

# 关于第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划 合同变更的确认函

致：国泰君安证券股份有限公司

为维护客户利益，我司拟为托管在贵司的“第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划”（以下简称“本计划”）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《第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同变更明细表》）：

- 1、补充合同订立依据；
- 2、修改释义；
- 3、修改当事人及权利义务；
- 4、调整期货和金融衍生品类资产表述；
- 5、修改管理人自有资金参与、退出资产管理计划安排；
- 6、修改资产管理计划的关联交易安排；
- 7、变更风险揭示条款；

根据本计划资产管理合同的约定，本次合同变更程序安排如下：

- 1、我司与贵司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生效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、如合同变更生效，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。

鉴于贵司为本集合计划的托管人，请贵司对本次变更内容予以确认。

第一创业证券股份有限公司

二〇二三年七月五日



附件：第一创业智选 FOF1 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

我司已知悉，并同意贵司在《关于第一创业智选 FOF1 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。请贵司按照《第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十五章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”第（一）条“资产管理合同的变更”的约定，履行相应的合同变更程序。

国泰君安证券股份有限公司（盖章）



签署日：二〇二三年七月六日

附件：第一创业智选 FOF1 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	一、前言	<p>(一) 订立本合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本合同的<b>依据</b>是《中华人民共和国合同法》(以下简称“《合同法》”)、《中华人民共和国证券法》(以下简称“《证券法》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称“《管理办法》”)、《证券期货经营机构私募资产管理业务暂行规定》(以下简称“《运作管理规定》”)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称“《指导意见》”)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》(以下简称“《合同指引》”)等法律、行政法规以及中国人民银行、中国证监会和中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)的有关规定。</p> <p>3、订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护本合同各方当事人的合法权益。</p>	<p>(一) 订立本合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本合同的<b>依据</b>是《中华人民共和国民法典》(以下简称“《民法典》”)、《中华人民共和国证券法》(以下简称“《证券法》”)、《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》”)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称“《管理办法》”)、《证券期货经营机构私募资产管理业务暂行规定》(以下简称“《运作管理规定》”)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称“《指导意见》”)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》(以下简称“《合同指引》”)等法律、行政法规以及中国人民银行、中国证监会和中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)的有关规定。</p> <p>3、订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护本合同各方当事人的合法权益。</p>



	<p>(二) 对于本计划的设立、变更、展期、终止、清算等安排，管理人将按照中国证监会和基金业协会的要求向基金业协会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出机构。</p>	<p>(二) 对于本计划的设立、变更、展期、终止、清算等安排，管理人将按照相关监管要求向基金业协会或管理人住所地中国证监会派出机构进行备案或报告，具体以监管机构的要求为准。</p>
<p>2</p> <p>二、释义</p>	<p>6、《管理办法》：指 2018 年 10 月 22 日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其不时做出的修订和补充；</p> <p>7、《运作管理规定》：指 2018 年 10 月 22 日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其不时做出的修订和补充；</p> <p>13、销售机构：指第一创业证券股份有限公司，及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本集合资产管理计划的机构；</p> <p>16、合格投资者：指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额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，且满足下列三项条件之一</p>	<p>6、《管理办法》：指中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其不时做出的修订和补充；</p> <p>7、《运作管理规定》：指中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其不时做出的修订和补充；</p> <p>13、销售机构：指第一创业证券股份有限公司，及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本集合资产管理计划的机构，具体以管理人网站公告为准；</p> <p>16、合格投资者：指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额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，且满足下列三项条件之一的自</p>

	<p>的自然人：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；</p> <p>(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、在基金业协会登记的私募基金管理人、商业保理公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及其他机构；</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>23、工作日、交易日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日；</p> <p>39、集合计划单位净值、单位净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划总份额的金额；</p>	<p>然人：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；</p> <p>(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、在基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业保理公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及其他机构；</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>23、工作日、交易日：指上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所的正常交易日；</p> <p>39、集合计划单位净值、单位净值、份额净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日集合计划总份额的金额；</p>
--	--	--

	<p>三、承诺与声明</p> <p>3</p>	<p>(三) 委托人的承诺与声明</p> <p>1、委托人声明委托资产为其拥有合法处分权的资产，保证委托资产的来源及用途符合国家有关规定，保证有完全及合法的授权管理人和托管人进行委托资产的投资管理和托管业务，保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人和托管人对该委托资产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑。</p> <p>5、委托人承诺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的集合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。委托人承认，管理人、托管人未对委托财产的本金不受损失以及收益状况作出任何承诺或担保。</p>	<p>(三) 委托人的承诺与声明</p> <p>1、委托人声明委托资产为其拥有合法处分权的资产，保证参与资产的来源及用途符合国家有关规定，保证有完全及合法的授权管理人和托管人进行参与资产的投资管理和托管业务，保证没有任何其他限制性条件妨碍管理人和托管人对该委托资产行使相关权利且该权利不会为任何其他第三方所质疑。</p> <p>5、委托人承诺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的集合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。委托人承认，管理人、托管人未对委托财产的本金不受损失以及收益状况作出任何承诺或担保，本合同约定的业绩报酬计提基准(如有)、业绩比较基准(如有)不是管理人的保证。</p>
<p>四、当事人及权利义务</p> <p>4</p>	<p>(二) 管理人</p> <p>机构名称：第一创业证券股份有限公司</p> <p>法定代表人：刘学民</p>	<p>(二) 管理人</p> <p>机构名称：第一创业证券股份有限公司</p> <p>法定代表人：吴礼顺</p>	



	<p>住所地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼</p> <p>通讯地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 3B 层</p> <p>邮政编码：518046</p> <p>联系人：邹乐凯</p> <p>联系电话：0755-23838270</p> <p>(三) 托管人</p> <p>机构名称：国泰君安证券股份有限公司</p> <p>法定代表人/负责人：贺青</p> <p>住所地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号</p> <p>通讯地址：上海市静安区新闻路 669 号 19 楼</p> <p>邮政编码：</p> <p>联系人：丛艳</p> <p>联系电话：021-38677336</p> <p>(六) 管理人的权利与义务</p> <p>1、管理人的权利</p> <p>(4) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律、法规规定、对本计划财产及其他当</p>	<p>住所地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼</p> <p>通讯地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 层</p> <p>邮政编码：518046</p> <p>联系人：宋焱</p> <p>联系电话：0755-23838738</p> <p>(三) 托管人</p> <p>机构名称：国泰君安证券股份有限公司</p> <p>法定代表人/负责人：贺青</p> <p>住所地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号</p> <p>通讯地址：上海市静安区新闻路 669 号 19 楼</p> <p>邮政编码：200040</p> <p>联系人：丛艳</p> <p>联系电话：021-38677336</p> <p>(六) 管理人的权利与义务</p> <p>1、管理人的权利</p> <p>(4) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律、法规规定、对本计划财产及其他当事人的利</p>
--	--	---



	<p>事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会；</p> <p>(8) 发现委托人或委托资产涉嫌洗钱的，有权按照《中华人民共和国反洗钱法》和相关规定履行报告义务；</p> <p>(12) 本计划投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品，委托人为资产管理产品的，或管理人有合理理由认为委托人认购本计划将违反《管理办法》的，管理人有权拒绝该等委托人认购本计划，并有权对其认购申请做确认失败处理而无需承担任何责任；</p> <p>2、管理人的义务</p> <p>(17) 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；</p> <p>(19) 按照法律法规与本合同的约定，编制向委托人披露的本计划季度、年度等定期报告，向基金业协会备案，并抄报管理人住所地中国证监会派出机构；</p> <p>(23) 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</p>	<p>益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会，<b>具体以监管机构要求为准</b>；</p> <p>(8) 发现委托人或本计划资产涉嫌洗钱的，有权按照《中华人民共和国反洗钱法》和相关规定履行报告义务；</p> <p>(12) 本计划投资除<b>公开募集</b>证券投资基金以外的其他资产管理产品，委托人为资产管理产品的，或管理人有合理理由认为委托人认购本计划将违反《管理办法》的，管理人有权拒绝该等委托人认购本计划，并有权对其认购申请做确认失败处理而无需承担任何责任；</p> <p>2、管理人的义务</p> <p>(17) 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；</p> <p>(19) 按照法律法规与本合同的约定，编制向委托人披露的本计划季度、年度等定期报告；</p> <p>(23) 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>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>(24) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告管理人住所地中国证监会派出机构、基金业协会并通知托管人和受托人；</p> <p>(25) 本计划投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品的，管理人应审查该等资产管理产品不得再投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产；</p> <p>(七) 托管人的权利与义务</p> <p>1、托管人的权利</p> <p>(3) 照相关法律法规的规定和本合同约定，根据《托管人投资监督事项表》行使投资监督权利。发现管理人的投资运作违反法律、行政法规规定或本合同《托管人投资监督事项表》的约定时，有权拒绝执行投资指令或进行事后提示并要求管理人改正；管理人未能改正或者造成委托财产损失的，有权报告监管机构，具体以监管机构的要求为准；</p> <p>2、托管人的义务</p> <p>(9) 编制托管年度报告，并向基金业协会备案，抄报管</p>	<p>(24) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告管理人住所地中国证监会派出机构、基金业协会并通知托管人和受托人，具体以监管机构要求为准；</p> <p>(25) 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>(七) 托管人的权利与义务</p> <p>1、托管人的权利</p> <p>(3) 按照相关法律法规的规定和本合同约定，根据《托管人投资监督事项表》行使投资监督权利。发现管理人的投资运作违反法律、行政法规规定或本合同《托管人投资监督事项表》的约定时，有权拒绝执行投资指令或进行事后提示并要求管理人改正；管理人未能改正或者造成委托财产损失的，有权报告监管机构，具体以监管机构要求为准；</p> <p>2、托管人的义务</p> <p>(9) 编制托管年度报告，报送管理人所在地中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准；</p> <p>(13) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令</p>
--	--	---

