

## 首创证券创赢 4 号集合资产管理计划变更合同条款说明八

《首创证券创赢 4 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“原合同”)中条款更改主要涉及以下内容:

### 一、原合同新增“特别约定”部分内容,

#### 新增:

“特别约定:《首创证券创赢 4 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)以电子签名或纸质方式签订,管理人、托管人作为本合同签署方,已接受本合同项下的全部条款;委托人(首创证券创赢 4 号集合资产管理计划的投资者)作为本合同一方,以电子签名或纸质方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款。

委托人、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》等有关规定,三方一致同意委托人自签署《电子签名约定书》之日起,委托人以电子签名方式接受电子签名合同(即本合同、集合计划说明书)、风险揭示书或其他文书的,视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书,与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力,无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。”

### 二、原合同“一、前言”部分,

#### 原:

“订立本合同的依据、目的和原则:

1. 订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》)、《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计划运作管理规定》(以下简称《运作规定》)、《集合资产管理计划管理合同内容与格式指引(试行)》、《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》、《中华人民共和国个人信息保护法》(以下简称《个人信息保护法》)等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定。

2. 订立本合同的目的是规范首创证券创赢 4 号集合资产管理计划(以下简称

“集合计划”或“计划”)运作,明确《首创证券创赢4号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,保护集合计划委托人的合法权益。

3. 订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护集合计划委托人的合法权益。

本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,当事人按照《指导意见》、《基金法》《管理办法》、《运作规定》、《个人信息保护法》、《首创证券创赢4号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案,并抄报中国证监会相关派出机构(如需)。证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任,也不代表证券投资基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。”

#### **变更为:**

“(一)订立本合同的依据是《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投资基金法》(以下简称《基金法》)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作规定》)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》(以下简称“合同指引”)、《中华人民共和国个人信息保护法》(以下简称《个人信息保护法》)等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定。

(二)订立本合同的目的是规范首创证券创赢4号集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)运作,明确《首创证券创赢4号集合资产管理计划资产管理合同》当事人的权利与义务,保护集合计划委托人的合法权益。

(三)订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护集合计划委托人的合法权益。

本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《指导意见》《管理办法》《运作规定》《个人信息保护法》《首创证券创赢4号集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。证券投资基金业协会办理资产管理计划备案不作为对资产管理计划财产安全和投资者收益的保证，也不表明证券投资基金业协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。投资者应当充分了解资产管理计划的投资范围、投资策略和风险收益等信息，根据自身风险承受能力审慎选择资产管理计划，自主判断投资价值，自行承担投资风险。”

### 三、原合同“二、释义”部分，

原：

“在本合同中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

集合资产管理计划、本集合计划、集合计划：指首创证券创赢4号集合资产管理计划；

集合计划说明书、说明书：指《首创证券创赢4号集合资产管理计划说明书》及对说明书的任何有效的修订和补充；

集合资产管理合同、资产管理合同、本合同：指《首创证券创赢4号集合资产管理计划资产管理合同》及对该合同的任何有效的修订和补充；

托管协议：指《首创证券创赢4号集合资产管理计划托管协议》及对该协议的任何有效修订和补充；

风险揭示书：指《首创证券创赢4号集合资产管理计划风险揭示书》；

《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自2013年6月1日起实施，并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《管理办法》、《运作规定》：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业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》；

《指导意见》：中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于 2018 年 4 月 27 日联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》；

《个人信息保护法》：指 2021 年 8 月 20 日经第十三届全国人大常委会第三十次会议表决通过的《中华人民共和国个人信息保护法》；

中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会；

集合资产管理合同当事人：指受集合资产管理合同约定，根据集合资产管理合同享有权利并承担义务的集合计划管理人、集合计划托管人和委托人；

集合计划管理人、管理人：指首创证券股份有限公司，也简称为“首创证券”；

集合计划托管人、托管人：指平安银行股份有限公司北京分行，也简称为“平安银行北京分行”；

推广机构：指首创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；

注册登记机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本集合计划的注册登记机构为管理人或管理人认可的具备注册登记资格的机构（含中证机构间报价系统股份有限公司或中国证券登记结算有限责任公司等机构）；

委托人：指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本集合计划的投资人，包括个人投资者和机构投资者；

个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规、监管规定可以投资于本集合资产管理计划的自然人投资者；

