

银河金汇证券资产管理有限公司

关于银河金汇辰星FOF双周增利1号集合资产管理计划 修改资产管理合同等法律文件生效的公告

尊敬的投资者：

银河金汇证券资产管理有限公司管理的“银河金汇辰星FOF双周增利1号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）成立于2021年12月9日。根据法律法规变更和产品运作的需要，管理人对本集合计划的资产管理合同、说明书、风险揭示书中部分条款进行修改，同时就资产管理合同、说明书、风险揭示书变更事宜进行公告并向投资者征询意见。

截至2023年8月28日，同意本次资产管理合同等法律文件变更的投资者数量及规模达到本集合计划存续条件。

因此，自本公告发布之日起，本集合计划资产管理合同、说明书、风险揭示书等法律文件修改内容正式变更生效。

特此公告。

附件：

- “银河金汇辰星FOF双周增利1号集合资产管理计划”资产管理合同等法律文件主要变更内容对照表
- 关于发布《关于修改“银河金汇辰星FOF双周增利1号集合资产管理计划”资产管理合同等法律文件征求投资者意见函》的公告及管理人、托管人已达成一致的公告
- 银河金汇辰星FOF双周增利1号集合资产管理计划资产管理合同补充协议（一）
- 银河金汇辰星FOF双周增利1号集合资产管理计划说明书
- 银河金汇辰星FOF双周增利1号集合资产管理计划风险揭示书

银河金汇证券资产管理有限公司

2023年8月29日

附件 1：“银河金汇辰星 FOF 双周增利 1 号集合资产管理计划”资产管理合同等法律文件主要变更内容对照表

变更前条款	变更后条款
第 4 部分 合同当事人	
<p>(二) 管理人</p> <p>管理人名称：银河金汇证券资产管理有限公司</p> <p>法定代表人：郭卿</p> <p>住所：为深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）</p> <p>联系地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦 7 层</p> <p>联系电话：010-89623090</p> <p>联系人：易千</p>	<p>(二) 管理人</p> <p>管理人名称：银河金汇证券资产管理有限公司</p> <p>法定代表人：刘冰</p> <p>住所：为深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）</p> <p>联系地址：北京市丰台区西营街 8 号院 1 号楼青海金融大厦 7 层</p> <p>联系电话：010- 89623282</p> <p>联系人：张祖阁</p>
第 5 部分 集合计划的基本情况	
<p>2、主要投资方向：</p> <p>本集合计划可投资如下资产：</p> <p>在银行间市场和上海证券交易所、深圳证券交易所等经国务院同意设立的交易市场交易的国债、地方政府债、央行票据、金融债（政策性银行债券、商业银行债券、非银行金融机构债券）、可交换债券、可转换债券、可分离交易债券、次级债、企业债（含项目收益债）、公司债（包括面向公众公开发行、面向合格投资者公开发行以及非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具（PPN）、资产支持票据、资产支持证券等，以及债券逆回购、纯债型基金、银行存款（包括活期存款和定期存款、协定存款）、同业存单、货币市场基金、</p>	<p>2、主要投资方向：</p> <p>本集合计划可投资如下资产：</p> <p>在银行间市场和上海证券交易所、深圳证券交易所等经国务院同意设立的交易市场交易的国债、地方政府债、央行票据、金融债（政策性银行债券、商业银行债券、非银行金融机构债券）、可交换债券、可转换债券、次级债、企业债（含项目收益债）、公司债（包括面向公众公开发行、面向合格投资者公开发行以及非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具（PPN）、资产支持票据、资产支持证券等，以及债券逆回购、债券型基金、银行存款（包括活期存款和定期存款、协定存款）、同业存单、货币市场基金、证券公司和保险公司（含证券公司和保险公司资产管理子公司）固定收益类集合资产管理计划、期货公司及期货公司资产管理子公司</p>