		<p>理人所在地中国证监会派出机构；</p> <p>(13) 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《托管人投资监督事项表》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权报告管理人住所地中国证监会派出机构，<b>具体以监管机构要求为准；</b></p> <p>(14) 通过邮件或者管理人服务平台向管理人提供其控股股东、实际控制人及其他关联方的名单并及时更新；</p> <p>(15) 国家有关法律、法规、监管机构规定的和本合同约定的其他义务。</p>	<p>违反法律、行政法规、中国证监会的规定或本合同《托管人投资监督事项表》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权报告管理人住所地中国证监会派出机构，<b>具体以监管机构要求为准；</b></p> <p>(14) 通过邮件或者管理人服务平台向管理人提供其控股股东、实际控制人及其他关联方的名单并及时更新；</p> <p>(15) 国家有关法律、法规、监管机构规定的和本合同约定的其他义务。</p>
5	五、资产管理计划的基本情况	<p>(五) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例</p> <p>2、本计划的投资方向为：</p> <p>(1) 金融产品类资产：公募证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募证券投资基金</p>	<p>(五) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例</p> <p>2、本计划的投资方向为：</p> <p>(1) 资产管理产品：公开募集证券投资基金、证券公司及基金公司子公司集合资产管理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募证券投资基金</p>



	<p>协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、货币市场基金、银行非保本理财产品、及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品。</p> <p>(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。</p> <p>(3) 衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货。</p> <p>3、本计划的投资比例为：本计划为混合类产品，投资于金融产品类资产的比例不低于 80%；直接或通过投向金融产品类资产进行以下比例的资产配置：</p> <p>(1) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%；</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%；</p> <p>(3) 商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值不超过资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。</p> <p>(十三) 预警止损机制</p>	<p>市场基金、银行非保本理财产品、及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品。</p> <p>(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货。</p> <p>3、本计划的投资比例为：本计划投资于资产管理产品的比例不低于资产总值的 80%；并直接或通过投向资产管理产品类资产进行以下比例的资产配置：</p> <p>(1) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例低于资产总值的 80%；</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例低于资产总值的 80%；</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%或期货和衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。</p> <p>(十三) 预警止损机制</p> <p>本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额</p>
--	--	--



	<p>本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额单位净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人于 R 日日终计划份额单位净值核对一致后 2 个工作日内以邮件或其他资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：</p> <p>1、本计划预警线为 0.8200 元。当本计划份额日终单位净值 &lt;0.8200 元时（该交易日称为“R”日），则自 R+2 日起，管理人仅可进行卖出、赎回非现金类资产和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至 0.8200 元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>2、本计划止损线为 0.8000 元。本计划份额日终单位净值 &lt;0.8000 元时（该交易日称为“R”），则自 R+2 日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的当日为本计划提前终止日。</p>	<p>单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额单位净值低于预警线或止损线，资产托管人于 R 日日终计划份额单位净值核对一致后 2 个工作日内（含）内以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：</p> <p>1、本计划预警线为 0.8200 元。当本计划份额日终单位净值 &lt;0.8200 元时（该交易日称为“R”日），则自 R+2 日起，管理人仅可进行卖出、赎回非现金类资产和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至 0.8200 元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>2、本计划止损线为 0.8000 元。本计划份额日终单位净值 &lt;0.8000 元时（该交易日称为“R”），则自 R+2 日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的当日为本计划提前终止日。</p> <p><b>预警线和止损线仅为风险控制目的设置，并不表示本计划的单</b></p>
--	---	--

		合同提前终止日。	位净值触及预警线和止损线时，管理人能够按照相应的净值对全部资产进行变现。管理人不得以任何方式向投资者保证投资一定盈利，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。
6	六、资产管理计划的募集	<p>(一) 资产管理计划的募集期限、募集对象、销售机构和募集方式</p> <p>2、募集对象</p> <p>本计划仅向符合《运作管理规定》规定的合格投资者销售。合格投资者人数累计不得超过200人。</p> <p>委托人为金融产品的，或管理人认为合理理由认为委托人认购本计划将违反《管理办法》的，管理人有权拒绝该等委托人认购本计划，并有权对其认购申请做确认失败处理而无需承担任何责任。</p>	<p>(一) 资产管理计划的募集期限、募集对象、销售机构和募集方式</p> <p>2、募集对象</p> <p>本计划仅向符合《运作管理规定》规定的合格投资者销售。合格投资者人数累计不得超过200人。</p> <p>委托人为资产管理产品的，或管理人认为合理理由认为委托人认购本计划将违反本合同规定或《管理办法》的，管理人有权拒绝该等委托人认购本计划，并有权对其认购申请做确认失败处理而无需承担任何责任。</p>
7	七、资产管理计划的成立与备案	<p>(三) 资产管理计划的成立和备案</p> <p>本计划的募集金额缴足之日起10个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报</p>	<p>(三) 资产管理计划的成立和备案</p> <p>本计划的募集金额缴足之日起10个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报</p>

	<p>具验资报告，并在取得验资报告后公告本计划成立。</p> <p>管理人应当在本计划成立之日起5个工作日内将本合同、投资者名单与认购金额、验资报告等材料向基金业协会备案，同时抄报管理人住所地中国证监会派出机构。</p> <p>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>(四) 本计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，但管理人以现金管理为目的，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、货币市场基金除外。</p>	<p>告，并在取得验资报告后公告本计划成立。</p> <p>管理人应当在本计划成立之日起5个工作日内将本合同、投资者名单与认购金额、验资报告等材料向基金业协会备案，同时抄报管理人住所地中国证监会派出机构，<b>具体以监管机构的要求为准。</b></p> <p>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>(四) 本计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，但管理人以现金管理为目的，<b>投资于银行活期存款、货币市场基金除外。</b></p>
<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p> <p>8</p>	<p>(一) 资产管理计划的参与、退出</p> <p>4、参与和退出的方式、价格、程序及确认等</p> <p>(1) “未知价”原则，即参与价格为注册登记机构受理参与申请日(T日)本计划的单位净值，退出价格为注册登记机构受理退出申请当日本计划单位净值；</p> <p>(2) 本计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以</p>	<p>(一) 资产管理计划的参与、退出</p> <p>4、参与和退出的方式、价格、程序及确认等</p> <p><b>增加第(3)点并顺延后续标号</b></p> <p>(1) “未知价”原则，即参与价格为注册登记机构受理参与申请日(开放日)本计划的单位净值，退出价格为注册登记机构受理退出申请当日(开放日)本计划单位净值；</p>



	<p>金额申请，退出以份额申请；</p> <p>5、参与和退出的金额限制</p> <p>当委托人持有的本计划份额资产净值高于人民币 400,000 元时，委托人可以在本计划的退出开放期内选择全部或者部分退出本计划，选择部分退出的，委托人在退出后持有的本计划份额资产净值不得低于人民币 400,000 元。当管理人发现委托人申请部分退出本计划将导致其在部分退出申请确认后持有的本计划份额净值低于人民币 400,000 元的，管理人有权适当减少该委托人的退出份额，以保证部分退出申请确认后该委托人持有的本计划份额资产净值不低于人民币 400,000 元。当委托人持有的本计划份额资产净值低于（含）人民币 400,000 元时，需要退出本计划的，委托人应当选择一次性全部退出本计划，否则管理人有权发起强制退出委托人持有的本计划全部份额。</p> <p>6、参与和退出的费用</p> <p>(2) 退出费用</p> <p>本计划退出费率如下：</p>	<p>(2) 本计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请；</p> <p>(3) 本计划可采用预约参与退出机制，如采用预约参与退出机制，管理人应公告披露具体预约方案，委托人需至少提前五个工作日（T-5 日）在销售机构提出预约申请，具体以销售机构的交易系统规则为准。若委托人在预约参与/退出期未提交预约申请的，则管理人有权拒绝委托人的申请；若监管另有要求的，从其规定。</p> <p>5、参与和退出的金额限制</p> <p>当委托人持有的本计划份额资产净值高于人民币 400,000 元时，委托人可以在本计划的退出开放期内选择全部或者部分退出本计划，选择部分退出的，委托人在退出后持有的本计划份额资产净值不得低于人民币 400,000 元，否则管理人有权对委托人持有的本计划全部份额发起强制赎回，赎回委托人持有的本计划全部份额。</p> <p>当委托人持有的本计划份额资产净值低于（含）人民币 400,000 元时，需要退出本计划的，委托人应当选择一次性全部退出本计划，否则管理人有权发起强制退出委托人持有的本计划全部份额。</p> <p>6、参与和退出的费用</p>
--	---	--



	<table border="1" data-bbox="240 1061 371 1749"> <tr> <td data-bbox="240 1532 371 1749">退出费率</td> <td data-bbox="240 1267 371 1532">持有期<math>\geq 365</math>天 0</td> <td data-bbox="240 1061 371 1267">持有期<math>&lt; 365</math>天 1%</td> </tr> </table> <p data-bbox="387 1061 1315 1845">7、参与份额和退出金额的计算 (2) 退出金额的计算 退出金额=退出总额-实际退出费-管理人业绩报酬 (如有) 退出总额=退出份额<math>\times</math>注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值 实际退出费=原始退出费-返回退出费 返回退出费=原始退出费<math>\times</math> (管理人业绩报酬 (如有) / 单位净值) / 确认份额 原始退出费=退出总额<math>\times</math>退出费率 注: 退出金额结果按照四舍五入方法, 保留小数点后两位, 多笔退出时, 按上述公式进行逐笔计算。 8、退出预约申请的提出 委托人在提交退出申请前, 需提前 10 个工作日向管理人提出书面退出预约申请, 未提交退出预约申请的, 管理人有权拒绝其退出申请。</p>	退出费率	持有期 $\geq 365$ 天 0	持有期 $< 365$ 天 1%	<p data-bbox="240 801 288 1061">(2) 退出费用</p> <p data-bbox="320 725 352 1061">本计划退出费率如下:</p> <table border="1" data-bbox="368 230 499 1061"> <tr> <td data-bbox="368 748 499 1061">退出费率</td> <td data-bbox="368 483 499 748">持有期<math>\geq 365</math>天 0%</td> <td data-bbox="368 230 499 483">持有期<math>&lt; 365</math>天 1%</td> </tr> </table> <p data-bbox="515 230 671 1061">退出费用由赎回本计划的委托人承担, 在委托人赎回本计划份额时收取。委托人申请退出本计划时发生的退出费用全额计入计划资产。</p> <p data-bbox="703 613 735 1061">7、参与份额和退出金额的计算</p> <p data-bbox="767 725 799 1061">(2) 退出金额的计算</p> <p data-bbox="831 230 924 1061">退出费= (退出份额<math>\times</math>注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值-管理人业绩报酬 (如有)) <math>\times</math> 退出费率;</p> <p data-bbox="956 230 1048 1061">退出金额=退出份额<math>\times</math>注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值-管理人业绩报酬 (如有) -退出费;</p> <p data-bbox="1080 230 1173 1061">注: 退出金额结果按照四舍五入方法, 保留小数点后两位, 多笔退出时, 按上述公式进行逐笔计算。</p> <p data-bbox="1204 636 1236 1061">删除第 8 点并顺延后续序号。</p> <p data-bbox="1268 613 1300 1061">8、巨额退出的认定和处理方式</p>	退出费率	持有期 $\geq 365$ 天 0%	持有期 $< 365$ 天 1%
退出费率	持有期 $\geq 365$ 天 0	持有期 $< 365$ 天 1%						
退出费率	持有期 $\geq 365$ 天 0%	持有期 $< 365$ 天 1%						