机构投资者：指依法可以投资本集合资产管理计划，在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

份额持有人、持有人：指通过签订集合资产管理合同而依法取得和持有本集合计划份额的委托人；

**集合计划成立日：**指集合计划经过推广达到集合计划说明书和集合资产管理合同规定的成立条件后，管理人通告集合计划成立的日期；

**初始募集期/推广期：**指自本集合计划启动份额发售推广之日起不超过 60 日的期间，管理人有权根据募集情况调整提前终止初始募集期/推广期，具体以管理人公告为准；

**封闭期：**指本集合计划存续期间除开放期和临时开放期以外的其他日期，在此期间委托人不得参与、退出本集合计划；

**开放期：**指委托人可以办理集合计划参与或退出等业务的工作日；

**开放日：**指开放期内的每个工作日；

**存续期、管理期限：**指计划成立并存续的期间。本集合计划存续期为 10 年；

**工作日：**指上海证券交易所和深圳证券交易所等相关交易所的正常交易日；

**T 日：**指本集合计划约定的特定日；

**T+n 日（n 指任意正整数）：**指 T 日后的第 n 个工作日；

**天：**指自然日；

**会计年度：**指公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；

**参与：**指委托人申请购买本集合计划份额的行为；

**首次参与：**指委托人在参与之前未持有过本集合计划的情形；

**追加参与：**指除首次参与外的其他参与情形；

**退出：**指委托人按集合资产管理合同规定的条件要求收回全部或部分委托资产的行为；

**巨额退出：**指本集合计划单个开放日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与总份额后的余额）超过上一工作日计划总份额 20% 的情形；

**计划收益：**指本集合计划投资所得红利、股息、债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；

**集合计划份额、计划份额、份额：**指集合计划的最小单位；

**元：**指人民币元；

**计划单位面值、单位面值：**人民币 1.00 元；

**集合计划资产总值、计划资产总值：**指集合计划所投资各类有价证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和；

集合计划资产净值、计划资产净值：指集合计划资产总值减去负债后的净资产值；

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；

计划单位累计净值、累计净值：指计划单位净值与集合计划份额累计分红之和；

计划资产估值：指计算评估本集合计划资产和负债的价值，以确定本集合计划资产净值的过程；

不可抗力：不可抗力是指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观事件或因素，包括但不限于：相关法律法规的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等；

信义义务：信义义务是指依照《基金法》及本合同之约定，托管人在履行托管职责时，应当恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务；

管理人指定网站、管理人网站：www.sczq.com.cn，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。”

#### **变更为：**

“在本合同中，除非文义另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

本集合计划、资产管理计划：指首创证券创赢4号集合资产管理计划；

集合计划说明书、说明书：指《首创证券创赢4号集合资产管理计划说明书》及对说明书的任何有效的修订和补充；

本合同、资产管理合同：指《首创证券创赢4号集合资产管理计划资产管理合同》及对该合同的任何有效的修订和补充；

托管协议：指《首创证券创赢4号集合资产管理计划托管协议》及对该协议的任何有效修订和补充；

风险揭示书：指《首创证券创赢4号集合资产管理计划风险揭示书》；

合同指引：指2019年3月29日中国证券投资基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》；

《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，2012年12月28日经第十一届全国人民代表大会常务委员会第

三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修改的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订；

《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》；

《运作规定》：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》；

《指导意见》：中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于 2018 年 4 月 27 日联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》；

《个人信息保护法》：指 2021 年 8 月 20 日经第十三届全国人大常委会第三十次会议表决通过的《中华人民共和国个人信息保护法》；

中国证监会、证监会：指中国证券监督管理委员会；

集合资产管理合同当事人：指受集合资产管理合同约定，根据集合资产管理合同享有权利并承担义务的集合计划管理人、集合计划托管人和委托人；

集合计划管理人、管理人：指首创证券股份有限公司；

集合计划托管人、托管人：指平安银行股份有限公司北京分行；

销售机构：指首创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；

注册登记机构：指办理登记、存管、过户、清算和结算等注册登记业务的机构。本集合计划的注册登记机构为管理人或管理人认可的具备注册登记资格的机构（含中证机构间报价系统股份有限公司或中国证券登记结算有限责任公司等机构）；

委托人：指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本集合计划的投资者，包括个人投资者、机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买资产管理计划的其他投资者；

个人投资者：指依据中华人民共和国有关法律法规、监管规定可以投资于本集合资产管理计划的自然人投资者；

机构投资者：指依法可以投资本集合资产管理计划，在中华人民共和国境内合法注册登记或经有关政府部门批准设立的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；

份额持有人、持有人：指通过签订集合资产管理合同而依法取得和持有本集合计划份额的委托人；

集合计划成立日：指集合计划经过推广达到集合计划说明书和集合资产管理合同规定的成立条件后，管理人公告集合计划成立的日期；

初始募集期：指自本集合计划启动份额发售推广之日起不超过 60 日的期间，管理人有权根据募集情况调整提前终止初始募集期，具体以管理人公告为准；

封闭期：除开放期及临时开放期以外的期间；

开放期：指委托人可以办理集合计划参与或退出等业务的交易日；

临时开放期：指管理人因合同变更等符合监管要求的原因单独设置的仅允许委托人办理退出业务的交易日；

开放日：指开放期内的每个交易日；

存续期、管理期限：指计划成立并存续的期间；

工作日/交易日：指上海证券交易所和深圳证券交易所等相关交易所的正常交易日；

T 日：指本集合计划约定的特定日；

T+n 日（n 指任意正整数）：指 T 日后的第 n 个交易日；

日、天：指自然日；

会计年度：指公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日；

参与：指委托人申请购买本集合计划份额的行为；

首次参与：指委托人在参与之前未持有过本集合计划的情形；

追加参与：指除首次参与外的其他参与情形；

退出：指委托人按本合同规定的条件要求赎回部分或全部委托资产份额的行为；

计划收益：指本集合计划投资所得红利、股息、债券利息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入；

集合计划份额：指集合计划的最小单位；



元：指人民币元；

集合计划资产总值：指集合计划所投资各类有价证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产所形成的价值总和；