<p>券商固收类集合资产管理计划。特别揭示：本集合计划投资逆回购、正回购。投资者不可撤销地一致同意并授权管理人可以将计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易；投资者在此同意并授权可以将集合计划资产部分或全部投资于由管理人以及关联方（及其母公司的关联方）发行或代销或管理的金融产品，以及由管理人提供专业服务（包括但不限于作为管理人、投资顾问等）的金融产品；投资者同意并授权管理人可以代表本集合计划与管理人以及管理人母公司中国银河证券股份有限公司签署相关协议。管理人应遵循本计划份额持有人利益优先的原则、遵守相关法律的规定进行操作、积极防范利益冲突。</p> <p>发生关联交易事后，管理人应在 5 个工作日内通过管理人网站以公告的方式或其他书面方式通知投资者和托管人，并按法律法规、监管规定履行报告义务。</p> <p>本集合计划投资非标准化资产的，应当穿透披露具体投资标的，暂未确定具体投资标的的，应当至少每季度于季度报告中披露。如涉及关联交易，将一并披露关联交易相关情况。</p>	<p>固定收益类集合资产管理计划、银行（包括银行理财子公司）理财产品。</p> <p>特别揭示：本集合计划可在交易所和银行间市场进行债券正回购、逆回购。</p>
<p>第 5 部分 集合计划的基本情况</p>	
<p>3、投资比例</p> <p>（1）投资于公开募集证券投资基金、券商固收类集合资产管理计划比例不</p>	<p>3、投资比例</p> <p>（1）投资于债券型基金、货币市场基金、证券公司和保险公司（含证券公司和保险公司资产</p>

<p>低于计划总资产的 80%;</p>	<p>管理子公司) 固定收益类集合资产管理计划、期货公司及期货公司资产管理子公司固定收益类集合资产管理计划、银行(包括银行理财子公司) 理财产品的比例不低于计划总资产的 80%;</p>
<p>第 8 部分计划的参与、退出与转让</p>	
<p>4、告知客户的方式 管理人将通过管理人网站公告巨额退出及连续巨额退出的处理方式。</p>	<p>4、告知客户的方式 发生巨额退出并延期支付时, 管理人应通过管理人网站公告, 并说明有关处理办法的处理方式。</p>
<p>第 8 部分计划的参与、退出与转让</p>	
<p>六、管理人自有资金参与 1、自有资金参与的条件: 管理人以自有资金参与本集合计划, 应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》和中国证监会及中国证券业协会、证券投资基金业协会的相关规定。 2、自有资金的参与方式: 管理人以自有资金参与本集合计划, 将在本集合计划销售机构参与。 3、自有资金参与的份额和比例: 参与份额不超过本集合计划总份额 16%, 具体参与金额以管理人公告为准。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本集合计划总份额的 50%。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, 管理人有权及时调整。 4、自有资金的收益分配: 管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他投资者享有同等收益分配的权利和义务。 5、自有资金责任承担方式和金额: 除</p>	<p>六、管理人自有资金参与 1、自有资金参与的条件: 管理人以自有资金参与本集合计划, 应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》和中国证监会及中国证券业协会、证券投资基金业协会的相关规定。 2、自有资金的参与方式: 管理人以自有资金参与本集合计划, 将在本集合计划销售机构参与。 3、自有资金参与的份额和比例: 管理人参与份额不超过本计划总份额的 16%, 具体参与金额以管理人公告为准。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的份额合计不得超过本集合计划总份额的 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, 管理人有权及时调整。 4、自有资金的收益分配: 管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他投资者享有同等收益分配的权利和义务。 5、自有资金责任承担方式和金额: 除本合同另有约定外, 管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他投资者享有同等权利和义</p>

