协议 指《世纪证券系列集合资产管理计划之资产托管协议（托管人结算模式【统签】）》及其对其的任何修订和补充；
6	“三、承诺与声明”	管理人承诺，其不属于中国有权机关、联合国或美国制裁名单内的企业，不位于被中国有权机关、联合国或美国制裁的国家和地区。	管理人承诺，其不属于中国有权机关、联合国制裁名单内的企业，不位于被中国有权机关、联合国制裁的国家和地区。
7	“三、承诺与声明”	<p>(三) 投资者声明</p> <p>投资者声明符合《运作规定》合格投资者的要求，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，不存在任何虚假记载、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。</p> <p>投资者声明财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。</p> <p>投资者声明已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律、法规及所投资集合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其集合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，投资者于本集合计划将自行承担投资风险。</p> <p>投资者声明其知悉《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</p>	<p>(三) 投资者声明</p> <p>投资者声明符合《运作规定》合格投资者的要求，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，不存在任何虚假记载、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。</p> <p>投资者声明参与资金的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。</p> <p>投资者声明已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律、法规及所投资集合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其集合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，投资者于本集合计划将自行承担投资风险。</p> <p>投资者声明其知悉《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</p>

		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；声明用于证券投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；声明证券投资的参与与资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；声明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；声明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。 投资者声明，其不属于中国有权机关、联合国制裁名单内或美国制裁的国家和地区。	规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；声明用于证券投资的参与与资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；声明证券投资的参与与资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；声明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；声明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。 投资者声明，其不属于中国有权机关、联合国制裁名单内的企业或个人，不位于被中国有权机关、联合国制裁的国家和地区。
8	“四、当事人及权利义务”	(一) 当事人 管理人 法定代表人：李强 通信地址：深圳市福田区金田路 2026 号能源大厦北塔 23-25 层 托管人 住所：福州市湖东路 154 号 联系人：张珏	(一) 当事人 管理人 法定代表人：李剑峰 通信地址：深圳市南山区梦海大道 5073 号华海金融创新中心 C 座 16-19 层 托管人 住所：福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 联系人：林诗琪
9	“四、当事人及权利义务”	(三) 当事人的权利和义务 2、管理人的权利和义务 (2) 管理人的义务 (q) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；	(三) 当事人的权利和义务 2、管理人的权利和义务 (2) 管理人的义务 (q) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计； (z) 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；
10	“四、当事人及权利义务”	(三) 当事人的权利和义务	(三) 当事人的权利和义务

	利业务”	2、管理人的权利和义务 (2) 管理人的义务 新增	2、管理人的权利和义务 (2) 管理人的义务 (z) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。
11	“四、当事人及权利业务”	(三) 当事人的权利和义务 3、托管人的权利和义务 (2) 托管人的义务 (i) 编制私募资产管理业务托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；	(三) 当事人的权利和义务 3、托管人的权利和义务 (2) 托管人的义务 (i) 编制私募资产管理业务托管年度报告，报告中国证监会相关派出机构；
12	“四、当事人及权利业务”	(三) 当事人的权利和义务 3、托管人的权利和义务 (2) 托管人的义务 (m) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会；	(三) 当事人的权利和义务 3、托管人的权利和义务 (2) 托管人的义务 (m) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构；
13	“五、资产管理计划的基本情况”	投资范围 (1) 固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金（含已按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等规定完成规范及合同变更的券商大集合产品）、公募基金。 债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换	2、投资范围 (1) 固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、货币市场基金以及银行、信托公司、证券公司、基金公司、期货公司、保险资产管理机构及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司等发行的固定收益类资产管理产品； 债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换私募

	<p>债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换债，不允许转股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、永续债、同业存单等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。</p> <p>（2）本集合计划可以参与债券正回购交易。</p> <p>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>债，不允许转股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、永续债、同业存单等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。</p> <p>（2）本集合计划可以参与债券正回购交易。</p> <p>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>	
14	<p>“五、资产管理计划的基本情况”</p>	<p>3、投资比例</p> <p>（1）固定收益类资产占集合计划总资产的比例不低于80%；</p> <p>（2）本集合计划参与债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过上一日净资产的100%；</p>	<p>3、投资比例</p> <p>本计划按照穿透原则合并计算，进行符合以下比例的组合投资：</p> <p>（1）固定收益类资产占集合计划总资产的比例不低于80%；</p> <p>（2）本集合计划参与债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过上一日净资产的100%；</p>
15	<p>“五、资产管理计划的基本情况”</p>	<p>投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或承销期内承销的证券，可以将集合计划的资产投资于管理人关联方发行的公募产品，或者从事其他重大关联交易。管理人运用集合计划财产从事上述交易时，应当遵守相关法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同的约定，遵循投资者利益优先原则，严格按照投资决策程序进行决策和审批，采取切实有效措施防范利益冲突和利益输送。</p> <p>在本集合计划利益冲突事项发生之日起10个工作日内，管理人应通知托管人，并通过管理人的网站向投资者予以披露或其他方式通知投资者，披露或通知内容包括但不限于交易的</p>	<p>删除</p>