集合计划资产净值：指集合计划资产总值减去负债后的净资产值；

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；

单位累计净值：指计划单位净值与集合计划份额累计分红之和；

计划资产估值：指计算评估本集合计划资产和负债的价值，以确定本集合计划资产净值的过程；

不可抗力：不可抗力是指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观事件或因素，包括但不限于相关法律法规的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等；

信义义务：信义义务是指依照《基金法》及本合同之约定，托管人在履行托管职责时，应当恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务。

管理人指定网站、管理人网站：[www.sczq.com.cn](http://www.sczq.com.cn)，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。”

#### 四、原合同“三、承诺与声明”中“(三)投资者声明”部分，

原：

“1. 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，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

2. 投资者承诺以真实身份参与集合计划，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资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。投资者承诺，如委托资金为资产管理产品募集的资金时，将确保资产管理产品的投资者中不包含其他资产管理产品。如委托资金为除公募资产管理产品外的合伙企业、契约等非法人形式，最终投资者满足法律法规、监管规则规定的合格投资者要求，并向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源，保证所提供文件真实、准确、完整、合法。

3. 已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资

资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理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。

4. 投资者已知晓并理解《个人信息保护法》第十七条规定的事项及个人在个人信息处理活动中的各项权利。

5. 投资者已充分知晓并同意管理人基于监管要求或为客户提供产品及服务需要处理个人信息。

6. 如由投资者提供第三方个人信息的，投资者承诺其提供的信息真实、准确、完整，并已取得相关信息主体的同意。

7. 投资者已阅读管理人在其网站公示的隐私政策，同时，已了解尽管首创证券已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险，并愿意承担相关风险及损失。”

**变更为：**

“1、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，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

2、投资者承诺以真实身份参与集合计划，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资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。投资者承诺，如委托资金为资产管理产品募集的资金时，将确保资产管理产品的投资者中不包含其他资产管理产品。如委托资金为除公募资产管理产品外的合伙企业、契约等非法人形式，最终投资者满足法律法规、监管规则规定的合格投资者要求，并向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源，保证所提供文件真实、准确、完整、合法。投资于本集合计划的资产管理产品未开展或者参与具有滚动发行、集合运作、分离定价特征的资金池业务。

3、已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理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，投资于本集合计划将自行承担投资风险。

4、投资者已充分知晓并同意管理人基于监管要求或为客户提供产品及服务需要处理个人信息。

5、如由投资者提供第三方个人信息的，投资者承诺其提供的信息真实、准确、完整，并已取得相关信息主体的同意。

6、投资者已阅读管理人在其网站公示的隐私政策，同时，已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险，并愿意承担相关风险及损失。

管理人、托管人及投资者已知晓并理解《个人信息保护法》第十七条规定的事项及个人在个人信息处理活动中的各项权利。”

#### 五、原合同“四、当事人及权利义务”中，

原：

“本资产管理计划设定为均等份额。除资产管理合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益。

委托人

##### 1、委托人简况

个人填写：

姓名：

证件类型：

证件号码：

住所：

通信地址：

邮政编码：

联系电话：

移动电话：

电子信箱：

其他：

委托人的详细情况在电子签名合同数据电文中列示。

机构填写：

机构名称：

法定代表人：

住所：

通信地址：

邮政编码：

代理人姓名：

身份证号码：

联系电话：

其他：

## 2、委托人的权利

根据《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，委托人的权利包括但不限于：

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；
- (3) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (4) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- (5) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- (6) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- (7) 因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
- (8) 投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，投资者可向管理人提出关于撤回同意处理个人信息授权的书面申请。投资者撤回同意，不影响撤回前基于个人同意已进行的个人信息处理活动的效力；
- (9) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

## 3、委托人的义务

根据《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，委托人的义务包括但不限于：

(1) 委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；

(2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；

(3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；

(4) 认真阅读并签署风险揭示书；

(5) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；

(6) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

(7) 向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

(8) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

(9) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；

(10) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

(11) 不得违规或违反本合同约定转让其所拥有的计划份额；

(12) 本集合计划如采用电子签名合同，委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料。委托人应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

(13) 除非在本合同规定的退出开放期或终止日，不得要求提前终止委托资产管理关系；

(14) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

管理人

1、管理人简况

机构名称：首创证券股份有限公司

法定代表人：毕劲松

住所及通信地址：北京市朝阳区安定路5号院13号楼A座11-21层

邮政编码：100029

联系电话：010-81152000

2、管理人权利

根据《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

(1) 按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

(3) 按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；

(4) 根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；

(5) 自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；

(6) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

(7) 按照本合同及《说明书》的约定，停止办理集合计划份额的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；

- (8) 根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；
- (9) 集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；
- (10) 法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及资产管理合同约定的其他权利。

### 3、管理人义务

根据《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；
- (2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；
- (3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；
- (4) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；
- (5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；
- (6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；
- (7) 建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；
- (8) 除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产；
- (9) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；
- (10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- (11) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；
- (12) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；
- (13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行