<p>本合同另有约定外，管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他投资者享有同等权利和义务。</p> <p>6、自有资金退出的条件：管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于6个月（监管允许自有资金持有期限可少于6个月的情形、或者本合同另有约定的情形除外）。存续期内，管理人以自有资金参与、退出本集合计划时，应当提前5个工作日通过管理人网站公告，告知投资者和托管人。</p> <p>为应对集合计划巨额赎回（如有），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，管理人以自有资金参与及其后续退出集合计划可不受本项前段以及“六、管理人自有资金参与之第（3）项自有资金参与份额和比例的限制，但需事后及时告知客户和资产托管机构，并按照相关规定向监管机构报备。</p> <p>7、风险揭示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本集合计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本集合计划规模变动情况，控制流动性风险。</p> <p>8、信息披露：存续期内，管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前5个工作日通过管理人网站公告参与、退出时间和参与、退出金额等信息（监管允许可不予提前告知或者合同另有约定等情形除外）。</p>	<p>务。</p> <p>6、自有资金退出的条件：管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于6个月（监管允许自有资金持有期限可少于6个月的情形、或者本合同另有约定的情形除外）。存续期内，管理人以自有资金参与、退出本集合计划时，应当提前5个工作日通过管理人网站公告，告知全体投资者并通过邮件或双方认可的其他方式告知托管人，并取得其同意；投资者不同意，管理人保障其退出的权利。</p> <p>为应对集合计划巨额赎回（如有），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，管理人以自有资金参与及其后续退出集合计划可不受本项前段以及“六、管理人自有资金参与”之第3项自有资金参与份额和比例的限制，但需事后及时告知客户和资产托管机构，并按照相关规定向监管机构报告。</p> <p>开放期内因投资者退出导致管理人自有资金投资“被动超标”的，管理人退出本资管计划时可不受前述“应当提前5个工作日”告知全体投资者和托管人的限制，但需事后及时告知投资者和托管人。</p> <p>7、风险揭示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本集合计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本集合计划规模变动情况，控制流动性风险。</p> <p>8、信息披露：存续期内，管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前5个工作日通过管理人网站公告参与、退出时间和参与、退出金额以及持有期限等信息（监管允许可不予提前告知或者合同另有约定等情形除外）。</p>
<p>第 11 部分 集合计划的投资</p>	
<p>1、投资范围</p> <p>本集合计划可投资如下资产：</p>	<p>1、投资范围</p> <p>本集合计划可投资如下资产：</p>

在银行间市场和上海证券交易所、深圳证券交易所等经国务院同意设立的交易市场交易的国债、地方政府债、央行票据、金融债（政策性银行债券、商业银行债券、非银行金融机构债券）、可交换债券、可转换债券、可分离交易债券、次级债、企业债（含项目收益债）、公司债（包括面向公众公开发行、面向合格投资者公开发行以及非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具（PPN）、资产支持票据、资产支持证券等，以及债券逆回购、纯债型基金、银行存款（包括活期存款和定期存款、协定存款）、同业存单、货币市场基金、券商固收类集合资产管理计划。

特别揭示：本集合计划投资逆回购、正回购。

投资者不可撤销地一致同意并授权管理人可以将计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易；特别地，投资者在此同意并授权可以将集合计划资产部分或全部投资于由管理人以及关联方（及其母公司的关联方）发行或代销或管理的金融产品，以及由管理人提供专业服务（包括但不限于作为管理人、投资顾问等）的金融产品；投资者同意并授权管理人可以代表本集合计划与管理人以及管理人母公司中国银河证券股份有限公司签署相关协议。管理人应遵循本计划份额持有人利益优先的原

在银行间市场和上海证券交易所、深圳证券交易所等经国务院同意设立的交易市场交易的国债、地方政府债、央行票据、金融债（政策性银行债券、商业银行债券、非银行金融机构债券）、可交换债券、可转换债券、次级债、企业债（含项目收益债）、公司债（包括面向公众公开发行、面向合格投资者公开发行以及非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具（PPN）、资产支持票据、资产支持证券等，以及债券逆回购、债券型基金、银行存款（包括活期存款和定期存款、协定存款）、同业存单、货币市场基金、证券公司和保险公司（含证券公司和保险公司资产管理子公司）固定收益类集合资产管理计划、期货公司及期货公司资产管理子公司固定收益类集合资产管理计划、银行（包括银行理财子公司）理财产品。