	<p>9、巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(2) 巨额退出的处理方式</p> <p>当出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出。巨额退出的价格以注册登记机构受理退出申请当日的本计划单位净值为准。</p> <p>本计划单位净值的计算精确到0.0001元，但在发生巨额退出的情形下，为避免委托人利益因份额净值的小数点保留精度受到重大影响，管理人可以通过设立巨额退出情形下的净值精度应急调整机制从而提高份额净值的精度。届时，管理人在与托管人协商一致的情况下，发布关于净值精度调整的公告。</p> <p>12、拒绝或暂停参与的情况及处理方式</p> <p>(8) 委托人为金融产品的，或管理人有合理理由认为委托人认购本计划将违反《管理办法》的；</p> <p>(五) 管理人自有资金参与资产管理计划</p> <p>1、自有资金参与的条件</p> <p>管理人可以在初始募集期间或存续期内，以自有资金参与本计划，如管理人以自有资金参与，则自有资金所持本计划份</p>	<p>(2) 巨额退出的处理方式</p> <p>当出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出。巨额退出的价格以注册登记机构受理退出申请当日的本计划单位净值为准。</p> <p>本计划单位净值的计算精确到0.0001元，但在发生巨额退出的情形下，为避免委托人利益因份额净值的小数点保留精度受到重大影响，管理人可以通过设立巨额退出情形下的净值精度应急调整机制从而提高份额净值的精度，从而尽量减轻本计划单位净值异常波动的可能，从整体上减轻对委托人利益的影响。若管理人启用净值精度应急调整机制的，管理人将通过公告、邮件等方式告知委托人及托管人。</p> <p>11、拒绝或暂停参与的情况及处理方式</p> <p>(8) 委托人为资产管理产品的，或管理人有合理理由认为委托人认购本计划将违反《管理办法》的；</p> <p>(五) 证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金参与、退出资产管理计划</p> <p>1、证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金参与的</p>
--	--	---

	<p>额不高于本计划总份额的 20%，且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本计划总份额的 50%。</p> <p>管理人持有计划份额与其他委托人持有的本计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与所持本计划份额相对应损失的责任。管理人投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。</p> <p>2、自有资金参与、退出的条件</p> <p>(1) 自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。</p> <p>(2) 管理人自有资金参与、退出本计划时应当提前 5 个工作日通知委托人和托管人。</p> <p>但在发生以下特殊情形时，管理人自有资金参与、退出可以不受上述条件限制，但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知委托人和托管人，并向住所地中国证监会派出机构及基金业协会报告：</p> <p>(1) 因规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与份额比例被动超限或可能被动超限（即超过或可能超过本计划总份额 20%），管理人在发生上述超限情形或可能超限情形之日起</p>	<p>条件</p> <p>在初始募集期间或存续期内，证券期货经营机构、其子公司（孙公司）可以自有资金参与本计划。证券期货经营机构包括证券公司、基金管理公司、期货公司及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司，具体范围以中国证监会、基金业协会等监管机构的要求为准。如参与，则证券期货经营机构、其子公司（孙公司）以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。</p> <p>法律法规或者中国证监会对证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金投资比例另有规定的，从其规定。</p> <p>证券期货经营机构、其子公司（孙公司）持有计划份额与其他委托人持有的本计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与所持本计划份额相对应损失的责任。证券期货经营机构、其子公司（孙公司）投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。</p> <p>2、证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金参与、退出的条件</p> <p>(1) 证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。</p>
--	--	--



	<p>5个工作日内退出超限部分的参与份额，5个工作日内仍超限的，管理人将在其后5个工作日处理。</p> <p>(2) 为应对本计划巨额赎回或解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，管理人自有资金参与、退出本计划。</p> <p><b>3、风险揭示和信息披露</b></p> <p>(1) 管理人以自有资金参与本计划的份额，享有与其他委托人份额相同的收益分配权，且不对本计划其他委托人承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。</p> <p>(2) 管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本计划规模变动情况，控制流动性风险。</p> <p>(六) 管理人将按照法律法规及基金业协会的要求，定期将本计划投资者变更情况报送基金业协会。</p>	<p>(2) 证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金在存续期内参与、退出本计划时应当提前5个工作日以公告或其他方式通知全体委托人，并书面征求托管人意见。委托人不同意证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金参与、退出的，应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请。未提出退出申请的，视同委托人已经同意证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金参与、退出。</p> <p>(3) 委托人和托管人签署本合同即视为同意证券期货经营机构、其子公司（孙公司）可以自行决定在初始募集期间以自有资金参与本计划。</p> <p>但在发生以下特殊情形时，证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金参与、退出可以不受上述条件限制，但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知委托人和托管人，并向所在地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准：</p> <p>1) 因规模变动等客观因素导致证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金参与份额比例被动超限或可能被动超限【即证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金投资比例被动超过</p>
--	---	---



		<p>或可能被动超过《证券公司风险控制指标计算标准规定》等中国证监会对证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金投资比例的规定，或证券期货经营机构、其子公司（孙公司）以自有资金参与本计划的份额合计超过或可能超过本计划总份额的 50%】，证券期货经营机构、其子公司（孙公司）在发生上述超限情形或可能超限情形之日起 5 个工作日内退出超限部分的参与份额，5 个工作日后仍超限的，证券期货经营机构、其子公司（孙公司）将在其后 5 个工作日处理。本合同当事人一致同意，该条款由资产管理人自行监控。</p> <p>2) 为应对本计划巨额赎回或解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金参与、退出本计划。</p> <p><b>3、风险揭示和信息披露</b></p> <p>(1) 证券期货经营机构、其子公司（孙公司）以自有资金参与本计划的份额，享有与其他委托人份额相同的收益分配权，且不对本计划其他委托人承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。</p> <p>(2) 证券期货经营机构、其子公司（孙公司）自有资金退出，</p>
--	--	--

		<p>可能遭遇流动性风险，从而影响本计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本计划规模变动情况，控制流动性风险。</p> <p>(六) 管理人将按照法律法规及基金业协会的要求，定期将本计划投资者变更情况报送基金业协会，具体以监管机构的要求为准。</p>
<p>9 十一、资产管理计划的投资</p>	<p>(二) 资产管理计划的投资范围及投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>(1) 金融类产品资产：公募证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、货币市场基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品；</p> <p>(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。</p> <p>(3) 衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的期</p>	<p>(二) 资产管理计划的投资范围及投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>(1) 资产管理产品：公开募集证券投资基金、证券公司及基金公司子公司集合资产管理计划、基金公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、货币市场基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品；</p> <p>(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的</p>

	<p>权及期货。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划为混合类产品，投资于金融产品分类资产的比例不低于80%，直接或通过投向金融产品类资产进行以下比例的资产配置：</p> <p>(1) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的0-80%；</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例为资产总值的0-80%；</p> <p>(3) 商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值不超过资产总值的80%或衍生品账户权益不超过资产总值的20%。</p> <p>本计划投资于上述资产管理产品的，计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，且按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产金额需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，并按照所投资资产管理产品的披露频率更新计划所投资资产的金额或比例。</p> <p>(三) 如因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管</p>	<p>期权及期货。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划投资于资产管理产品的比例不低于资产总值80%，并直接或通过投向资产管理产品进行以下比例的资产配置：</p> <p>(1) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例低于资产总值的80%；</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例低于资产总值的80%；</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的80%或期货和衍生品账户权益不超过资产总值的20%。</p> <p>本计划投资于上述资产管理产品的，计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，本计划投资于上述资产管理产品中的公募基金证券投资基金的，按照穿透原则合并计算投资同类资产的金额需符合本计划资产配置比例的要求；本计划投资于上述资产管理产品中其他资产管理产品的，按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率更新计划所投资资产的金额或比例。</p>
--	--	--



	<p>理计划规模变动等管理人主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、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，管理人应在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的15个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p> <p>(四) FOF 产品所投资金融产品的选择标准</p> <p>本集合计划根据宏观经济运行情况及投资风格表现制定资产配置策略，对全市场的子基金管理人进行深入的分析研究，将市场上投资管理能力强、投资风格清晰、投资收益稳定的子基金管理人作为标准，筛选并对子基金管理人实地尽调、业绩归因分析等多种方式评估及管理，本集合计划投资于上述子基金管理人成立的金融产品，其中选择投资的金融产品主要策略标准为股票多头策略、股票中性策略、CTA 策略、现金及准现金类资产投资策略。</p> <p>(七) 资产管理计划的投资策略</p>	<p>(三) 如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主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、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，管理人应在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的20个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内，<b>具体以监管机构的要求为准</b>。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告，<b>具体以监管机构的要求为准</b>。</p> <p>(四) FOF 产品所投资资产管理产品的选择标准</p> <p>本集合计划根据宏观经济运行情况及投资风格表现制定资产配置策略，对全市场的子基金管理人进行深入的分析研究，将市场上投资管理能力强、投资风格清晰、投资收益稳定的子基金管理人作为标准，筛选并对子基金管理人实地尽调、业绩归因分析等多种方式评估及管理，本集合计划投资于上述子基金管理人成立的资产管理计划、私募证券投资基金等资产管理产品，<b>选择投资的子基金主要投资策略为现金及准现金类资产投资策略、股票多头策略、股票中性策略和 CTA 策略，其中 CTA 策略为较低比例的投资策略</b>。</p>
--	--	--