为；

(14) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；

(15) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；

(16) 对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

(17) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

(18) 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；

(19) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(20) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，报送中国证监会相关派出机构，并向中国证券投资基金业协会备案（如需）；

(21) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(22) 建立并保存投资者名单；

(23) 组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(24) 按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(25) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；

(26) 进行资产估值等会计核算并编制资产管理计划财务会计报告；

(27) 依法计算并披露资产管理计划净值，确定参与、退出价格；

(28) 按照有关合同和规定行使资产管理计划财产投资权利而应承担的义务，包括但不限于选择经纪商及投资标的等；

(29) 依法对托管人、销售机构的行为进行监督，如发现托管人、销售机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、代理销售协议的，



应当予以制止；

(30) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项；

(31) 在集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；

(32) 因管理人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(33) 遵守《个人信息保护法》的要求，遵守保密义务，采取必要的措施保障投资者个人信息的安全，并采取合理措施告知投资者其执行的个人信息保护政策；

(34) 管理人向其他个人信息处理者提供其处理的个人信息的，应当向个人告知接收方的名称或者姓名、联系方式、处理目的、处理方式和个人信息的种类，并取得个人的单独同意。受托个人信息处理者为国家机关或者法律、法规授权的具有管理公共事务职能的组织，且法律、行政法规规定应当保密或者不需要告知的情形的，管理人可以不向个人告知且无需经投资者单独同意；

(35) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。

## 托管人

### 1、托管人简况

机构名称：平安银行股份有限公司北京分行

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号远洋大厦 5F

负责人：鞠维萍

电话：(010) 66292298

### 2、托管人权利

根据《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

(1) 按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；

(3) 按照托管协议的约定监督管理人集合计划的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反托管协议之附件《交易监控合规表》对投资范围及投资比例约定的，如指令未生效，有权予以制止。如指令已生效，则按指令划款后，有权要求管理人纠正；

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 托管协议与本合同、说明书约定不一致的，托管人的托管职责以托管协议的约定为准；

(6) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

### 3、托管人的义务

根据《管理办法》、《运作规定》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 安全保管资产管理计划财产；

(2) 除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；

(4) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；

(5) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；

(6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；

(7) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；

(8) 根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见；

(9) 编制托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构，并向中国证券投资基金业协会备案（如需）；

(10) 按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(11) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不

得向他人泄露；

(12) 根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(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资产管理合同约定的，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；

(14) 依照法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；

(15) 在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管集合计划的资产，确保集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；

(16) 定期核对资产管理业务资产情况；

(17) 建立与管理人的对账机制，复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值和资产管理计划参与、退出价格；

(18) 保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前予以保密，不向他人泄露（法律法规、中国证监会另有规定或有权机关要求的除外）；

(19) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

(20) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人；

(21) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(22) 因管理人过错造成集合计划资产损失的，代委托人向管理人追偿；

(23) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的，由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；

(24) 投资于《管理办法》第三十七条第（5）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；

(25) 国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。”

**变更为：**

“本集合计划设定为均等份额。除本合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益。

(一) 委托人

1、委托人简况

**【个人填写】**

姓名：

证件类型：

证件号码：

住所：

通信地址：

邮政编码：

联系电话：

移动电话：

电子信箱：

其他：

**【机构填写】**

机构名称：

法定代表人：

住所：

通信地址：

邮政编码：

代理人姓名：

身份证号码：

联系电话：

其他：

委托人的详细情况在电子签名合同数据中列示。

2、委托人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，委托人的权利包括但不限于：

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；
- (3) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (4) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- (5) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- (6) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- (7) 因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
- (8) 投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，投资者可向管理人提出关于撤回同意处理个人信息授权的书面申请。投资者撤回同意，不影响撤回前基于个人同意已进行的个人信息处理活动的效力；
- (9) 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权利。

### 3、委托人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，委托人的义务包括但不限于：

- (1) 委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；
- (2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- (3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；
- (4) 认真阅读并签署风险揭示书；
- (5) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产

管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；

（6）在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

（7）向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

（8）不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

（9）不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；

（10）保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

（11）不得违规或违反本合同约定转让其所拥有的计划份额；

（12）本集合计划如采用电子签名合同，委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料。委托人应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

（13）除非在本合同规定的开放退出期或终止日，不得要求提前终止委托资产管理关系；

（14）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

## （二）管理人

### 1、管理人简况

机构名称：首创证券股份有限公司

法定代表人：毕劲松

住所及通信地址：北京市朝阳区安定路5号院13号楼A座11-21层

邮政编码：100029

联系人：李佳维

联系电话：010-81152618

## 2、管理人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

- (1) 按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；
- (2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；
- (3) 按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；
- (4) 根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；
- (5) 自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；
- (6) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；
- (7) 按照本合同及《说明书》的约定，暂停办理集合计划份额的参与、退出事宜；
- (8) 根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；
- (9) 集合计划资产受到损害时，以管理人名义向有关责任人追究法律责任；
- (10) 法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

## 3、管理人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；
- (2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；
- (3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管

理计划财产；

(4) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；

(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；

(7) 建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；

(8) 除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产；

(9) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；

(10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；

(11) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；

(12) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；

(13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(14) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划单位净值；