特别揭示：本集合计划可在交易所和银行间市场进行债券正回购、逆回购。

<p>则、遵守相关法律的规定进行操作、积极防范利益冲突。</p> <p>发生关联交易事后，管理人应在 5 个工作日内通过管理人网站以公告的方式或其他书面方式通知投资者和托管人，并按法律法规、监管规定履行报告义务。</p> <p>本集合计划投资非标准化资产的，应当穿透披露具体投资标的，暂未确定具体投资标的的，应当至少每季度于季度报告中披露。如涉及关联交易，将一并披露关联交易相关情况。</p>	
<p>第 11 部分 集合计划的投资</p>	
<p>2、投资比例</p> <p>(1) 投资于公开募集证券投资基金、券商固收类集合资产管理计划比例不低于计划总资产的 80%；</p>	<p>2、投资比例</p> <p>(1) 投资于债券型基金、货币市场基金、证券公司和保险公司（含证券公司和保险公司资产管理子公司）固定收益类集合资产管理计划、期货公司及期货公司资产管理子公司固定收益类集合资产管理计划、银行（包括银行理财子公司）理财产品的比例不低于计划总资产的 80%；</p>
<p>第 11 部分 集合计划的投资</p>	
<p>3、资产管理计划改变投向和比例的，新增上述投资范围外的投资品种或各类型资产投资比例的，应当事先取得投资者同意，由全体投资者、管理人和托管人协商一致并签署补充协议对本章节内容进行变更。</p>	<p>3、资产管理计划改变投向和比例的，新增上述投资范围外的投资品种或各类型资产投资比例的，应当事先取得投资者同意，按照本合同第 25 部分约定履行合同变更程序。</p>
<p>第 11 部分 集合计划的投资</p>	
<p>三、投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 15 个工作日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、证券发行人合并、集合</p>	<p>三、投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 15 个工作日内将投资比例降至许可范围内；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</p>

<p>资产管理计划规模变动等管理人之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应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>人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时根据监管部门要求备案或报告（如需）。</p>
------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