	<p>2、FOF 投资管理策略</p> <p>在 FOF 的投资管理模式下，第一创业证券作为管理人，负责根据宏观经济运行情况及投资风格表现制定资产配置策略，选聘市场上投资管理能力强、投资风格清晰、投资收益稳定的私募基金管理人，投资于上述私募基金管理人成立的私募基金，并对私募基金管理人的投资业绩进行评估及管理。</p> <p>(1) 子基金管理人筛选</p> <p>对全市场的私募基金管理人进行分析研究，采用漏斗式，逐层深入的方式进行筛选，并创立了 4P+1S 管理人评级体系，通过多数数据库、多策略覆盖方式对私募基金管理人进行全市场覆盖；通过多维度数量模型建立投资基础池；通过实地尽调、业绩归因分析、策略甄别建立重点池；通过独特的 Alpha 因子、业绩可持续性分析、稳定架构等建立的核心池。</p> <p>(八) 资产管理计划的投资限制及禁止行为</p> <p>1、为维护委托人的合法权益，本计划的投资限制为：</p> <p>(1) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资</p>	<p>(七) 资产管理计划的投资策略</p> <p>2、FOF 投资管理策略</p> <p>在 FOF 的投资管理模式下，第一创业证券作为管理人，负责根据宏观经济运行情况及投资风格表现制定资产配置策略，选聘市场上投资管理能力强、投资风格清晰、投资收益稳定的管理人，投资于上述管理人成立的资产管理产品，并对管理人的投资业绩进行评估及管理。</p> <p>(1) 子基金管理人筛选</p> <p>对全市场的管理人进行分析研究，采用漏斗式，逐层深入的方</p> <p>式进行筛选，并创立了 4P+1S 管理人评级体系，通过多数数据库、多资产类别、多策略覆盖方式对管理人进行全市场覆盖；通过多维度数量模型建立基础池；通过实地尽调、业绩归因分析、策略甄别建立重点池；通过独特的 Alpha 因子、业绩可持续性分析、稳定架构等建立的核心池。</p> <p>(八) 资产管理计划的投资限制及禁止行为</p> <p>1、为维护委托人的合法权益，本计划的投资限制为：</p> <p>(1) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净</p>
--	---	--

	<p>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%，单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算。 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。本计划属于基金中基金资产管理计划（FOF），基金中基金资产管理计划投资“定制”的子基金，并持有 1 个或多个子基金产品的全部份额的，可豁免单一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%的组合投资要求；</p> <p>（3）本计划投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品的，该等资产管理产品不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品，金融监管机构另有规定的除外；</p> <p>（4）现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。</p>	<p>值的 25%；除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外，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%，单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算。 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。本计划属于基金中基金资产管理计划（FOF），基金中基金资产管理计划投资“定制”的子基金，并持有 1 个或多个子基金产品的全部份额的，可豁免单一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%的组合投资要求；</p> <p>（3）本计划投资除公募基金以外的其他资产管理产品的，该等资产管理产品不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品，金融监管机构另有规定的除外；</p> <p>（4）本计划投资除公募基金以外的其他资产管理产品的，该等资产管理产品不得再投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产。</p> <p>现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，</p>
--	---	--



	<p>2、禁止行为</p> <p>(13) 不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：</p> <p>1) 投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录；</p> <p>2) 投资项目违反国家环境保护政策要求；</p> <p>3) 通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。</p> <p>(14) 不得将本计划财产用于投资房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款或补充流动资金；前述关于“房地产价格上涨过快热点城市”、“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定，以基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第4号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准。</p> <p>(15) 本计划不得直接投资于商业银行信贷资产；</p> <p>(16) 本计划不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；</p>	<p>应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>增加(13)、(14)、(15)、(16)点并顺延后续序号</p> <p>(13) 利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品 或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；</p> <p>(14) 为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；</p> <p>(15) 开展明股实债投资；</p> <p>(16) 通过投资于资产管理产品变相扩大投资范围或者规避监管要求；</p> <p>(17) 投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形：</p> <p>1) 投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录；</p> <p>2) 投资项目违反国家环境保护政策要求；</p>
--	---	---

	<p>(17) 本计划不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域；</p> <p>(18) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p> <p>上述禁止行为由管理人监控。</p> <p>(九) 资产管理计划的建仓期</p> <p>管理人将在本计划成立之日起6个月内，使本计划的投资组合比例符合上述关于投资比例的约定。建仓期的投资活动，应当符合本合同约定的投向和本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、货币市场基金的除外。</p> <p>(十) 本计划投资的资产组合的流动性与本计划参与、退出的安排相匹配，具体为：本计划拟投资的私募证券投资基金均投资于资本市场，有较好流动性，私募基金设有提前预约赎回安排，在特殊或紧急情况下，私募基金支持临开放退出，确保本计划在开放退出期内可以满足以下投资安排：</p>	<p>3) 通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。</p> <p>(18) 将本计划财产用于投资房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款或补充流动资金；前述关于“房地产价格上涨过快热点城市”、“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定，以基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第4号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准。</p> <p>(19) 直接投资于商业银行信贷资产；</p> <p>(20) 违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；</p> <p>(21) 直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行为和领域；</p> <p>(22) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。</p> <p>(九) 资产管理计划的建仓期</p> <p>管理人将在本计划成立之日起6个月内，使本计划的投资组合比例符合上述关于投资比例的约定。建仓期的投资活动，应当符合本合同约定的投向和本计划的风险收益特征。以现金管理为目的，</p>
--	--	---

	<p>(十一) 预警止损机制</p> <p>本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人于 R 日日终计划份额单位净值核对一致后 2 个工作日（含）内以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：</p> <p>1、本计划预警线为 0.8200 元。当本计划份额日终单位净值 &lt; 0.8200 元时（该交易日称为“R”日），则自 R+2 日起，管理人仅可卖出、赎回金融产品和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至 0.8200 元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>2、本计划止损线为 0.8000 元。本计划份额日终单位净值 &lt; 0.8000 元时（该交易日称为“R”日），则自 R+2 日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，</p>	<p>投资于银行活期存款、货币市场基金的除外。</p> <p>(十) 本计划投资的资产组合的流动性与本计划参与、退出的安排相匹配，具体为：本计划拟投资的资产管理产品等金融产品有较好流动性；除此之外，本计划在开放退出期进行以下安排确保本计划投资的资产组合的流动性与本计划参与、退出的安排相匹配：</p> <p>(十一) 预警止损机制</p> <p>本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额净值低于预警线或止损线，资产托管人于 R 日日终计划份额单位净值核对一致后 2 个工作日（含）内以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：</p> <p>1、本计划预警线为 0.8200 元。当本计划份额日终单位净值 &lt; 0.8200 元时（该交易日称为“R”日），则自 R+2 日起，管理人仅可卖出、赎回非现金类资产和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至</p>
--	---	--



	<p>直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的当日为本合同提前终止日。</p>	<p>0.8200元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>2、本计划止损线为0.8000元。本计划份额日终单位净值&lt;0.8000元时（该交易日称为“R”），则自R+2日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的当日为本计划提前终止日。</p> <p>预警线和止损线仅为风险控制目的设置，并不表示本计划的单位净值触及预警线和止损线时，管理人能够按照相应的净值对全部资产进行变现。管理人不得以任何方式向投资者保证投资一定盈利，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>十四、利益冲突及关联交易</p> <p>10</p>	<p>（四）资产管理计划的关联交易</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于管理人、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。</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价</p>	<p>（四）资产管理计划的关联交易</p> <p>1、关联方范围</p> <p>本计划所称关联方包括：</p> <p>（1）本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）；</p> <p>（2）本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联</p>

	<p>格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。管理人将本计划财产投资于管理人、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，或者从事其他重大关联交易的，应在交易完成后，书面告知委托人和托管人并向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。投资于证券期货的关联交易还应当及时向证券期货交易所报告。</p> <p>除将本计划财产投资于管理人、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者承销期内承销的证券外，管理人不得将本计划财产直接或者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。全部委托人均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者不包含募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品）且单个委托人投资金额不低于1000万元，并且事先取得委托人同意的除外。</p>	<p>方；</p> <p>(3) 本计划的投资顾问(如有)、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>(4) 与管理人、本计划的托管人、投资顾问(如有)有其他重大利害关系的机构。</p> <p>上述第(1)项为管理人全部资产管理计划的关联方；第(2)(3)项为本计划的关联方。</p> <p>监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p> <p>2、关联交易范围：本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p> <p>(1) 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方(含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司)发行或者承销期内承销的证券；</p> <p>(2) 本计划财产投资于本计划托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>(3) 本计划财产投资于其投资顾问(如有)、投资顾问的控股股</p>
--	---	---

		<p>东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>(4) 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方(含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司)担任管理人的资产管理产品(含公募基金)；</p> <p>(5) 本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；</p> <p>(6) 本计划财产投资于投资顾问(如有)担任管理人的资产管理产品(含公募基金)；</p> <p>(7) 本计划财产以本计划关联方或者以本条第(4)、(5)、(6)项规定的资产管理产品为交易对手,进行询价交易(包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款等)；</p> <p>(8) 本计划财产以本计划关联方或者以本条第(4)、(5)、(6)项规定的资产管理产品为交易对手,进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第(五)项规定的非标准化资产交易；</p>
--	--	--



		<p>(9) 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的(如 本计划财产开展逆回购交易的, 将交易对手、质押券等统一纳入管理), 管理人遵照执行。</p> <p>3、一般关联交易和重大关联交易</p> <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。</p> <p>重大关联交易是指投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品且金额及比例重大的(本计划为 FOF 产品或本计划投资于货币基金的除外)、与关联方及关联方产品互为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大的询价交易等需强化审批、披露、报告的关联交易; 一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的, 以监管机构和基金业协会的相关要求为准。本计划财产不进行关联交易。</p> <p>4、关联交易的内部控制</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则, 以公平、合理的市场价格进行交易, 防范利益冲突, 禁止利益输送。公司制定了相应的内控管理制度, 明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关</p>
--	--	--

		<p>联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。</p> <p>5、产品关联方名单披露方式</p> <p>本产品的关联方名单信息将通过公告的形式在管理人指定网站上披露或其他适当的方式通知委托人。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>6、其他</p> <p>除将本计划财产投资于管理人、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者承销期内承销的证券外，管理人不得将本计划财产直接或者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。全部委托人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</p>
--	--	--