(15) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；

(16) 对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

(17) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

(18) 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；



- (19)按照资产管理合同的约定确定收益分配方案,及时向投资者分配收益;
- (20)根据法律法规与资产管理合同的规定,编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告,并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送;
- (21)办理与受托资产管理业务活动有关的信息披露事项;
- (22)建立并保存投资者名单;
- (23)组织并参加资产管理计划财产清算小组,参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配;
- (24)按照法律、行政法规和中国证监会的规定,保存资产管理计划的会计账册,妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据,保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年;
- (25)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者;
- (26)按照有关合同和规定行使资产管理计划财产投资权利而应承担的义务,包括但不限于选择经纪商及投资标的等;
- (27)依法对托管人、销售机构的行为进行监督,如发现托管人、销售机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定,或者违反本合同、代理销售协议的,应当予以制止;
- (28)按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定,及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项;
- (29)在本集合计划到期或其他原因解散时,与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜;
- (30)因管理人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时,应承担赔偿责任;
- (31)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。
- (32)遵守《个人信息保护法》的要求,遵守保密义务,采取必要的措施保障投资者个人信息的安全,并采取合理措施告知投资者其执行的个人信息保护政策;

(33) 管理人向其他个人信息处理者提供其处理的个人信息的，应当向个人告知接收方的名称或者姓名、联系方式、处理目的、处理方式和个人信息的种类，并取得个人的单独同意。受托个人信息处理者为国家机关或者法律、法规授权的具有管理公共事务职能的组织，且法律、行政法规规定应当保密或者不需要告知的情形的，管理人可以不向个人告知且无需经投资者单独同意；

(34) 按照我国有关反洗钱法律、行政法规，履行客户身份识别反洗钱义务，识别、核实资产委托人的身份及资产管理计划的受益所有人，并按监管规定保存相关身份信息、资料；在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分，对高风险的客户采取适当的风控措施；在法律允许范围内，配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作，并提供必要客户信息、资料等；履行大额交易和可疑交易报告义务，并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规，要求资产委托人积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序。

(35) 采取了适当的措施，确保资产管理计划的委托人、受益所有人等不得为我国公安部等有权部门发布的恐怖活动组织及恐怖活动人员名单，不得为联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的反洗钱和反恐怖融资名单，或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单。

(36) 资产管理计划的投资行为不得违反我国、联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的有关经济制裁或反洗钱法律法规，或用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途。

(37) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。

### （三）托管人

#### 1、托管人简况

机构名称：平安银行股份有限公司北京分行

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 158 号远洋大厦 5F

负责人：鞠维萍

电话：（010）66292298

#### 2、托管人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

- (1) 按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；
- (2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；
- (3) 按照托管协议的约定监督管理人集合计划的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反托管协议之附件《交易监控合规表》对投资范围及投资比例约定的，如指令未生效，有权予以制止。如指令已生效，则按指令划款后，有权要求管理人纠正；
- (4) 查询集合计划的经营运作情况；
- (5) 托管协议与本合同、说明书约定不一致的，托管人的托管职责以托管协议的约定为准；
- (6) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

### 3、托管人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

- (1) 安全保管资产管理计划财产；
- (2) 除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；
- (3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；
- (4) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- (5) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；
- (6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；
- (7) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；
- (8) 根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见；
- (9) 编制托管年度报告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以

及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送；

(10) 按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(11) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；

(12) 根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(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资产管理合同约定的，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；

(14) 依照法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自自动用或处分集合计划资产；

(15) 在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管集合计划的资产，确保集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；

(16) 定期核对资产管理业务资产情况；

(17) 建立与管理人的对账机制，复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值和资产管理计划参与、退出价格；

(18) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

(19) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告管理人；

(20) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(21) 因管理人过错造成集合计划资产损失的，应配合委托人向管理人追偿；

(22) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的，由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；

(23) 投资于《管理办法》第三十八条第（5）项规定资产时，准确、合理

界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；

（24）国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。”

**六、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”更名为“五、资产管理计划的基本情况”，其中：**

**原：**

“（一）名称及类型：首创证券创赢4号集合资产管理计划；固定收益类集合资产管理计划

（二）集合资产管理计划目标规模

本集合计划推广期和存续期规模上限为50亿元，单个客户首次参与金额不低于50万元。本集合计划委托人数量为2人以上（含）200人以下（含）。

管理人有权根据实际情况调整推广期的目标规模以及单个客户首次参与金额，并由管理人在管理人指定网站公告。

（三）投资目标、投资范围和投资比例

1、投资目标

本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资，在有效控制投资风险的基础上，力争获取稳健的投资回报。

2、投资范围

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

3、资产配置比例

（1）固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、同业存单、企业债、项目收益债（NPB）、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、资产支持证券（含证监会和银保监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券，限优先级，且底层不为产品）、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等银行间市场交易的投资品种、超过7天的债券逆回购、债券型公募基金等。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或