第 15 部分 利益冲突及关联交易

<p>投资者不可撤销地一致同意并授权管理人可以将计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易；投资者在此同意并授权可以将集合计划资产部分或全部投资于由管理人以及关联方（及其母公司的关联方）发行或代销或管理的金融产品，以及由管理人提供专业服务（包括但不限于作为管理人、投资顾问等）的金融产品；投资者同意并授权管理人可以代表本集合计划与管理人以及管理人母公司中国银河证券股份有限公司签署相关协议。管理人应遵循本计划份额持有人利益优先的原则、遵守相关法律的规定进行操作、积极防范利益冲突。</p> <p>发生关联交易事后，管理人应在 5 个工作日内通过管理人网站以公告的方式或其他书面方式通知投资者和托管人，并按法律法规、监管规定履行报告义务。</p> <p>本集合计划投资非标准化资产的，应当穿透披露具体投资标的，暂未确定具体</p>	<p>（一）利益冲突的情形</p> <p>1、投资者不可撤销地同意并授权管理人可以将计划的资产从事一般关联交易；特别地，对于将计划的资产从事重大关联交易的，管理人应事先采取逐笔征求意见或公告确认等方式征得投资者的同意；投资者不同意的，管理人保障其退出的权利。</p> <p>2、法律法规、中国证监会等监管机构规定的其他情形。</p> <p>（二）利益冲突的处理方式</p> <p>1、当管理人利益与投资者利益冲突时，保护投资者利益为原则；</p> <p>2、当投资者之间利益冲突时，以公平对待为原则；对不同投资组合在购买同一投资品种时进行集中交易，公平分配，确保交易的公平性。</p> <p>（三）发生关联交易事后，管理人应及时通知投资者和托管人，并按法律法规、监管规定履行报告义务。</p> <p>（四）管理人关于具体关联方范围、一般和重大关联交易的区分标准、关联交易审批等内部管控机制、关联方的定义等，详见以下内容，如证券期货经营机构私募资产管理业务相关法律法规、中国证券投资基金业协会自律规范有最新要求的，以最新要求为准。</p> <p>1、管理人私募资产管理计划从事一般关联交易</p>
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<p>投资标的的，应当至少每季度于季度报告中披露。如涉及关联交易，将一并披露关联交易相关情况。</p>	<p>及重大关联交易的区分标准以及关联交易的范围和主要审批程序</p> <p>(1) 以下关联交易属于本资产管理计划的重大关联交易：</p> <p>a、运用资产管理产品财产买卖管理人、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的证券或承销期内承销的证券；</p> <p>b、单笔债券、股票、证券投资基金等交易标的的交易金额超过资产管理产品资产净值 10% 的关联交易；</p> <p>c、单笔交易标的的交易金额超过（含）2 亿人民币的关联交易；</p> <p>d、中国证监会和中国证券投资基金业协会认定的属于资产管理产品重大关联交易的其他事项。</p> <p>(2) 本资产管理计划从事重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，遵循投资者利益优先原则，采取有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益，相关交易应提交管理人投资决策委员会审批。</p> <p>(3) 重大关联交易以外的关联交易属于一般关联交易。一般关联交易应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，采取有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益，根据管理人授权管理制度由投资部门决策。</p> <p>(4) 本资产管理计划的关联交易的情形包括但不限于：</p> <p>a、买卖关联方发行的证券或承销期内承销的证券；</p> <p>b、以关联方为交易对手进行银行间和交易所市场的交易；</p> <p>c、通过关联方席位或交易单元进行资产管理产品交易；</p>
-----------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>d、向资产管理计划关联方收取管理费、支付报酬；</p> <p>e、以关联方债券作为质押券进行逆回购交易；</p> <p>f、认购或赎回管理人管理的其他资产管理计划；</p> <p>g、接受关联方提供产品销售、投资顾问等第三方服务；</p> <p>h、管理人资产管理计划与“管理人控股股东之控股股东直接或间接控制的企业”之间的关联交易除应符合《银河金汇证券资产管理有限公司私募资产管理产品关联交易管理实施细则》外，应按照管理人母公司中国银河证券股份有限公司关联交易相关规定和关联交易协议安排进行；</p> <p>i、根据实质重于形式原则认定的其他通过约定可能引致资源或者义务转移的其他事项。</p> <p>2、管理人私募资产管理计划项下关联方范围和管理人关联方的披露方式</p> <p>（1）本资产管理计划的关联方包括本资产管理计划管理人、本资产管理计划托管人、前述机构的控股股东、实际控制人及与其存在重大利害关系的主体，与本资产管理计划存在重大利益关系的其他关联方，法律法规对本资产管理计划关联方有明确规定的，从其规定。包括但不限于：</p> <p>a、管理人；</p> <p>b、管理人股东、管理人股东的股东、管理人实际控制人；</p> <p>c、与管理人受同一机构控制的其他机构；</p> <p>d、管理人或管理人股东的关键管理人员及与其关系密切的家庭成员；</p> <p>e、管理人关键管理人员或与其关系密切的家庭成员控制、共同控制或施加重大影响的其他企业；</p>
--	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

f、资产管理计划的托管人、与其有控股关系或有其他重大利害关系的机构；

g、资产管理计划的投资顾问、与其有控股关系或有其他重大利害关系的机构；

h、资产管理计划的境外托管人、境外投资顾问、与境外投资顾问存在控制关系的公司。

i、其他可能与资产管理计划存在重大利益关系的业务主体。

(2)管理人关联方以管理人公开披露的信息为准。

3、本合同项下关联交易的定义

本合同项下关联交易是指本计划与关联方之间发生转移资源或义务的事项，而不论是否收取价款。

(五)关联交易的交易决策、对价确定机制：

1、关联交易应当符合本合同第十一部分约定的投资目标及策略；

2、关联交易审批等具体管控流程：

对于经公司判断属于关联交易的，公司业务部门按照《银河金汇证券资产管理有限公司私募资产管理产品关联交易管理实施细则》规定的审批程序，一般关联交易根据公司授权管理制度由投资部门决策，重大关联交易提请投资决策委员会审批。公司业务部门在提交相应审批程序时，应提交关于本笔拟进行的关联交易的详细资料，包括但不限于：公司法律合规部对关联交易的判断意见说明、关联交易发生的背景说明、关联方的主体资格证明（法人营业执照或自然人身份证明）、与关联交易有关的协议、合同或任何其他书面安排、关联交易定价的依据性文件材料、关联交易对公司和股东合法权益的影响说明等。