		于1000万元，并且事先取得委托人同意的除外。
11	<p>十六、资产管理计划的财产</p>	<p>(一) 资产管理计划财产的保管与处分</p> <p>1、本计划财产的债务由本计划财产本身承担责任，委托人以其出资为限对本计划财产的债务承担责任。</p> <p>.....</p> <p>本计划证券账户、专用交易单元及投资所需的其他账户应由管理人报证券交易所、证券登记结算机构以及管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会备案。</p>
12	<p>十七、投资指令的发送、确认和执行</p>	<p>(一) 交易清算授权</p> <p>管理人应当事先向托管人提供加盖管理人公章和法定代表人(或授权代表)名章的书面授权通知书(下称“授权通知”), 指定有权向托管人发送投资指令的被授权人员(下称“被授权人”), 包括被授权人的名单、权限、预留印鉴、签字样本或签章, 并注明相应的交易权限及授权通知生效日期。</p> <p>授权通知应当以传真或双方认可的其他方式送达托管人, 并在送达之日起10个工作日内以原件形式送达托管人。授权通知应当载明生效日期, 生效日期不早于托管人收到传真件或扫描件之日。</p>



	<p>扫描件之日。托管人收到的传真件或扫描件与原件所载不一致的，以传真件或扫描件为准，因托管人未收到上述传真件或扫描件或授权通知载明的生效日期早于托管人收到上述传真件或扫描件之日而造成的损失，托管人不承担责任。</p> <p>(二) 投资指令的内容</p> <p>投资指令是管理人在管理本计划财产时，管理人向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应当写明款项事由、到账时间、金额、收款账户信息等，加盖预留印鉴并有被授权人签字或签章。</p> <p>.....</p> <p>管理人应确保所提供的上述文件合法、真实、完整和有效。交易文件应载明真实的资金来源为本计划，并明确上述投资到期或产品赎回后本金及收益将返回至本计划托管资金账户，如确有真实原因致使交易文件不能载明上述内容的，管理人应在上述投资到期或产品赎回/终止后将本金及收益返回至本计划托管资金账户。如果管理人无法提供上述交易文件的，托管人有权拒绝执行投资划款指令。管理人应确保上述交易文件的始</p>	<p>托管人收到的传真件或扫描件与原件所载不一致的，以传真件或扫描件为准。</p> <p>(二) 投资指令的内容</p> <p>投资指令是管理人在管理本计划财产时，管理人向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应当写明款项事由、到账日期、金额、收款账户信息等，加盖预留印鉴并有被授权人签字或签章。</p> <p>.....</p> <p>管理人应确保所提供的上述文件合法、真实、完整和有效。交易文件应载明真实的资金来源为本计划，并明确上述投资到期或产品赎回后本金及收益将返回至本计划托管资金账户，如确有真实原因致使交易文件不能载明上述内容的，管理人应在上述投资到期或产品赎回/终止后将本金及收益返回至本计划托管资金账户。如果管理人无法提供上述交易文件的，托管人有权拒绝执行投资指令。管理人应确保上述交易文件的始终有有效性、真实性、准确性。</p> <p>(三) 投资指令的发送、确认及执行时间和程序</p>
--	--	--





	<p>预留印鉴相符、相关的指令附件齐全且头寸充足的投资指令。</p> <p>由管理人原因造成的指令传输不及时、发送指令错误，未能留出足够划款所需时间、资金账户中未有足额余额，致使资金未能及时到账所造成的损失，托管人不承担责任。</p> <p>托管人收到管理人发送的指令后，应当对指令是否由被授权人发送、指令的要素是否齐全、指令印鉴与签字是否与预留的授权文件内容表面相符进行审慎验证，复核无误后应在规定期限内及时执行，不得延误。若存在管理人未按时提供被授权人的预留印鉴和签字样本、表面一致性不符或出现本条第(五)项约定的管理人发出错误指令的情形时，托管人有权拒绝执行，并及时与管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。托管人可以要求管理人提供相关资料，以确保托管人有足够的资料来判断投资指令的有效性。</p> <p>管理人向托管人下达指令时，应确保本计划资金账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发送的指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人，托管人不</p>	<p>错误指令的情形时，托管人有权拒绝执行，并及时与管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。</p> <p>托管人可以要求管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断投资指令的有效性。</p> <p>管理人向托管人下达指令时，应确保本计划资金账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发送的指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人。管理人应按照本合同约定向托管人发送指令。</p> <p>(四) 托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序</p> <p>托管人发现管理人发送的指令违反法律法规规定或本合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并及时以书面形式通知管理人并有权向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定或本合同约定的，应及时以书面形式通知管理人并有权向管理人住所地中国证监会派出机构报告，<b>具体以监管机构的要求为准。</b></p> <p>(五) 管理人发送错误指令的情形和处理程序</p>
--	---	---



	<p>承担因为不执行该指令而造成损失的责任。管理人应按照本合同约定向托管人发送指令。</p> <p>(四) 托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序</p> <p>托管人发现管理人发送的指令违反法律法规规定或本合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并及时以书面形式通知管理人并有权向管理人住所所在地中国证监会派出机构及基金业协会报告。托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定或本合同约定的，应及时以书面形式通知管理人并有权向管理人住所所在地中国证监会派出机构及基金业协会报告。</p> <p>(五) 管理人发送错误指令的情形和处理程序</p> <p>管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。托管人发现管理人的指令错误时，应按照本条第(三)项规定的程序进行处理，由此造成的损失，托管人不承担责任。</p> <p>(八) 其他相关责任</p> <p>托管人正确执行管理人符合法律法规规定、本合同约定的</p>	<p>管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。</p> <p>托管人发现管理人的指令错误时，应按照本条第(三)项规定的程序进行处理。</p> <p>(八) 其他相关责任</p> <p>托管人正确执行管理人符合法律法规规定、本合同约定的投资指令，本计划财产发生损失的，由<b>过错方</b>承担责任。在遵循本合同约定的业务受理渠道及在指令预留处理的时间内，因托管人过错未能及时或正确执行符合法律法规规定、本合同约定的投资指令而导致本计划财产损失，托管人应当承担相应的赔偿责任，但托管账户及其他账户余额不足或托管人如遇到不可抗力情况除外。</p>
--	--	--

	<p>投资指令，本计划财产发生损失的，托管人不承担责任。在遵循本合同约定的业务受理渠道及在指令预留处理的时间内，因托管人过错未能及时或正确执行符合法律法规规定、本合同约定的投资指令而导致本计划财产损失，托管人应当承担相应的赔偿责任，但托管账户及其他账户余额不足或托管人如遇到不可抗力情况除外。</p> <p>如果管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非托管人原因造成的情形，只要托管人根据本合同相关约定验证有关印鉴与签名无误，托管人不承担因正确执行有关指令而给管理人或资产管理计划财产或任何第三人带来的损失。</p>	
<p>十九、越权交易的界定</p> <p>13</p>	<p>(二) 越权交易的处理程序</p> <p>1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为为</p> <p>托管人对于越权交易，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，应当拒绝执行并立即要求管理人改正；未能改正或者造成本计划财产损失，托管人应当及时通知管理人并有权报告管理人住所所在地中国证监会派出机构及基金业协会，</p>	<p>(二) 越权交易的处理程序</p> <p>1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为为</p> <p>托管人对于越权交易，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，应当拒绝执行并立即要求管理人改正；未能改正或者造成本计划财产损失，托管人应当及时通知管理人并有权报告管理人住所所在地中国证监会派出机构及基金业协会，</p>

		<p>当及时通知管理人并有权报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会。</p> <p>根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人应当立即通知管理人，管理人在收到通知后应当及时核对或纠正。</p> <p>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。管理人对于托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会。</p>	<p><b>具体以监管机构的要求为准。</b></p> <p>根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人应当立即通知管理人，管理人在收到通知后应当及时核对或纠正。</p> <p>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。管理人对于托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会，<b>具体以监管机构的要求为准。</b></p>
14	<p>二十、资产管理和计划财产的估值和会计核算</p>	<p>3、估值方法</p> <p>(1) 公募基金证券投资基金估值方法</p> <p>(3) 持有的金融产品（证券公司集合资产管理计划、信托公司集合资金信托计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金），该金融产品的管理人或其委托的估值核算机构定期公布</p>	<p>3、估值方法</p> <p>(1) 公募基金证券投资基金估值方法</p> <p>(3) 持有的<b>公募基金证券投资基金(含货币基金)以外的其他资产管理产品</b>（证券公司及证券公司子公司集合资产管理计划、信托公司集合资金信托计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的<b>私募证券投资基金</b>），<b>该资产管理</b></p>



	<p>份额净值的，按照最新公布的份额净值估值（若该金融产品的管理人或其委托的估值核算机构公布净值的同时，也提供扣除掉业绩报酬后的虚拟净值，优先选择按虚拟净值估值）；不公布份额净值的，按照成本估值。如所投金融产品公布的净值错误等管理人和托管人以外的原因，导致本计划估值错误的，本计划管理人和托管人予以免责。</p> <p>按份额净值计价的前述投资标的，如需启用虚拟计提业绩报酬进行估值的，作为本计划的主会计方，管理人应当对该等资产管理产品采用虚拟净值估值的准确性、公允性以及可能发生的操作性风险、法律风险等风险进行审慎评估。</p> <p>委托人签署本合同，即表明其已经知晓并认可本计划可采用上述虚拟净值的估值方式。委托人不得因本计划采用虚拟估值方式引起产品净值差异情况，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。</p> <p>管理人经评估后拟采取虚拟净值作为估值依据的，可以决定采用：（i）场外投资标的的托管人或其运营服务机构或管理人最近一次提供的场外标的虚拟单位净值；或者（ii）由本计划</p>	<p>理产品的管理人或其委托的估值核算机构定期公布份额净值的，按照最新公布的份额净值估值（若该资产管理产品的管理人或其委托的估值核算机构公布净值的同时，也提供扣除掉业绩报酬后的虚拟净值，优先选择按虚拟净值估值）；不公布份额净值的，按照成本估值。如所投资产管理产品公布的净值错误等管理人和托管人以外的原因，导致本计划估值错误的，本计划管理人和托管人予以免责。</p> <p>按份额净值计价的前述投资标的，如需启用虚拟计提业绩报酬进行估值的，作为本计划的主会计方，管理人应当对该等资产管理产品采用虚拟净值估值的准确性、公允性以及可能发生的相关操作性风险、法律风险等风险进行审慎评估。</p> <p>委托人签署本合同，即表明其已经知晓并认可本计划可采用上述虚拟净值的估值方式。委托人不得因本计划采用虚拟估值方式引起产品净值差异情况，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。</p> <p>作为本计划的主会计方，管理人拟采取虚拟净值作为估值依据的，可以决定采用：（i）场外投资标的的托管人或其运营服务机构或管理人最近一次提供的场外标的虚拟单位净值；或者（ii）由本计</p>
--	---	---