	<p>时间、标的名称、数量、金额等，并根据相关法律法规的要求（如有）向证券交易所或其他监管机构报告。托管人应配合向管理人提供关联方信息，不晚于本集合计划成立日将其及其他控股股东、实际控制人及其他关联方名单提供给管理人，并负责及时更新该等名单及清单。</p> <p>如法律法规或监管部门对从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定执行。</p>	<p>本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的有关规定，因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致集合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本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日日内调整至符合相关要求。如确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当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>本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的有关规定，因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致集合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本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日日内调整至符合相关要求。如确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p>
16	<p>“五、资产管理计划的基本情况”</p>	<p>(十) 封闭期、开放期安排</p> <p>本集合计划成立后首个开放日以管理人公告为准，之后每两周开放一天（遇节假日顺延），委托人可在开放期办理参与、退出业务。</p> <p>本集合计划临时开放期仅在合同变更、合同展期、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限三种情况下设置，投资者在临时开放期仅可以办理退出业务，临时开放期的具体安排以管理人公告或管理人向投资者发出的通知为准。</p> <p>如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放期时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排</p>	<p>(十) 封闭期、开放期安排</p> <p>本集合计划成立后首个开放日以管理人公告为准，之后每两周开放一天（遇节假日顺延），委托人可在开放期办理参与、退出业务。</p> <p>临时开放期指因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订或因本计划运作的实际情况需要变更合同及在发生其他必要情况时，管理人临时设置的投资者仅可以办理退出业务的日期，临时开放期的具体安排以管理人公告为准；</p> <p>如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放期时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排执</p>
17	<p>“五、资产管理计划的基本情况”</p>	<p>(十) 封闭期、开放期安排</p> <p>本集合计划成立后首个开放日以管理人公告为准，之后每两周开放一天（遇节假日顺延），委托人可在开放期办理参与、退出业务。</p> <p>本集合计划临时开放期仅在合同变更、合同展期、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限三种情况下设置，投资者在临时开放期仅可以办理退出业务，临时开放期的具体安排以管理人公告或管理人向投资者发出的通知为准。</p> <p>如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放期时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排</p>	<p>(十) 封闭期、开放期安排</p> <p>本集合计划成立后首个开放日以管理人公告为准，之后每两周开放一天（遇节假日顺延），委托人可在开放期办理参与、退出业务。</p> <p>临时开放期指因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订或因本计划运作的实际情况需要变更合同及在发生其他必要情况时，管理人临时设置的投资者仅可以办理退出业务的日期，临时开放期的具体安排以管理人公告为准；</p> <p>如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放期时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排执</p>

		执行。	
18	“七、集合计划的成立与备案”	<p>(一) 集合计划成立的条件和日期 募集期内,集合计划的参与资金总额不低于1000万元人民币,投资者的人数为2人(含)以上且不超过200人,募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定,并在集合计划募集资金缴足之日起10个工作日内经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后,管理人宣布本集合计划成立。集合计划成立时间以管理人正式发出的成立公告为准。</p>	<p>(一) 集合计划成立的条件和日期 募集期内,集合计划的参与资金总额不低于1000万元人民币,投资者的人数为2人(含)以上且不超过200人,募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定,在集合计划募集资金缴足之日起10个工作日内,管理人宣布本集合计划成立。集合计划成立时间以管理人正式发出的成立公告为准。</p>
19	“七、集合计划的成立与备案”	<p>(三) 集合计划开始运作的条件和日期 3、本集合计划开始运作的日期:本集合计划自完成备案之日起开始投资运作,但以现金管理为目的,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>删除</p>
20	“八、集合计划的参与、退出与转让”	<p>(七) 管理人及其子公司以自有资金参与集合计划 1、自有资金参与、退出的条件 本集合计划的管理人及其子公司可以自有资金参与本集合计划。管理人及其子公司自有资金参与、退出本集合计划时,应符合监管机构发布的相关规定要求。 2、参与比例或金额 管理人及管理人子公司以自有资金参与本集合计划时,自有资金参与份额不超过集合计划总份额的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限的,管理人可在90个工作日内按照本合同约定在临时开放期内申请退出所持有的份额,直至参与比例符合本合</p>	<p>(七) 证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与和退出集合计划 1、全体投资者和托管人在此不可撤销地同意并授权证券期货经营机构及其附属机构可在募集期以自有资金参与本集合计划,事后证券期货经营机构应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者,并及时通过电子邮件、纸质文件等方式告知托管人。 在开放期内由于投资者退出导致的证券期货经营机构自有资金投资被动超限的,无需事先取得投资者同意,但证券期货经营机构在自有资金退出后及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者,并及时通过电子邮件、纸质文件等方式告知托管人。</p>