债项评级至少有一项在 AA 及以上级别，短期融资券、超短期融资券、短期公司债券如有债项评级则不低于 A-1。

(2) 现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在 1 年内（含 1 年）的国债、到期日在 1 年内（含 1 年）的央行票据、到期日在 1 年内（含 1 年）的政府债券、不超过 7 天（含 7 天）的债券逆回购等。

(3) 固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的 80%-100%。

全体委托人一致同意，在本资产管理计划存续期间，为规避特定风险保护投资者合法权益的，本产品投资于固定收益资产的比例可以低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。

(4) 债券回购：债券正回购或逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的 100%。

(5) 本资产管理计划的总资产不得超过净资产的 200%。

(6) 以成本价计算，本集合计划投资于单一标的债券金额不得超过该债券存续规模的 25%，且不得超过本计划资产净值的 25%。本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的 25%，也不得超过该资产的 25%，银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

(7) 本集合资产管理计划不得直接投资商业银行信贷资产；也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。

(8) 本集合资产管理计划不得投资于将资管/信托产品或其收/受益权作为底层资产的资产支持证券或资产支持票据。

(9) 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。

本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。

委托人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、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，交易完成 10 个工作日内，管理人应书面通知委托人和托管人，并采取有效措施防范利益冲突保护投资者合法权益。

本计划自投资运作期开始之日起 6 个月内使集合资产管理计划的投资组合比例符合上述资产组合比例的要求。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 10 个交易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、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 15 个交易日内将投资比例降至许可范围内。托管人按照托管协议之附件《交易监控合规表》的约定对集合计划的投资范围及投资比例进行监督。

#### （四）管理期限

本集合计划存续期为 10 年，可展期。

#### （五）封闭期、开放期安排

1、封闭期：除开放期和临时开放期以外的期间为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。

#### 2、开放期：

本集合计划每 12 个月开放一次，若开放期遇法定节假日、休息日等则自动顺延。具体以管理人公告为准。

本集合计划于推广期或开放期前公告下一个封闭期的业绩报酬计提基准、具体开放日等相关要素。管理人通过深入分析国内外宏观经济走势、社会资金运动及各项宏观经济政策对金融市场特别是货币市场的影响，密切关注市场资金面松紧变化，把握市场利率走势，合理确定集合计划的规模、投资标的以及业绩报酬计提基准的范围。管理人确定业绩报酬计提基准主要基于集合计划投资的债券回购、债券、货币市场基金等的收益情况估算，但并不是管理人向委托人保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺，投资风险为委托人自行承担。

本集合计划合同变更时，管理人将公告临时开放期，委托人可在合同变更临时开放期退出集合计划。

#### （六）集合计划份额面值

人民币 1.00 元。

#### （七）参与本集合计划的最低金额

首次参与的最低金额为人民币 50 万元，具体以管理人公告为准，追加参与的金额为人民币 10000 元的整数倍。

#### （八）本集合计划的风险收益特征及适合推广对象

本计划属于 R2 风险等级的证券投资产品。适合向风险承受能力 C2 及以上的投资者推广。

若销售/推广机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售/推广机构评定的风险等级为准。销售/推广机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理计划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：

（1）具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：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；

（2）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；

（3）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、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

（4）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；

（5）基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

（6）中国证监会视为合格投资者的其他情形。

#### （九）本集合计划的推广

1、推广机构：指首创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。

#### 2、推广方式

推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大历史业绩和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。



管理人及推广机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券投资基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得通过广播、电视、报刊及其他公共媒体推广本集合计划。

(十) 本集合计划的各项费用

1、参与费：0%

2、托管费：0.05%/年

3、管理费：0.7%/年

4、退出费：0%

5、业绩报酬：对年化收益率超过业绩报酬计提基准以上的部分提取 60%作为管理人的业绩报酬，剩余 40%作为超额收益分配给委托人。

6、其他费用：包括证券交易费用、证券账户开户费、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用、会计师费、律师费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用。”

**变更为：**

“(一) 资产管理计划名称

首创证券创赢 4 号集合资产管理计划

(二) 资产管理计划类型

私募固定收益类集合资产管理计划

(三) 资产管理计划运作方式

开放式

(四) 资产管理计划目标规模

本集合计划推广期及存续期规模上限为 50 亿元，单个客户首次参与金额不低于 30.00 万元（具体以管理人公告为准）。本集合计划委托人数量为 2 人以上（含）200 人以下（含）。

管理人有权根据实际情况调整推广期的目标规模，并由管理人在管理人指定网站公告。

(五) 资产管理计划投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

### 1、投资目标

本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资，在有效控制投资风险的基础上，力争获取稳健的投资回报。

### 2、主要投资方向

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等标准化债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。

(1) 固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债、金融机构次级债）、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和银保监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、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等投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型公募基金。

(2) 现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在 1 年内（含 1 年）的国债、到期日在 1 年内（含 1 年）的央行票据、到期日在 1 年内（含 1 年）的政府债券、不超过 7 天（含 7 天）的债券逆回购。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别（若无主体评级则取债项评级，若无债项评级则取主体评级）。短期融资券、超短期融资券发行人主体评级不得低于 AA，短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于 A-1。资产支持证券债项评级不得低于 AA。