	<p>之管理人最近一次自行计算的场外标的虚拟单位净值，作为本计划之估值依据。管理人应及时向托管人提供前述虚拟单位净值；如从未获得前述场外投资标的虚拟单位净值的，按场外投资标的最新的份额净值估值，如从未获得过前述场外投资标的的份额净值的，按成本估值。</p> <p>由于场外资产管理产品虚拟净值的真实性、准确性、完整性取决于该等资产管理产品的相关基础数据的真实性、准确性、完整性、及时性等因素，受限于交互因素，托管人仅根据收到的虚拟净值对本计划进行估值，不就虚拟净值承担任何复核义务和责任。</p> <p>(4) 金融衍生品的估值方法</p> <p>交易所交易的金融衍生品（具体为以下品种：股票期权、股指期货、国债期货、商品期货）按估值日交易所公布的当日结算价估值；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，按最近交易日的结算价估值；如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</p>	<p>划之管理人最近一次自行计算的场外标的虚拟单位净值，作为本计划之估值依据。管理人应及时向托管人提供前述虚拟单位净值；如从未获得前述场外投资标的虚拟单位净值的，按场外投资标的最新的份额净值估值，如从未获得过前述场外投资标的的份额净值的，按成本估值。</p> <p>由于场外资产管理产品虚拟净值的真实性、准确性、完整性取决于该等资产管理产品的相关基础数据的真实性、准确性、完整性、及时性等因素，受限于交互因素，托管人仅根据收到的虚拟净值对本计划进行估值。</p> <p>(4) 金融衍生品的估值方法</p> <p>交易所交易的金融衍生品（具体为以下品种：股票期权、股指期货、国债期货、商品期货）按估值日交易所公布的当日结算价估值；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，按最近交易日的结算价估值；如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结算价及重大变化因素，调整确定公允价格。</p>
--	---	--

	近交易市价，确定公允价格。	
<p>二十一、 资产管理 计划的费 用与税收</p> <p>15</p>	<p>(一) 资产管理计划费用种类</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、 管理人的管理费；</li> <li>2、 托管人的托管费；</li> <li>3、 运营服务机构的运营服务费</li> <li>4、 证券交易费用；</li> <li>5、 证券账户开户费；</li> <li>6、 本计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、审计费和汇划费；</li> <li>7、 按照法律法规及本合同的约定可以在本计划财产中列支的其他费用。</li> </ol> <p>(二) 资产管理计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、 管理费：</li> </ol> <p>本计划管理人管理费按本计划前一自然日净值的1%年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 1\% \div 360$	<p>(一) 资产管理计划费用种类</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、 管理人的管理费（固定管理费）及业绩报酬（浮动管理费）；</li> <li>2、 托管人的托管费；</li> <li>3、 运营服务机构的运营服务费</li> <li>4、 证券交易费用；</li> <li>5、 证券账户开户费；</li> <li>6、 本计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、审计费和汇划费；</li> <li>7、 按照法律法规及本合同的约定可以在本计划财产中列支的其他费用。</li> </ol> <p>(二) 资产管理计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、 管理费（固定管理费）：</li> </ol> <p>本计划管理人管理费按本计划前一自然日净值的0.4%年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.4\% \div 360$



	<p>H 为每日应计提的管理费；</p> <p>E 为本计划前一自然日资产净值。</p> <p>.....</p> <p>2、托管费：</p> <p>本计划托管人托管费按本计划前一自然日净值的 0.025% 年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.025\% \div 360$ <p>H 为每日应计提的托管费；</p> <p>E 为本计划前一自然日资产净值。</p> <p>.....</p> <p>3、运营服务费：</p> <p>本计划运营服务机构的运营服务费按本计划前一自然日净值的 0.025% 年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.025\% \div 360$ <p>H 为每日应计提的运营服务费；</p> <p>E 为本计划前一自然日资产净值。</p> <p>(四) 管理人的业绩报酬</p>	<p>H 为每日应计提的管理费；</p> <p>E 为本计划前一自然日资产净值。</p> <p>.....</p> <p>2、托管费：</p> <p>本计划托管人托管费按本计划前一自然日净值的 0.01% 年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.01\% \div 360$ <p>H 为每日应计提的托管费；</p> <p>E 为本计划前一自然日资产净值。</p> <p>.....</p> <p>3、运营服务费：</p> <p>本计划运营服务机构的运营服务费按本计划前一自然日净值的 0.01% 年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.01\% \div 360$ <p>H 为每日应计提的运营服务费；</p>
--	--	--

		本计划管理人收取业绩报酬。	E为本计划前一自然日资产净值。  (四) 管理人的业绩报酬（浮动管理费）  本计划管理人收取业绩报酬。
二十二、 资产管理 计划的收 益分配	16	(八) 收益分配中发生的费用  收益分配时发生的银行转账等手续费用由本计划委托人自行承担，分红款项将于本次分红权益登记日起 T+3 个工作日内从托管户划出。	(八) 收益分配中发生的费用  收益分配时发生的银行转账等手续费用由本计划委托人自行承担，分红款项将于本次分红权益登记日起 T+5 个工作日内从托管户划出。
二十三、 信息披露 与报告	17	2、本计划的季度报告和年度报告  (1) 本计划的资产管理季度报告  管理人每季度结束之日起一个月内向委托人提供一次准确、完整、完整的管理季度报告，对报告期内本计划的运作情况做出	2、本计划的季度报告和年度报告  (1) 本计划的资产管理季度报告  管理人每季度结束之日起一个月内向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告，对报告期内本计划的运作情况做出说明。资产





	<p>的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本计划出具单项审计意见。</p> <p>管理人应当将审计结果报基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构，并将本计划的单项审计意见通过管理人网站公告。本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月时，可以不编制当期的年度审计报告，产品终止当年，无需出具年度审计报告。</p> <p>4、对账单</p> <p>管理人至少每个季度以邮寄向委托人寄送对账单。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。</p> <p>委托人应向管理人提供邮寄地址等资料，因委托人未正常提供以上信息、邮寄运营商系统平台故障及内部操作等非管理人原因导致委托人未能获得邮寄对账单的，管理人不承担任何责任。</p> <p>(二) 临时报告</p> <p>本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、资产</p>	<p>并将本计划的单项审计意见通过管理人网站公告，具体以监管机构的要求为准。本计划成立不足3个月或存续期间不足3个月时，可以不编制当期的年度审计报告，产品终止当年，无需出具年度审计报告。</p> <p>4、对账单</p> <p>管理人至少每个季度以电子邮件或其他形式向委托人提供对账单。如有调整，管理人将以公告形式通知委托人。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。</p> <p>委托人应向管理人提供电子邮箱地址等资料，因委托人未正常提供以上信息、邮件运营商系统平台故障及内部操作等非管理人原因导致委托人未能获得电子对账单的，管理人不承担任何责任。</p> <p>(二) 临时报告</p> <p>本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起5个工作日</p>
--	--	--

		<p>资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起5日内以管理人指定网站或其他途径和方式及时向委托人披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>（三）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的，管理人应当按照相关法律法规的规定和本合同的约定通过管理人网站或其他途径和方式向委托人披露，并向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p>	<p>日内以管理人指定网站或其他途径和方式及时向委托人披露，并及时报送管理人住所地中国证监会相关派出机构，具体以监管机构的要求为准。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>（三）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本计划的，管理人应当按照相关法律法规的规定和本合同的约定通过管理人网站或其他途径和方式向委托人披露，并向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告，具体以监管机构的要求为准。</p>
<p>二十四、 风险揭示 18</p>	<p>5、使用虚拟净值进行估值的风险（如有）</p> <p>当本计划投资场外资产管理产品时，由于场外资产管理产品的份额净值中包含了应当计提但是未支付的业绩报酬，采用份额净值对本计划资产进行估值可能无法准确地反映本基金的真实资产价值，因此，管理人可视产品实际运作情况，使用虚拟单位净值对该等场外资产管理产品进行估值。</p> <p>由于虚拟单位净值的真实性、准确性、完整性依赖于场外资产管理产品的相关基础数据的真实性、准确性、完整性，若</p>	<p>5、使用虚拟净值进行估值的风险（如有）</p> <p>当本计划投资场外资产管理产品时，由于场外资产管理产品的份额净值中包含了应当计提但是未支付的业绩报酬，采用份额净值对本计划资产进行估值可能无法准确地反映本计划的真实资产价值，因此，管理人可视产品实际运作情况，使用虚拟单位净值对该等场外资产管理产品进行估值。</p> <p>由于虚拟单位净值的真实性、准确性、完整性依赖于场外资产管理产品的相关基础数据的真实性、准确性、完整性，若场外资产</p>	