	<p>合同约定。</p> <p>3、收益分配和责任承担方式 管理人及其子公司自有资金参与本集合计划所形成的份额在本集合计划进行收益分配时，与其他投资者的份额享有同等权益。管理人及其子公司自有资金参与本集合计划所形成的份额与其他投资者的份额享有同等权益、承担同等风险。</p> <p>4、自有资金参与和退出的约定 (1) 自有资金参与退出的约束 管理人以自有资金参与集合计划的持有期限不得低于6个月。因本集合计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与比例或管理人及其子公司自有资金参与比例被动的超标，在遵守相关监管要求的前提下，管理人可根据自有资金参与退出的有关法规适时安排自有资金的退出，不受前述条款限制。</p> <p>(2) 自有资金参与退出的信息披露 管理人以自有资金参与、退出时，应当提前5个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意，自有资金参与退出信息在管理人网站上披露。</p> <p>(3) 应对集合计划巨额赎回，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其子公司以自有资金参与及其后续退出集合计划可不受上述参与比例和本款第(1)条、第(2)条限制，但管理人应通知托管人，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及证券投资基金业协会报告。</p> <p>5、管理人特别提示 (1) 管理人及其子公司有权以自有资金参与集合计划，不构成管理人及其子公司一定会以自有资金参与集合计划以及具</p>	<p>除上述情形外的自有资金参与、退出情形，证券期货经营机构应当提前5个工作日通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者，并提前5个工作日通过电子邮件、纸质文件等方式告知托管人，并取得投资者和托管人的同意。</p> <p>证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与、退出本集合计划的，应符合《管理办法》《运作规定》和中国证监会等监管机构的规定。</p> <p>2、证券期货经营机构将与投资者按照持有本集合计划份额的比例共担风险和共享收益。</p> <p>3、证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与本集合资产管理计划的份额合计不得超过该计划总份额的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比例的，证券期货经营机构应在上述情形出现的20个工作日内进行调整。</p> <p>4、自有资金参与本集合计划的持有期限不得少于6个月。</p> <p>5、为应对巨额退出以解决流动性风险，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附属机构以自有资金参与、退出可不受上述条款的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p>
--	---	---

	<p>体参与时间的承诺。</p> <p>(2) 管理人及其子公司以自有资金参与集合计划，相关份额与投资者持有的同类份额享有同等参与收益分配的权利，不对投资者份额承担任何补偿责任。因此，管理人及其子公司自有资金的参与不构成对投资者本金及收益的保证，也不能保证投资者份额本金不受损失。</p>	
<p>(二) 投资范围</p> <p>1、固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、货币市场基金以及银行、信托公司、证券公司、基金公司、期货公司、保险资产管理机构及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司等发行的固定收益类资产管理产品；</p> <p>债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换私募债，不允许换股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、永续债、同业存单等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。</p> <p>2、本集合计划可以参与债券正回购交易。</p> <p>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>(二) 投资范围</p> <p>1、固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金（含已按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融资产管理业务的指导意见〉操作指引》等规定完成规范及合同变更的券商大集合产品）、公募货币市场基金。</p> <p>债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换私募债，不允许换股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、永续债、同业存单等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。</p> <p>2、本集合计划可以参与债券正回购交易。</p> <p>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>“十一、集合计划的投资”</p>
22	<p>(三) 投资比例</p>	<p>“十一、集合计划 (三) 投资比例</p>

	的投资”	<p>1、固定收益类资产占集合计划总资产的比例不低于80%；</p> <p>2、本集合计划参与债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过上一日净资产的100%；</p>	<p>本计划按照穿透原则合并计算，进行符合以下比例的组合投资：</p> <p>1、固定收益类资产占集合计划总资产的比例不低于80%；</p> <p>2、本集合计划参与债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过上一日净资产的100%；</p>
23	“十一、集合计划的投资”	<p>(三) 投资比例</p> <p>投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或承销期内承销的证券，可以将集合计划的资产投资于管理人关联方发行的公募产品，或者从事其他重大关联交易。管理人运用集合计划财产从事上述交易时，应当遵守相关法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同的约定，遵循投资者利益优先原则，严格按照投资决策程序进行决策和审批，采取切实有效措施防范利益冲突和利益输送。</p> <p>在本集合计划利益冲突事项发生之日起10个工作日内，管理人应通知托管人，并通过管理人的网站向投资者予以披露或其他方式通知投资者，披露或通知内容包括但不限于交易的时间、标的名称、数量、金额等，并根据相关法律法规的要求（如有）向证券交易所或其他监管机构报告。托管人应配合向管理人提供关联方信息，不晚于本集合计划成立日将其、及其控股股东、实际控制人及其他关联方名单提供给管理人，并负责及时更新该等名单及清单。</p> <p>如法律法规或监管部门对从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定执行。</p>	<p>(三) 投资比例</p> <p>删除</p>
24	“十一、集合计划的投资”	<p>(三) 投资比例</p> <p>本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会</p>	<p>(三) 投资比例</p> <p>本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的</p>