3、关联交易对价确定机制：

(1)本资产管理计划关联交易定价应当公允，

参照下列原则执行：

a、交易标的如果存在公开市场交易价格，可以参考该价格；

b、交易标的如果存在第三方估值定价的，可以参考该价格；

c、交易标的既无公开市场交易价格亦无第三方估值定价的，可以参考关联方与独立于关联方的第三方发生非关联交易价格；

d、前述三种情况均不适用的，可以参考以投资标的账面值或资产评估机构的评估价值。

（2）本资产管理计划关联交易定价方法

a、关联交易的定价主要依据市场价格；如果没有市场价格，按照成本加成定价；如果既没有市场价格，也不适合采用成本加成价的，按照协议价定价；

b、交易双方根据关联交易事项的具体情况确定定价方法，并在相关的关联交易协议中予以明确。

上述“市场价”是指以市场价为准确定商品或劳务（服务）的价格及费率；上述“成本加成价”是指在交易的商品或劳务（服务）的成本基础上加合理利润确定交易价格及费率；上述“协议价”是指由交易双方协商确定价格及费率。

（3）本资产管理计划关联交易定价适用范围

a、买卖关联方发行的证券或承销期内承销的证券，以关联方为交易对手进行银行间和交易所市场的交易，以关联方债券作为质押券进行逆回购交易，认购或赎回公司管理的其他资产管理计划可以参考采用市场价法确定交易价格；

b、通过关联方席位或交易单元进行资产管理计划交易可以参考采用协议价法确定交易价格；

c、向资产管理计划关联方收取管理费、支付报酬，接受关联方提供产品销售、投资顾问等第

	<p>三方服务优先采用市场价法确定交易价格，如果没有市场价格，可以参考采用协议价确定交易价格。</p> <p>d、其他未列明的关联交易应该采用适合该交易类型的定价方法，特殊事项如确需改变上述类别产品交易定价方法，应当提供该关联交易价格的确定原则及其评估方法，并对该定价的公允性作出评估说明。</p>
<p>第 16 部分 投资经理的指定及变更</p>	
<p>一、投资经理的指定</p> <p>本集合计划的投资经理由管理人负责指定。</p> <p>投资经理：易千</p> <p>易千：北京大学历史学学士、管理学硕士，财政部中国财政科学研究院经济学博士，8年证券从业经验。2013年加入华安财保资产管理有限责任公司，先后任研究员、投资经理。2016年加入银河金汇证券资产管理有限公司固定收益投资部，主要从事固定收益类产品投资工作，管理多支券商资管产品。已获得基金从业资格，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>一、投资经理的指定</p> <p>本集合计划的投资经理由管理人负责指定。</p> <p>投资经理：周磊蕾、张祖阁</p> <p>周磊蕾：北京大学硕士，13年证券从业经验。2010-2015年在信达证券资产管理部先后从事研究员、投资助理、投资管理等工作。2015年加入银河金汇证券资产管理有限公司，担任投资经理，主要从事固定收益类、混合类、FOF以及QDII等产品的投资管理工作。已取得证券从业资格、基金从业资格，具有投资主办人资格，最近三年内未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>张祖阁，加拿大维多利亚大学经济学硕士学历，具有8年金融行业从业经验，2015年7月加入银河金汇证券资产管理有限公司。已获得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施及行政处罚。</p>
<p>第 19 部分 越权交易的界定</p>	
<p>1、投资范围</p> <p>本集合计划可投资如下资产： 在银行间市场和上海证券交易所、深圳证券交易所等经国务院同意设立的交易市场交易的国债、地方政府债、央行票据、金融债（政策性银行债券、商业银行债券、非银行金融机构债券）、可</p>	<p>1、投资范围</p> <p>本集合计划可投资如下资产： 在银行间市场和上海证券交易所、深圳证券交易所等经国务院同意设立的交易市场交易的国债、地方政府债、央行票据、金融债（政策性银行债券、商业银行债券、非银行金融机构债券）、可交换债券、可转换债券、次级债、企业</p>