	<p>场外资产管理产品之托管人、运营服务机构、管理人以及本基金之管理人未及时发现提供真实、准确、完整的虚拟单位净值或估值材料，可能发生该等虚拟单位净值存在错误或延迟，从而影响本基金的单位净值。</p> <p>由于虚拟单位净值需要将场外资产管理产品份额净值扣除估值当日预计内含的业绩报酬（如有），因此采用虚拟单位净值扣除估值后的单位净值将低于之前按照基金份额净值估值的单位净值。</p> <p>7、其他特殊风险</p> <p>删除原文（如有）</p> <p>(1) 正回购风险（如有）</p> <p>本计划投资范围包括债券正回购，且根据相关法律法规的规定，参与证券回购融入资金余额可能达到本计划资产净值的100%（不得超过100%）。从事债券正回购存在着包括但不限于以下风险：</p> <p>1) 价格风险：是指由于债券交易价格不设涨跌停幅度限制，可能发生债券交易价格剧烈波动，存在亏损的可能，可能由此造成损失；</p>	<p>管理产品之托管人、运营服务机构、管理人以及本计划之管理人未及时发现提供真实、准确、完整的虚拟单位净值或估值材料，可能发生该等虚拟单位净值存在错误或延迟，从而影响本计划的单位净值。</p> <p>由于虚拟单位净值需要将场外资产管理产品份额净值扣除估值当日预计内含的业绩报酬（如有），因此采用虚拟单位净值估值后的单位净值将低于之前按照场外资产管理产品份额净值估值的单位净值。</p> <p>7、其他特殊风险</p> <p>删除原文（1）、（2）点并顺延后续编号</p> <p>(1) 投资资产管理产品的风险</p> <p>本集合计划部分资产将配置于以股票多头策略、股票中性策略和CTA策略等量化策略为主的金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品（包括公开募集证券投资基金、证券公司及证券公司子公司集合资产管理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金），投资上述资产管理产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响，请</p>
--	---	--



	<p>2) 套利风险：是指由于债券价格偏离预期，债券正回购和现券交易的组合套利过程中存在亏损的可能，可能由此造成损失；</p> <p>3) 交收风险：是指债券正回购交易到期后存在无法完全履行交收责任的可能性，可能由此造成损失；</p> <p>4) 质押风险：是指由于交易所、登记公司债券质押式回购交易标准券折算比例的调整，可能导致债券欠库，可能由此造成损失；</p> <p>5) 结算风险：根据证券登记结算公司的业务规则以及关于结算风险管理的相关规定，在债券正回购的结算过程中，证券登记结算公司有可能依照有关业务规则或约定处置质押券，可能由此造成损失。</p> <p>6) 投资风险：在进行债券正回购交易时，可能出现回购利率大于债券投资收益率，从而导致本计划净值下降的可能性。</p> <p>7) 资产净值波动加大的风险：通过债券正回购交易可放大交易杠杆，增加持仓证券总量，放大投资组合风险敞口，同</p>	<p>委托人知悉。</p> <p>1) FOF 产品管理模式特有风险</p> <p>各类不同资产及投资策略在不同的市场环境下表现不同，管理人根据资产配置模型进行大类资产配置，并筛选资产进行投资。各个策略资产的表现可能高于预期，也可能低于预期，即可能由于管理人对本计划委托财产分配不当，导致资管计划资产亏损；也可能出现管理人资金分配合理，但由于具体策略的投资管理人投资管理能力不佳造成资产亏损。</p> <p>2) 资产管理产品管理人风险</p> <p>资产管理产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险是指因管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内控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资产管理产品，可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。</p> <p>3) 量化策略模型失效风险</p> <p>本计划拟配置的股票多头策略、股票中性策略和 CTA 策略等量化策略主要依赖于量化模型，因为模型不能有效的、完全的刻画市</p>
--	---	---

	<p>时也增加了投资收益的不确定性，从而导致本计划资产净值波动加大。</p> <p>(2) 逆回购风险</p> <p>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的风险。</p> <p>(3) 投资金融产品的风险</p> <p>本集合计划部分资产将配置于以量化套利、量化对冲、CTA、量化多空等量化策略为主的金融监管部门批准或备案发行的金融产品（包括公募证券投资基金、证券公司及子公司集合资产管理计划、期货公司及期货子公司集合资产管理计划以及在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金），投资上述金融产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响，请委托人知悉。</p> <p>1) 金融产品管理人风险</p> <p>金融产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经</p>	<p>场运行中的真实状况，模型在测算、评估时存在误差（历史表现不能保证未来表现），模型中的参数估计存在误差，或者市场条件突然发生改变等因素，量化模型的可靠性将对本资产管理计划的收益产生影响，可能最终导致模型失效的风险。</p> <p>4) 量化策略模型风格偏离风险</p> <p>在实际运作中，因资产管理产品的投资经理变更导致模型无法有效运作，或者在运作过程中与产品期初投资策略和投资风格发生偏离，进而影响产品投资业绩。</p> <p>5) 赎回资产管理产品面临的流动性风险</p> <p>因本计划委托人赎回或管理人进行资产配置调整需要，管理人赎回资产管理产品时，可能触发资产管理产品大额赎回或巨额赎回条款，导致赎回资金延迟到账的风险。</p> <p>6) 投资资产管理产品可能面临双层收费的风险</p> <p>本计划投资者需要承担双层费用，即本计划费用及本计划所投资的资产管理产品自身需要承担的费用。本计划所投资的资产管理产品自身需要承担的费用包括资产管理产品的管理费、托管费、业绩报酬（如有）、认购费（如有）、赎回费（如有）等，以上费用在</p>
--	--	---

	<p>营风险是指因管理能力、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金融产品，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) 量化策略模型失效风险</p> <p>本计划拟配置的量化套利、量化对冲、CTA、量化多空等量化策略主要依赖于量化模型，因为模型不能有效的、完全的刻画市场运行中的真实状况，模型在测算、评估时存在误差（历史表现不保证未来表现），模型中的参数估计存在误差，或者市场条件突然发生改变等因素，量化模型的可靠性将对本资产管理计划的收益产生影响，可能最终导致模型失效的风险。</p> <p>3) 量化策略模型风格偏离风险</p> <p>在实际运作中，因金融产品的投资经理变更导致模型无法有效运作，或者在运作过程中与产品期初投资策略和投资风格发生偏离，进而影响产品投资业绩。</p> <p>4) 赎回金融产品面临的流动性风险</p>	<p>计提时将会扣减资产管理产品的资产净值，从而造成本计划净值下降。</p> <p>7) 投资资产管理产品的估值风险</p> <p>本计划投向多个底层资产管理产品，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，本计划按照资产管理产品估值日最近的单位净值进行估值。在存续期间，资管计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。</p> <p>8) 止损线监控风险</p> <p>所投资的资产管理产品净值提供可能存在滞后性，与本计划估值频率不一致，从而导致本计划基金份额净值更新不及时，未及时发现、触及本计划止损线的情形。</p> <p>(3) 净值波动风险（如有）</p> <p>本计划主要投资于公开募集证券投资基金、证券公司及证券公司子公司集合资产管理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货子公司集合资产管理计划以及在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金，投资上述产品出现如下情形之一时，将可能导致本计划出现净值波动</p>
--	---	---



	<p>因本计划委托人赎回或管理人进行资产配置调整需要，管理人赎回金融产品时，可能触发金融产品大额赎回或巨额赎回条款，导致赎回资金延迟到账的风险。</p> <p>5) 止损线监控风险</p> <p>所投资的金融产品净值提供可能存在滞后性，与本计划估值频率不一致，从而导致本计划基金份额净值更新不及时，未及时监控、触及本计划止损线的情形。</p> <p>(5) 净值波动风险（如有）</p> <p>本计划可能投资于公募证券投资基金、证券公司及子公司集合资产管理计划、期货公司及期货子公司集合资产管理计划以及在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金等金融产品类资产，投资上述产品出现如下情形之一时，将可能导致本计划出现净值波动风险：</p> <p>1) 估值日后的第一个交易日仍无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；</p> <p>2) 投资上述品种后无法及时确认，上述投资品种在投资确认前估值价格波动；</p>	<p>风险：</p> <p>1) 估值日后的第一个交易日仍无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；</p> <p>2) 投资上述品种后无法及时确认，上述投资品种在投资确认前估值价格波动；</p> <p>3) 估值日后的第一个交易日取得的上述投资品种的最新估值价格仍没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响）；</p> <p>(二) 一般风险揭示</p> <p>3、管理风险</p> <p>在本计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，管理人精选出的投资品种业绩表现不一定持续优于其他投资品种，如管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响本计划的收益水平，从而产生风险，该风险由本计划财产及委托人承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由委托人自担。</p>
--	---	---

	<p>3) 估值日后的第一个交易日取得的上述投资品种的最新估值价格仍没有或无法排除影响估值价格的因素(例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响);</p> <p>(二) 一般风险揭示</p> <p>3、管理风险</p> <p>在本计划运作过程中, 管理人的知识、经验、判断、决策、技能等, 会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断, 管理人精选出的投资品种业绩表现不一定持续优于其他投资品种, 如管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响本计划的收益水平, 从而产生风险, 该风险由本计划财产及委托人承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险, 其风险应由委托人自担。</p> <p>15、其他风险</p> <p>(1) 关联交易的风险: 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, 管理人按照各方提供的关联方名单进行关联交易</p>	<p>15、其他风险</p> <p>(1) 关联交易的风险</p> <p>1) 关联方范围</p> <p>本计划所称关联方包括:</p> <p>①本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方(含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司);</p> <p>②本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方;</p> <p>③本计划的投资顾问(如有)、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方;</p> <p>④与管理人、本计划的托管人、投资顾问(如有)有其他重大利害关系的机构。</p> <p>上述第①项为管理人全部资产管理计划的关联方; 第②、③项为本计划的关联方。</p> <p>监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的, 管理人遵照执行。</p> <p>2) 关联交易范围: 本计划涉及的具体类型包括但不限于</p>
--	---	---

	<p>的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险，同时，本计划进行关联交易时可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。</p>	<p>限于：</p> <p>①本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）发行或者承销期内承销的证券；</p> <p>②本计划财产投资于本计划托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>③本计划财产投资于其投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>④本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>⑤本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；</p> <p>⑥本计划财产投资于投资顾问（如有）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>⑦本计划财产以本计划关联方或者以本条第④、⑤、⑥项规定</p>
--	--	---



		<p>的资产管理产品为交易对手，进行询价交易(包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款等)；</p> <p>⑧本计划财产以本计划关联方或者以本条第④、⑤、⑥项规定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第(五)项规定的非标准化资产交易；</p> <p>⑨监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的(如本计划财产开展逆回购交易的，将交易对手、质押券等统一纳入管理)，管理人遵照执行。</p> <p>3)一般关联交易和重大关联交易</p> <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。</p> <p>重大关联交易是指投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品且金额及比例重大的(本计划为 FOF 产品或本计划投资于货币基金的除外)、与关联方及关联方产品互为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大的询价交易等需强化审批、披露、报告的关联交易；一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交</p>
--	--	--