	<p>的有关规定，因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致集合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本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的15个交易日内在完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p>	<p>的有关规定，因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致集合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本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的20个交易日内在完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p>
<p>25</p> <p>“十一、集合计划的 投资”</p>	<p>(五) 投资策略</p> <p>4、基金投资策略</p> <p>本集合计划管理人通过对基金历史数据的长期跟踪研究，整合国际上主要的基金评价方法，形成了一套全方位、多视角、立体化的基金评级分析体系，囊括了基金管理公司综合素质评估、基金经理人评价、基金业绩稳定性评价、基金风险收益分析、基金评级、基金业绩归因分析、基金选时能力和择股能力评价等多项评价功能。同时，本集合计划还结合其他基金评级机构的基金研究报告，对基金过往风险收益状况形成一些定量的和定性的基本判断，再根据对未来市场行情、基金未来净值成长性的预期以及基金公司实地调研的成果，构建或调整基金组合。</p> <p>开放式基金主要考察基金以往的业绩（尤其是最近3个月的表现）、基金净值增长的稳定性与持续性、基金经理的风格、基金现有规模、基金公司的治理结构等多方面，在此基础上构建基金组合，定期根据这些基金组合的表现进行优胜劣汰。封闭式基金则主要选择过往业绩优秀、折价率较高、有较高分红预期的封闭式基金进行投资。</p>	<p>(五) 投资策略</p> <p>4、资产管理产品投资策略</p> <p>本计划通过对公募基金管理人及其管理的产品的评价，坚持从研究资产管理产品价值入手采用定性分析与定量分析相结合的方法，按照自上而下和自下而上相结合的原则，悉心选择管理规范、业绩优良的资产管理产品。本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基金以外的其他资产管理产品。</p>

26	“十一、集合计划的投资”	<p>(七) 投资限制及禁止行为</p> <p>1、投资限制</p> <p>(1) 本集合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；</p> <p>新增 (6)</p>	<p>(七) 投资限制及禁止行为</p> <p>1、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> <p>删除 (1)</p> <p>新增 (6)</p> <p>(6) 本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，本集合计划的总资产不得超过净资产的 120%。本集合计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制；管理人在资产管理计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%后及时告知托管人。</p>
27	“十四、利益冲突及关联交易”	<p>本集合计划可能存在利益冲突事项包括但不限于：(1) 投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或承销期内承销的证券；(2) 投资管理人在将集合计划发行的公募产品。投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或承销期内承销的证券，可以将集合计划的资产投资于管理人关联方发行的公募产品，或者从事其他重大关联交易。管理人运用集合计划财产从事上述交易时，应当遵守相关法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同的约定，遵循投资者利益优先原则，严格按照投资决策程序进行决策和审批，采取切实有效措施防范利益冲突和利益输送。</p> <p>在本集合计划利益冲突事项发生之日起 10 个工作日内，管理人应通知托管人，并通过管理人的网站向投资者予以披露或其他方式通知投资者，披露或通知内容包括但不限于交易的时间、标的名称、数量、金额等，并根据相关法律法规的要</p>	<p>(一) 资产管理计划存在或可能存在利益冲突的情形</p> <p>投资者知悉，尽管管理人承诺勤勉地管理本资产管理计划资产、公平对待各投资组合，本资产管理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：</p> <p>1、将资产管理计划资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券、管理人将本资产管理计划资产与关联方开展逆回购交易或以管理人及关联方发行的证券作为质押券的，或者从事其他关联交易事项；</p> <p>2、将资产管理计划资产投资于管理人关联方发行的其他金融产品；</p> <p>3、本资产管理计划若为 FOF 产品的，管理人投资于管理人设立的资产管理计划；</p> <p>4、其他可能产生重大利益冲突且对投资者利益有重大影响的情况；</p>