<p>交换债券、可转换债券、可分离交易债券、次级债、企业债（含项目收益债）、公司债（包括面向公众公开发行、面向合格投资者公开发行以及非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具(PPN)、资产支持票据、资产支持证券等，以及债券逆回购、纯债型基金、银行存款（包括活期存款和定期存款、协定存款）、同业存单、货币市场基金、券商固收类集合资产管理计划。</p> <p>特别揭示：本集合计划投资逆回购、正回购。</p> <p>2、投资比例</p> <p>（1）投资于公开募集证券投资基金、券商固收类集合资产管理计划比例不低于计划总资产的 80%；</p>	<p>债（含项目收益债）、公司债（包括面向公众公开发行、面向合格投资者公开发行以及非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具(PPN)、资产支持票据、资产支持证券等，以及债券逆回购、债券型基金、银行存款（包括活期存款和定期存款、协定存款）、同业存单、货币市场基金、证券公司和保险公司（含证券公司和保险公司资产管理子公司）固定收益类集合资产管理计划、期货公司及期货公司资产管理子公司固定收益类集合资产管理计划、银行（包括银行理财子公司）理财产品。</p> <p>特别揭示：本集合计划可在交易所和银行间市场进行债券正回购、逆回购。</p> <p>2、投资比例</p> <p>（1）投资于债券型基金、货币市场基金、证券公司和保险公司（含证券公司和保险公司资产管理子公司）固定收益类集合资产管理计划、期货公司及期货公司资产管理子公司固定收益类集合资产管理计划、银行（包括银行理财子公司）理财产品的比例不低于计划总资产的 80%；</p>
<p>第 20 部分 集合计划财产的估值和会计核算</p>	
<p>（五）固定收益品种的估值方法</p> <p>（5）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>（6）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</p>	<p>（五）固定收益品种的估值方法</p> <p>（5）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；</p> <p>（6）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</p>

<p>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。</p> <p>（7）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。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，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。</p>	<p>活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。</p> <p>（7）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>
--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

第 20 部分 集合计划财产的估值和会计核算

<p>2、具体投资品种估值方法</p> <p>（七）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>A. 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；</p> <p>B. 首次公开发行未上市的股票、存托凭证和权证，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>（八）流通受限股票，按以下方法估值：流通受限股票，是指明确带有一定限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受</p>	<p>2、具体投资品种估值方法</p> <p>（七）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>A. 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；</p> <p>B. 首次公开发行未上市的股票、存托凭证和权证，采用估值技术确定公允价值；</p> <p>（八）流通受限股票，按以下方法估值：流通受限股票，是指明确带有一定限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受</p>
-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<p>发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票。</p> <p>$FV = S \times (1 - LoMD)$</p> <p>其中：FV 为估值日该流通受限股票的价值；S 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价；LoMD 为该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣，该流动性折扣一般由中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司发布提供。</p> <p>当估值日中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司未提供该流动性折扣时，则优先采用距估值日最近交易日中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的流动性折扣进行估值处理。若中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司从未提供该流通受限股票的流动性折扣，则按估值日该流通受限股票在证券交易所上市交易的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。</p>	<p>限股票。</p> <p>$FV = S \times (1 - LoMD)$</p> <p>其中：FV 为估值日该流通受限股票的价值；S 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价；LoMD 为该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣，该流动性折扣一般由中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司发布提供。</p> <p>管理人负责联系第三方机构提供流动性折扣率。</p>
-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