		<p>易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监管机构和基金业协会的相关要求为准。</p> <p>本计划财产不进行关联交易。</p> <p>管理人按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险，由此造成的损失由本计划财产承担。</p> <p>4) 关联交易的内部控制</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。公司制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内部控制的要求对关联交易进行审批。</p> <p>5) 本计划为基金中基金，本计划不进行关联交易。</p>
<p>二十五、 资产管理 合同的变 更、终止</p> <p>19</p>	<p>(一) 资产管理合同的变更</p> <p>6、本合同发生变更的，管理人应当按照基金业协会要求及时向基金业协会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出</p>	<p>(一) 资产管理合同的变更</p> <p>6、本合同发生变更的，管理人应当按照基金业协会要求及时向基金业协会备案，具体以监管机构的要求为准。</p>

<p>与财产清算</p>	<p>机构。</p> <p>(二) 管理人或托管人的变更</p> <p>(三) 资产管理计划的展期</p> <p>4、展期的实现</p> <p>(4) 管理人应在展期后5个工作日内将展期情况报基金业协会备案,同时抄报管理人住所地中国证监会派出机构。</p> <p>(四) 资产管理计划的终止</p> <p>10、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。</p> <p>管理人应当自本计划终止之日起5个工作日内报基金业协会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出机构,前述第6项约定的情形除外。</p> <p>(五) 资产管理计划的清算</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>(6) 将清算报告报基金业协会、管理人住所地中国证监会派出机构并告知委托人;</p>	<p>(二) 管理人或托管人的变更</p> <p>新增第3点</p> <p>3、新任管理人或新任托管人自变更生效日起接任本计划的管理人或托管人,应当按照本合同关于管理人和托管人权利和义务和责任约定履行管理人和托管人职责。新任管理人或新任托管人接任之前,原管理人或原托管人应依据法律法规和本合同的约定继续履行相关职责。原管理人或原托管人在继续履行相关职责期间,仍有权按照本合同的约定收取管理费、业绩报酬(如有)或托管费。</p> <p>(三) 资产管理计划的展期</p> <p>4、展期的实现</p> <p>(4) 管理人应在展期后5个工作日内将展期情况报基金业协会备案,同时抄报管理人住所地中国证监会派出机构,具体以监管机构的要求为准。</p> <p>(四) 资产管理计划的终止</p> <p>10、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。</p> <p>管理人应当自本计划终止之日起5个工作日内报基金业协会备</p>
--------------	---	--



	<p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>5、本计划二次清算</p> <p>若本计划在终止之日有未能流通变现的证券或金融产品，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券或金融产品可在流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式分配给委托人，二次清算期间，管理人、托管人继续按照本合同约定计提管理费、托管费及其他费用。发生二次清算情形的，管理人应当及时向管理人住所地的中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p> <p>6、本计划清算报告的告知安排</p> <p>清算结果由本计划财产清算小组结束后通过管理人网站向委托人进行披露。并报告管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p>	<p>案，前述第6项约定的情形除外，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>(五) 资产管理计划的清算</p> <p>2、本计划清算程序</p> <p>(6) 将清算报告报基金业协会并告知委托人，具体以监管机构的要求为准；</p> <p>4、本计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>新增第(5)点</p> <p>(5) 清算后的剩余财产，原则上以货币资金形式进行分配；本合同另有约定的，从其约定；但不得违反中国证监会规定；</p> <p>5、本计划二次清算</p> <p>若本计划在终止之日有未能流通变现的证券或资产管理产品，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券或资产管理产品在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式分配给委托人，二次清算期间，管理人、托管人继续按照本合同约定计提管理费、托管费及其他费用。发生二次清算</p>
--	---	---

		<p>情形的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>6、本计划清算报告的告知安排</p> <p>清算结果由本计划财产清算小组结束后通过管理人网站向委托人进行披露。并报告基金业协会，具体以监管机构的要求为准。</p>	<p>托管人据此表对委托财产的投资进行监督，但托管人无投资责任。</p> <p>1、投资范围</p> <p>(1) 资产管理产品：公开募集证券投资基金、证券公司及基金公司子公司集合资产管理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、货币市场基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品；</p> <p>(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货。</p>
<p>附件一： 托管人投资监督事项表</p> <p>20</p>	<p>托管人据此表对委托财产的投资进行监督，但托管人无投资责任。</p> <p>1、投资范围</p> <p>(1) 金融产品类资产：公募证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、货币市场基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品；</p> <p>(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。</p> <p>(3) 衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货。</p>	<p>托管人据此表对委托财产的投资进行监督，但托管人无投资责任。</p> <p>1、投资范围</p> <p>(1) 资产管理产品：公开募集证券投资基金、证券公司及基金公司子公司集合资产管理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、货币市场基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品；</p> <p>(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货。</p>	

	<p>3、投资比例</p> <p>本计划为混合类产品，投资于金融产品分类资产的比例不低于80%。</p> <p>该产品为FOF产品，由于本计划托管人并不是本计划投向的私募证券投资基金的托管人，无法独立获取前述基金的估值数据，穿透核查投资比例将根据管理人定期提供的底层私募数据进行监督。</p> <p>如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不合法、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，管理人应在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的15个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p>	<p>3、投资比例</p> <p>本计划投资于资产管理产品的比例不低于资产总值的80%，并直接或通过投向资产管理产品进行以下比例的资产配置：</p> <p>(1) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例低于资产总值的80%；</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例低于资产总值的80%；</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的80%或期货和衍生品账户权益不超过资产总值的20%。</p> <p>本计划投资于上述资产管理产品的，计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，本计划投资于上述资产管理产品中的公开募集证券投资基金的，按照穿透原则合并计算同类资产的金額需符合本计划资产配置比例的要求；本计划投资于上述资产管理产品中其他资产管理产品的，按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金額需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率更新计算计划所投资资产的金額或比例。</p> <p>该产品为FOF产品，由于本计划托管人无法独立获取前述资产管理产品的估值数据，穿透核查投资比例将根据管理人定期提供的底层资产管理产品数据进行监督。</p>
--	--	---



		<p>如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人主观因素之外的因素,造成本计划投资比例不符合法律、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,管理人应在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的 20 个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内,具体以监管机构的要求为准。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的,管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构报告,具体以监管机构的要求为准。</p> <p>3、投资限制</p> <p>(1) 本计划投资于同一资产的资金,不得超过本计划资产净值的 25%;单一融资主体及其关联方的非标准化资产,视为同一资产合并计算。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。本计划属于基金中基金资产管理计划(FOF),基金中基金资产管理计划投资“定制”的子基金,并持有 1 个或多个子基金产品的全部份额的,可豁免单只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%的组合投资要求;</p>
--	--	--

		<p>(2) 本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%，计算总资产时，应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>(3) 本计划投资除公募基金以外的其他资产管理产品的，该等资产管理产品不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品，金融监管机构另有规定的除外；</p> <p>(4) 本计划投资除公募基金以外的其他资产管理产品的，该等资产管理产品不得再投资于《管理办法》第三十八条第(五)项规定资产；(第三十八条第(五)项规定资产为《管理办法》第三十八条第(一)至(三)项规定以外的非标准化债权类资产、股权类资产、期货和衍生品类资产)</p> <p>本计划为 FOF 产品，由于本计划托管人无法独立获取前述资产管理产品的估值数据，上述投资比例、投资限制因涉及穿透核查、单一融资主体及其关联方，托管人将根据管理人定期提供的底层资产管理产品数据进行事后监督。如因管理人提供底层数据材料的提供频率、脱敏处理、可披露程度等原因导致托管人实际监督范围受限的，由此造成的后果由相应责任方承担。</p>
21	附件二： 第一创业 证券指令	<p>新增附件二</p> <p>附件二：第一创业证券指令发送授权通知（样本）</p>

发送授权  
通知（样  
本）

## 投资指令授权书

国泰君安证券股份有限公司：

根据三方资产管理计划合同（或托管协议）的相关约定，我公司授予雷岩等同志负责托管在贵司的所有资产管理产品的运营管理工作。本授权书变更或终止时我公司另行通知。我公司有效授权人员，指定如下：

授权范围	授权人员	签字样本
指令经办	雷岩	
	杨晓文	
指令复核	周南鸿	
	黄小芳	
指令审批	孙蕤	
	黄焕元	

由上述对应授权范围内任一签字样  
本签署的投资指令均有效。



			<p>本授权书自 年 月 日起生效。</p> <p>预留有效业务章： 第一创业证券股份有限公司</p> <p>年 月 日</p>									
22	附件三： 投资指令 信息（样 本）	<p><b>新增附件三</b></p> <p>附件三：投资指令信息（样本）</p> <p>第一创业证券股份有限公司__专用表</p> <table border="1" data-bbox="678 264 1337 1041"> <tr> <td>第一创业- 集合资产管理业务</td> </tr> <tr> <td>编号：202* 年第 * 号</td> </tr> <tr> <td>指令日期：202* 年 ** 月 **日</td> </tr> <tr> <td>**资产托管部：</td> </tr> <tr> <td>敬请贵部根据以下提供的收款人名称、开户行、账号、到账日期和划款金额划款。</td> </tr> <tr> <td>资金划出账户：</td> </tr> <tr> <td>账号：</td> </tr> <tr> <td>开户行：</td> </tr> <tr> <td>到账时间：</td> </tr> </table>	第一创业- 集合资产管理业务	编号：202* 年第 * 号	指令日期：202* 年 ** 月 **日	**资产托管部：	敬请贵部根据以下提供的收款人名称、开户行、账号、到账日期和划款金额划款。	资金划出账户：	账号：	开户行：	到账时间：	
第一创业- 集合资产管理业务												
编号：202* 年第 * 号												
指令日期：202* 年 ** 月 **日												
**资产托管部：												
敬请贵部根据以下提供的收款人名称、开户行、账号、到账日期和划款金额划款。												
资金划出账户：												
账号：												
开户行：												
到账时间：												

收款人:		
开户行:		
账号:		
划款金额 (小写):		
划款金额 (大写):		
资金用途:		
备注:		
管理人签章:	托管银行签章:	
审批人:	审批人:	
复核人:	复核人:	
经办人:	经办人:	