	<p>求（如有）向证券交易所或其他监管机构报告。托管人应配合向管理人提供关联方信息，不晚于本集合计划成立日将其、及其控股股东、实际控制人及其他关联方名单提供给管理人，并负责及时更新该等名单及清单。</p> <p>如法律法规或监管部门对从事关联交易的条件和要求进行变更的，本集合计划可以变更后的规定执行。</p>	<p>5、因管理人、托管人业务特性或本资产管理计划运作特性存在的相关利益冲突情形：</p> <p>（1）管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；</p> <p>（2）管理人管理的其他资产管理计划（包括本资产管理计划投资经理管理的其他资产管理计划）基于各自投资策略需要可能与本资产管理计划存在相同、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，该等利益冲突可能会不利于本资产管理计划，也可能使本资产管理计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等；</p> <p>（3）管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本资产管理计划存在相同、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，不排除可能影响或限制本资产管理计划的投资运作；</p> <p>（4）其它因管理人、托管人业务特性或资产管理计划运作特性而本身存在的相关利益冲突情形。</p> <p>（二）存在利益冲突时的处理方式、披露内容及频率</p> <p>1、存在利益冲突时的处理方式</p> <p>管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本资产管理计划财产，公平对待全体投资者，实现在公司、股东和员工个人的利益与投资者利益发生冲突时，优先保障投资者的利益，不同投资者利益之间的利益发生冲突时，公平对待不同投资者。</p> <p>2、存在利益冲突时的披露方式</p> <p>本资产管理计划发生利益冲突情形的，将严格按照法律法规及</p>
--	---	---

	<p>本合同约定完成相应信息披露，投资者可通过管理人网站或管理人安排的其他信息披露方式查询。</p> <p>投资者知悉并确认，对于本条第（一）款第 5 项利益冲突情形，管理人和托管人不再另行安排披露事宜。</p> <p>3、存在利益冲突时的披露内容和频率</p> <p>（1）管理人运用受托管理资产从事一般关联交易的，一般关联交易事后，管理人将定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式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>管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，管理人将及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前取得投资者同意；重大关联交易事后，管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式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>通知内容包括但不限于关联交易的关联方、时间、内容、数量、金额、投资者异议的处理方式等。</p> <p>（2）发生前述其它利益冲突情形的，按照法律法规及本合同约定的方式、内容和频率完成信息披露。</p> <p>（三）关联交易</p> <p>1、本合同所称关联方包括：</p> <p>（1）管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>（2）资产管理计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>（3）法律法规、其他规范性文件或中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构对关联方另有规定的，从其规定。</p> <p>2、一般关联交易和重大关联交易</p>

关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易具体指管理人运用财产出资投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销证券，除此以外的其他关联交易为一般关联交易。法律法规、监管及自律机构对关联交易业务规范有其他规定的，从其规定。

投资者在此不可撤销地确认，投资者签署本合同即事先同意并授权管理人可将本资产管理计划从事一般关联交易；一般关联交易事后，管理人应定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会派出机构报告，具体以法律法规、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构的规定为准。

若从事重大关联交易的，管理人应当通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前通知投资者，事先取得投资者的同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。投资者未在约定时间内提出书面异议的视为同意，投资者提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确；重大关联交易事后，管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

3、关联交易的内部控制

管理人应当遵循诚信公平、投资者利益优先原则，以公平、合理的市场价格进行关联交易，防范利益冲突，禁止利益输送，保护投资者权益。管理人已制定相应的关联交易管理制度，明确了关联交易的认定标准、交易定价方法、信息披露、内部审计和评估机制等。本集合计划开展关联交易前，将采取一事一批的形式，说明交易的必要性和相关费用定价的公允性、合理

			<p>性。不得以集合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。管理人内部制度对关联交易有新的规定的，从其规定。</p> <p>(四) 其他</p> <p>1、除将本资产管理计划投资于管理人、托管人、及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券外，管理人不得将本资产管理计划资产直接或间接通过投资其他资产管理计划等间接形式，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者为私募资产管理产品的，穿透认定该私募资产管理产品的投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于1000万元）且单个委托人投资金额不低于1000万元，并且事先取得投资者同意的除外。</p> <p>2、法律法规、其他规范性文件、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构或管理人内部制度对关联方的范围、一般关联交易和重大关联交易的区分、管理人的内控机制、存在利益冲突的情形、存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容和频率等另有规定或要求的，管理人遵照执行。</p> <p>3、管理人将通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式向投资者披露关联方名单。</p>
28	“十六、集合计划的财产”	<p>(二) 集合计划的保管与处分</p> <p>1、集合计划的债务由集合计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对集合计划财产的债务承担责任。</p>	<p>(二) 集合计划的保管与处分</p> <p>1、资产管理计划财产为信托财产，其债务由资产管理计划财产本身承担，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。</p>