第 23 部分 风险揭示

<p>（一）特殊风险揭示</p> <p>4、产品备案风险</p> <p>因监管政策的原因导致备案不成功的风险由投资者自行承担。如计划备案不成功，管理人可在收到备案不成功信息后三十个工作日内，将已认购资金及投资收益（如有）返还给投资者。如计划资产暂时无法变现或仅能部分变现的，管理人可先将可变现部分变现后按比</p>	<p>（一）特殊风险揭示</p> <p>4、产品备案风险</p> <p>因监管政策的原因导致最终备案不成功的风险由投资者自行承担。如计划最终备案不成功，管理人应当在收到备案不成功的信息后及时告知投资者，管理人可在收到备案不成功信息后三十个工作日内，将已认购资金及投资收益（如有）返还给投资者。如计划资产暂时无法变现或仅能部分变现的，管理人可先将可变现部分</p>
---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<p>例返还给投资者，剩余部分在后续一次或多次变现后及时按比例向投资者进行返还，直至全部变现并返还完毕。</p>	<p>变现后按比例返还给投资者，剩余部分在后续一次或多次变现后及时按比例向投资者进行返还，直至全部变现并返还完毕。</p>
----------------------------------------------------------	---------------------------------------------------------------

第 23 部分 风险揭示

<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>8、关联交易风险 (如有)</p> <p>投资者不可撤销地同意并授权管理人可以将本计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易；投资者在此同意并授权可以将集合计划资产部分或全部投资于由管理人以及关联方 (及其母公司的关联方) 发行或代销或管理的金融产品，以及由管理人提供专业服务 (包括但不限于作为管理人、投资顾问等) 的金融产品；投资者同意并授权管理人可以代表本集合计划与管理人以及管理人母公司中国银河证券股份有限公司签署相关协议。管理人在进行该等关联交易或者从事其他重大关联交易的，虽然管理人积极遵循本计划份额持有人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因管理人运用本计划资产从事关联交易被监管部门认为存在重大风险，且管理人无法确保选择进行交易的实际交易结果 (就投资结束后的实际损益情况而言) 比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，进而可能影响本计划份额持有人的利益。此外，管理人运用本计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制</p>	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>8、关联交易风险 (如有)</p> <p>①一般关联交易的风险提示</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从事本合同已经明确列明的一般关联交易情形，管理人无需就前述具体一般关联交易再行分别取得投资者的授权。管理人承诺该等一般关联交易投资应公平对待计划财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益，并依据相关要求履行信息披露和监管报告义务。投资者存在未及时关注管理人的信息披露内容的风险。</p> <p>②重大关联交易的风险提示</p> <p>对于将计划的资产从事重大关联交易的，管理人应事先采取逐笔征求意见或公告确认等方式征得投资者的同意；投资者不同意的，管理人保障其退出的权利。若投资者未及时更新有效联系方式，可能影响管理人征求其意见的效率，进而可能影响本计划的投资策略实施。</p> <p>此外，对于上述一般关联交易和重大关联交易，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，但仍存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响投资者的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。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，进而可能影响计划财产的投资收益。如果因托管人未及时向管理人提供关联方名单导致</p>
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<p>相关权利的行使，进而可能影响本计划资产的投资收益。此外，若将来法律、行政法规及中国证监会的规定对于本计划的关联交易做出新的监管要求的，本计划将按照届时最新的监管要求进行调整，该等调整可能会对本计划的投资收益造成影响。如果因托管人未及时向管理人提供关联方名单导致管理人无法审查相关投资是否构成关联交易的，管理人不承担相关责任。此外，管理人按照投资策略和资管合同约定投资由管理人以及关联方（及其母公司的关联方）发行或代销或管理的金融产品，以及由管理人提供专业服务（包括但不限于作为管理人、投资顾问等）的金融产品等情形，相关费用具体以本资管合同以及产品项下所签署的投资协议为准，请投资者特别知悉。</p>	<p>管理人无法审查相关投资是否构成关联交易的，管理人不承担相关责任。</p>
<p>根据 2023 年 1 月 12 日证监会令第 203 号修订的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》和 2023 年 1 月 12 日证监会公告【2023】2 号修订的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作规定》，原合同内涉及“向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告”，或“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”等相关条款，修改为“根据监管部门要求备案或报告（如需）”。</p>	

银河金汇辰星 FOF 双周增利 1 号集合资产管理计划说明书、风险揭示书涉及以上变更内容的相应进行调整。