(3) 本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。

### 3、投资比例

(1) 固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的 80%-100%。

(2) 债券逆回购资金余额不超过上一日计划资产净值的 100%。

(3) 债券正回购资金余额不超过上一日计划资产净值的 100%。

(4) 本集合计划的总资产不得超过该产品净资产的 200%。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。

(5) 本集合计划参与债券发行申购时，本集合计划所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，本集合计划所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。

(6) 本集合计划投资于单一债券的投资金额不得超过债券存续规模的 25%，且投资于单一债券的金额（以市值计）不得超过本集合计划资产净值的 25%；本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的 25%，也不得超过该资产的 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，本集合计划管理人管理的全部集合资管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。

主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不超过本资产管理计划资产净值的 20%。

本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。

#### 4、产品风险等级

本集合计划的风险等级为 R2，适合风险承受能力等级匹配且法律法规及监管规定允许投资的个人投资者、机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买资产管理计划的其他投资者。

若销售机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

#### (六) 资产管理计划管理期限

本集合计划管理期限为 10 年固定期限。

#### (七) 资产管理计划份额面值

本集合计划份额的初始募集面值为人民币 1.00 元。

#### (八) 资产管理计划最低初始募集规模

本集合计划的最低初始募集规模为人民币 1000.00 万元，管理人可以公告提高最低初始募集规模。

#### (九) 资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构，

列明服务机构的名称和在证券投资基金业协会登记的业务登记编码（如有）

本集合计划聘请中国证券登记结算有限责任公司作为本集合计划的份额登记机构，估值与核算、信息技术系统等服务机构为管理人。

#### （十）资产管理计划的销售

##### 1、销售机构

指管理人及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理销售本集合资产管理计划的机构。

##### 2、销售方式

销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大历史业绩和商业贿赂等不正当手段销售集合计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券投资基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得通过广播、电视、报刊及其他公共媒体销售本集合计划。”

#### 七、原合同“六、资产管理计划的募集”部分，

原：

##### “（一）资产管理计划的募集对象、募集方式和募集期限

##### 1、募集对象

本集合计划应当面向合格投资者，合格投资者累计不得超过 200 人。委托人应确保自身符合合格投资者条件。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于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和法人或者其他组织。

（1）具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元。

（2）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。

(3) 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、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

(4) 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；

(5) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。依法设立并受监管的各类投资产品视为单一合格投资者。

## 2、募集方式

本计划通过管理人及管理人委托的代销机构进行募集。本计划募集机构及其从业人员以非公开方式向投资者募集资金。

## 3、募集期限

本计划的募集期限由管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 天。管理人有权根据本计划销售的实际情况按照相关程序延长或缩短初始销售期，此类变更适用于所有募集机构。延长或缩短募集期的相关信息将及时发布通知，即视为履行完毕延长或缩短募集期的程序。

### （二）募集账户信息

本计划销售募集账户由计划管理人和管理人委托的销售机构自行开立并自行聘请监督机构对其进行监督，销售募集账户的开户行、账户名称、账户号码及监督机构等信息以计划管理人或销售机构届时公告为准。

### （三）资产管理计划的认购事项

投资者认购本计划，以人民币货币资金形式交付。本计划不接受现金方式认购，在直销机构认购的投资者须将认购资金从在中国境内开立的自有银行账户划款至募集账户，在代销机构认购的投资者按代销机构的规定缴付资金。

## 1、份额持有人的人数上限

本计划向合格投资者募集，合格投资者人数累计不得超过二百人。

## 2、份额的认购费用

本计划认购费用为 0。

## 3、认购申请的确认

认购申请受理完成后，不得撤销。募集机构受理认购申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表募集机构确实收到了认购申请。认购的确认以管理人的确认结果为准。若认购不成功，投资者已交付的款项将于计划成立后五个工作日内，无利息地退还至投资者银行账户。

本计划的人数规模上限为 200 人。管理人在募集期间每个工作日可接受的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效认购申请。超出计划人数规模上限的认购申请为无效申请。

通过代销机构进行认购的，人数规模控制以管理人和代销机构约定的方式为准。

## 4、认购份额的计算方式

认购份额=（认购金额+认购资金利息）/认购份额初始面值。

其中，上述公式认购金额不包括额外缴纳的认购费。

认购份额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

## 5、初始销售期间投资者资金的管理及利息处理方式

募集机构应当将计划初始销售期间投资者的资金存入募集结算资金专用账户，在计划初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。计划成立前，认购款在募集结算资金专用账户产生的利息将折算为计划份额归委托人所有，利息金额以实际账户结息利率计息。利息金额在募集结算资金专用账户实际结息后折算为计划份额归委托人所有。

### （四）计划份额认购金额

投资者在募集期间的认购金额应不低于 30 万元人民币（不含认购费），追加参与的金额为人民币 10000 元的整数倍。”

## 变更为：

“（一）资产管理计划的募集对象、募集方式和募集期限

### 1、募集对象

本集合计划应当面向合格投资者，合格投资者总计不得超过 200 人。委托人应确保自身符合合格投资者条件。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于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和法人或者其他组织。

(1) 具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：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；

(2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；

(3) 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、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

(4) 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；

(5) 基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。依法设立并受监管的各类投资产品视为单一合格投资者。