<p>(二) 越权交易的处理程序</p> <p>1、违反有关法律法规和本合同的规定进行的投资交易行为为：</p>	<p>(二) 越权交易的处理程序</p> <p>1、违反有关法律法规和本合同的规定进行的投资交易行为为：</p>	<p>“十八、越权交易的界定”</p>	<p>(3) 管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人应对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会派出机构。</p> <p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、对本合同约定的投资范围按照如下标准进行监督： 本集合计划主要投资于：</p> <p>(1) 固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、货币市场基金以及银行、信托公司、证券公司、基金公司、期货公司、保险资产管理机构及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司等发行的固定收益类资产管理产品； 债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换私募债，不允许转股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、永续债、同业存单等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。</p>	<p>(3) 管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人应对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会派出机构。</p> <p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、对本合同约定的投资范围按照如下标准进行监督： 本集合计划主要投资于：</p> <p>(1) 固定收益类资产，包括：债券、在证券交易所和银行间市场上市的资产支持证券（票据）、债券逆回购、银行存款、公募债券型基金（含已按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等规定完成规范及合同变更的券商大集合产品）、公募基金、货币市场基金。</p> <p>债券包括但不限于国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（含次级债、混合资本债、二级资本工具）、公司债（含非公开发行）、企业债、可转换债券（含可分离交易债，不允许转股）、可交换债（含可交换私募债，不允许转股）、中期票据、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具、项目收益票据、项目收益债、集合票据、集合债券、中小企业私募债、永续债、同业存单等在证券交易所和银行间市场上市交易的标准化债权资产。</p>	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>2、对本计划以下投资比例和投资限制进行监督：</p>
<p>29</p>	<p>30</p>	<p>“十八、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、对本计划以下投资比例和投资限制进行监督：</p>	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>2、对本计划以下投资比例和投资限制进行监督：</p>	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>2、对本计划以下投资比例和投资限制进行监督：</p>

		<p>(1) 固定收益类资产占集合计划总资产的比例不低于 80%；</p> <p>(2) 本集合计划参与债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过上一日净资产的 100%；</p> <p>(3) 本集合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；</p> <p>(4) 本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%；</p> <p>(5) 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%，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) 本集合计划参与债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，且不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>(7) 本集合计划投向的资产支持证券（票据）优先级，挂牌场所仅限沪深交易所和银行间市场，且不得投向以资管产品或其受益权作为底层资产的资产支持证券（票据）；</p> <p>(8) 信用债的主体或担保人或债项评级不得低于 AA；</p> <p>(9) 法律、行政法规、中国证监会规定的其他限制；</p> <p>3、托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内，对本计划的直接投资履行监督职能。托管人发现管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同时，不予执行，应当通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对，</p>	<p>(1) 固定收益类资产占集合计划总资产的比例不低于 80%；</p> <p>(2) 本集合计划参与债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过上一日净资产的 100%；</p> <p>(3) 本集合计划的总资产不得超过净资产的 200%；</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%，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>(5) 本集合计划参与债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，且不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>(6) 本集合计划投向的资产支持证券（票据）优先级，挂牌场所仅限沪深交易所和银行间市场；</p> <p>(7) 信用债的主体或担保人或债项评级不得低于 AA；</p> <p>(8) 本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，本集合计划的总资产不得超过净资产的 120%。本集合计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制；管理人在资产管理计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%后及时告知托管人。</p> <p>(9) 法律、行政法规、中国证监会规定的其他限制；</p> <p>3、托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内，对本计划的直接投资履行监督职能。托管人发现管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同时，不予执行，应当通</p>
--	--	--	---

	<p>并以书面形式向托管人进行解释或举证，由此造成的损失由管理人承担。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地的证监会派出机构、证券投资基金业协会。</p>	<p>知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式向托管人进行解释或举证，由此造成的损失由管理人承担。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托管人应报告证监会派出机构。</p>
<p>31 “十九、集合计划财产的估值和会计核算”</p>	<p>7、估值方法</p> <p>(1) 在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。</p> <p>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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。</p> <p>交易所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。</p> <p>(2) 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</p>	<p>7、估值方法</p> <p>具体投资品种估值方法：</p> <p>(1) 对在交易所市场上交易或挂牌转让的不含固定收益品种，选取估值日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进行估值，具体估值机构由计划管理人与计划托管人另行协商约定；</p> <p>对在交易所市场上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进行估值；</p> <p>交易所上市交易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>(2) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价估值。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进行估值。</p> <p>(3) 对于含投资人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估值，回售</p>

	<p>监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；</p> <p>持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按前一估值日的基金份额净值估值；前一估值日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；持有的货币市场基金，按所投资基金前一估值日的万份收益计提估值日基金收益；</p> <p>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>(3) 银行间债券、资产支持证券、同业存单等固定收益品种的估值采用中央国债登记结算有限责任公司提供的中债收益率曲线估值价格计算，估值技术无法确定时以成本估值。</p> <p>(4) 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>(5) 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。</p> <p>(6) 债券回购以成本列示，按实际利率在回购期间内逐日计提应收/应付利息。</p> <p>(7) 相关法律法规以及监管部门另有新规定的，从其规定。</p>	<p>登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。</p> <p>(4) 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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。</p> <p>(5) 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>(6) 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；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；</p> <p>持有的货币市场基金，按所投资基金前一交易日的万份收益计提估值日基金收益；</p> <p>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>持有的资产管理产品（包括基金管理公司及基金子公司发行的资产管理计划、证券公司及证券资产管理子公司资产管理计划、保险资产管理机构及其子公司的资产管理计划、期货公司</p>
--	--	---

		及其子公司的资产管理计划、集合信托计划、商业银行理财产品等)按前一交易日的份额净值估值,若投资的资产管理产品受托人或管理人在估值日未及时提供的,按此前最近一次提供的份额净值估值。 按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等规定完成规范及合同变更的券商大集合产品参照公募基金进行估值。 (7) 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。 (8) 债券回购以成本列示,按实际利率在回购期间内逐日计提应收/应付利息。 (9) 该计划应当按照新金融工具准则规定,以预期信用损失为基础,对适用的金融资产进行减值会计处理。 (10) 相关法律法规以及监管部门另有新规定的,从其规定。
32	“二十一、集合计划的收益分配”	(四) 收益分配方式 投资者可以选择现金分红或红利再投资的分红方式,集合计划默认分红方式为现金分红。投资者选择红利再投资的方式时,分红资金在扣除管理人业绩报酬后(如有),按分红除权日的集合计划单位净值转成集合计划份额,无需缴纳参与费。份额的计算结果以四舍五入的方法保留小数点后两位,由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。
33	“二十二、信息披露与报告”	(一) 定期报告 2、集合计划的季度报告和年度报告 (7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式;
34	“二十二、信息披露”	(一) 定期报告 2、集合计划的季度报告和年度报告 删除(7) (二) 临时报告

35	露与报告” “二十二、信息披露与报告”	8、发生本合同约定的关联交易的事项； (六) 监管报告 接下一页表格	8、发生本合同约定的重大关联交易的事项； (六) 监管报告 接下一页表格
----	------------------------	--	--

报告主体	种类	事项	时间	披露
管理人	报告	资管计划成立	资产管理计划成立之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会派出机构
	报告	资管计划变更	资产管理合同变更之日起五个工作日内	证券投资基金业协会
	报告	资管计划终止	资产管理计划终止之日起五个工作日内	中国证监会派出机构
	报告	资管计划清算结果	在资产管理计划清算结束后五个工作日内	中国证监会派出机构
	报告	资管计划因流动性受限等原因延期清算	及时	中国证监会派出机构
	报告	资管计划产品季报	每季度结束之日起一个月内披露	证券投资基金业协会、中国证监会派出机构
	报告	资管计划产品半年报	每半年结束之日起四个月内披露	证券投资基金业协会、中国证监会派出机构
	报告	私募基金管理业务季报	每季度结束之日起一个月内披露	中国证监会派出机构
	报告	私募基金管理业务半年报	每半年结束之日起四个月内披露	中国证监会派出机构
	报告	对私募基金管理业务的内部控制情况进行年度审计	每年度结束之日起四个月内	中国证监会派出机构
	报告	重大关联交易	及时	中国证监会派出机构
	报告	一般关联交易	定期	中国证监会派出机构
	报告	高级管理人员、私募基金管理业务部门负责人以及经营管理人员变动情况、投资运作信息	自发生之日起三十个工作日内	中国证监会派出机构
	报告	私募基金清算、投资运作情况、资产最终投向	每月10日前	证券投资基金业协会
	报告	私募基金清算报告	每月10日前	人民银行
	报告	私募基金管理业务托管年度报告	每年度结束之日起四个月内	中国证监会派出机构

(一) 特殊风险揭示
6、投资资产管理产品的风险

报告主体	种类	事项	时间	披露
管理人	报告	资管计划成立	资产管理计划成立之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会派出机构
	报告	资管计划变更	资产管理合同变更之日起五个工作日内	证券投资基金业协会
	报告	资管计划终止	资产管理计划终止之日起五个工作日内	中国证监会派出机构
	报告	资管计划清算结果	在资产管理计划清算结束后五个工作日内	中国证监会派出机构
	报告	资管计划因流动性受限等原因延期清算	及时	中国证监会派出机构
	报告	资管计划产品季报	每季度结束之日起一个月内披露	证券投资基金业协会、中国证监会派出机构
	报告	资管计划产品半年报	每半年结束之日起四个月内披露	证券投资基金业协会、中国证监会派出机构
	报告	私募基金管理业务季报	每季度结束之日起一个月内披露	中国证监会派出机构
	报告	私募基金管理业务半年报	每半年结束之日起四个月内披露	中国证监会派出机构
	报告	对私募基金管理业务的内部控制情况进行年度审计	每年度结束之日起四个月内	中国证监会派出机构
	报告	重大关联交易	发生之日起10个工作日内及时	中国证监会派出机构
	报告	一般关联交易	定期	中国证监会派出机构
	报告	高级管理人员、私募基金管理业务部门负责人以及经营管理人员变动情况、投资运作信息、资产最终投向	自发生之日起三十个工作日内	中国证监会派出机构
	报告	私募基金清算、投资运作情况、资产最终投向	每月10日前	证券投资基金业协会、中国证监会派出机构

(一) 特殊风险揭示
新增

“二十三、风险揭示”

		<p>6、投资资产管理产品的风险</p>	<p>(1) 管理人风险 资产管理产品的管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险是指管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内部控制等因素导致公司经营不善，极端情况下甚至破产倒闭，可能对其管理人的产品业绩造成不利影响另外，对于约定了止损条款的私募基金产品，可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。</p> <p>(2) 投资风险 资产管理产品可能由于管理人对市场判断失误、买入标的市场表现不佳、风险控制失效等原因造成产品净值的下降，从而造成集合计划净值下降。</p> <p>(3) 面临双层收费的风险 本集合计划投资者会承担双层费用，即集合计划费用及所投资的资产管理产品自身费用。</p> <p>(4) 投资的多个资产管理产品估值时间不一致导致集合计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况的风险 本集合计划投资多个资产管理产品，每个资产管理产品的估值时间可能不一致，且披露时间可能不一致。在存续期间，集合计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。</p>
37	“二十三、风险揭示”	<p>(一) 一般风险揭示</p> <p>9、关联交易风险 本集合计划可能将投资者财产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的关联方发行或者承销期内承销的证券，可能以将集合计划的资产投资于管理人关联方发行的公募产品，或者从事其他重大关联交易。管理人虽会采取措施防范利益冲突，保护投资者的合法权益，但投资者应充分知悉此关联</p>	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>9、关联交易风险 管理人可能将本资产管理计划资产从事关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、充分关注。同时，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、识别不明确、不完整、不及时导致管理人无法及</p>

	交易风险。	<p>时准确识别相关重大关联交易以至于本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全一致的风险。投资者一旦签署本合同即代表投资者同意管理人从事除重大关联交易以外的一般关联交易，不会另行逐笔事先征询投资者的意见，造成投资者无法事前知悉每笔一般关联交易的风险。管理人从事重大关联交易的，会事先通知全体投资者并征询投资者的意见，但管理人的征询方式、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处留存通讯信息不准确、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询相关信息导致最终未及时向管理人反馈或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意见中意见表示不明确，而被视为反馈了同意见的情形，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。</p>
38	“二十四、合同的变更、终止与财产清算”	<p>(一) 合同的补充、修改与变更 6、管理人应当自合同变更之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案。</p>
39	“二十四、合同的变更、终止与财产清算”	<p>(四) 集合计划的终止 新增 (8)</p>
40	“二十四、合同的变更、终止与财产清算”	<p>管理人应自资产管理计划终止之日起五个工作日内报告证券投资基金业协会，备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第(7)项约定的情形除外。</p>
41	“二十四、合同的变更、终止与财产清算”	<p>(五) 集合计划的清算</p>

	变更、终止与财产清算”	<p>6、管理人应当在集合计划清算结束后5个工作日内将清算结果报告证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；</p> <p>7、集合计划因资产流动性受限等原因延期清算的，管理人可对此制定延期清算方案，该方案应经托管人认可，并在管理人网站公告或其他方式通知投资者。当本集合计划达到可清算条件时，管理人须按照上述清算流程予以清算。当延期清算发生时，管理人应当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>6、管理人应当在集合计划清算结束后5个工作日内将清算结果报告证券投资基金业协会；</p> <p>7、集合计划因资产流动性受限等原因延期清算的，管理人可对此制定延期清算方案，该方案应经托管人认可，并在管理人网站公告或其他方式通知投资者。当本集合计划达到可清算条件时，管理人须按照上述清算流程予以清算。当延期清算发生时，管理人应当向中国证监会相关派出机构报告；</p>
42	“二十七、合同效力”	<p>(二) 合同的组成</p> <p>《世纪证券双周盈001号集合资产管理计划说明书》是管理人对于本集合计划重要事项的说明，是本合同重要附件，与合同具有同等法律效力。</p> <p>本合同适用托管协议《世纪证券双周盈001号集合资产管理计划资产托管协议》，但各方特别认可并同意，该托管协议中与本合同不一致的内容均以本合同约定内容为准。资管合同未尽事宜，依据托管协议的约定执行。</p>	<p>(二) 合同的组成</p> <p>《世纪证券双周盈001号集合资产管理计划说明书》是管理人对于本集合计划重要事项的说明，是本合同重要附件，与合同具有同等法律效力。</p> <p>本合同适用托管协议《世纪证券系列集合资产管理计划之资产托管协议（托管人结算模式【统签】）》，但各方特别认可并同意，该托管协议中与本合同不一致的内容均以本合同约定内容为准。资管合同未尽事宜，依据托管协议的约定执行。</p>