### 2、募集方式

本集合计划通过管理人及管理人委托的销售机构进行募集，募集机构及其从业人员以非公开方式向投资者募集资金。

### 3、募集期限

本集合计划的募集期限由管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 天。管理人有权根据本集合计划销售的实际情况按照相关程序延长或缩短初始销售期，此类变更适用于所有募集机构。延长或缩短募集期的相关信息将及时发布通知，即视为履行完毕延长或缩短募集期的程序。

## （二）资产管理计划的认购事项

### 1、份额的认购费用

本集合计划认购费用为 0.00%。

### 2、认购申请的确认

认购申请受理完成后，不得撤销。销售机构受理认购申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了认购申请。认购的确认以管理人的确认结果为准。若认购不成功，投资者已交付的款项将于认购确认失败后五个工作日内退还至投资者银行账户。

本集合计划向合格投资者募集，合格投资者人数不得超过 200 人。管理人在募集期间每个工作日可接受的人数限制内，按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效认购申请。超出计划人数规模上限的认购申请为无效申请。

### 3、认购份额的计算方式

认购份额=（认购金额+认购金额利息）/初始募集面值

其中，上述公式认购金额不包括额外缴纳的认购费。

认购份额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入本集合计划财产。

### 4、初始销售期间投资者资金的管理及利息处理方式

销售机构应当将计划初始销售期间投资者的资金存入募集结算资金专用账户，在计划初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。本集合计划成立前，认购款在募集结算资金专用账户产生的利息将折算为计划份额归委托人所有，利息金额以实际账户结息利率计息。利息金额在募集结算资金专用账户实际结息后折算为计划份额归委托人所有。

## （三）资产管理计划最低认购金额及支付方式

### 1、最低认购金额

投资者在募集期间的认购金额应不低于 30.00 万元人民币（不含认购费）。

### 2、支付方式

投资者认购本集合计划，以人民币货币资金形式交付，按照销售机构的规定缴付资金。

## （四）资产管理计划募集账户信息



1、管理人募集期交收账户

账号：0200006319100055587

户名：首创证券股份有限公司

开户行：中国工商银行股份有限公司北京惠新支行

大额支付号：102100000634

2、管理人存续期交收账户

账号：0200006319100055614

户名：首创证券股份有限公司

开户行：中国工商银行股份有限公司北京惠新支行

大额支付号：102100000634

3、销售机构募集账户

本集合计划销售机构募集账户的开户行、账户名称、账户号码及监督机构等信息以销售机构届时公告为准。”

**八、原合同“七、资产管理计划的成立与备案”部分，**

**原：**

**“（一）集合计划成立的条件和日期**

集合计划的募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定，初始募集资金总额(不含参与费)达到中国证监会规定的集合资产管理计划最低募集规模(即人民币 1000 万元)且其委托人的人数为 2 人(含)以上，并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，并将成立公告提供给托管人。集合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告，并在取得验资报告后公告资产管理计划成立。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金，自募集资金账户向托管户划款的除外。

**（二）集合计划设立失败**

集合计划初始募集期结束，在集合计划初始募集资金总额(不含参与费)低于中国证监会规定的集合资产管理计划最低募集规模(即人民币 1000 万元)或委托人的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败。管理人需以固有财产承担因

募集行为而产生的债务和费用，并将已认购资金及银行同期活期存款利息在初始募集期结束后 30 日内退还集合计划委托人。

### （三）集合计划开始运作的条件和日期

- 1、条件：本集合计划公告成立。
- 2、日期：本集合计划自成立之日起开始运作。

### （四）集合计划的备案

管理人应当在集合资产管理计划成立之日起 5 个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告等材料报中国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（如需）。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。”

### 变更为：

#### “（一）资产管理计划成立的条件

本集合计划的募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定，初始募集规模（不含认购费）不低于 1000.00 万元，投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人。本集合计划的募集金额全部划入本集合计划托管账户后，管理人应在十个工作日内公告资产管理计划成立。

本集合计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金，自募集账户向托管账户划款的除外。

#### （二）资产管理计划募集失败的处理方式

本集合计划初始募集期结束，在集合计划初始募集资金总额（不含认购费）低于中国证监会规定的集合资产管理计划最低募集规模（即人民币 1000 万元）或投资者人数少于 2 人的条件下，本集合计划设立失败。管理人需以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并在募集期届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

#### （三）资产管理计划的备案

管理人应当在本集合计划成立之日起 5 个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、资产缴付证明等材料按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。本集合计划在成立后

备案完成前，可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。”

## 九、原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”部分，

原：

### “（一）集合计划的参与

#### 1、参与的办理时间

##### （1）推广期参与

在推广期内，投资者在工作日内可以参与本集合计划。如本集合计划在推广期内参与金额或人数达到发行公告上限，可提前终止推广期。管理人在推广期内使用“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。

##### （2）存续期参与

本集合计划投资者可在本合同约定的开放期（临时开放期除外）内办理参与本集合计划的业务。具体开放参与安排以管理人公告为准。

#### 2、参与的原则

（1）采用金额参与的方式，即以参与金额申请；

（2）推广期参与价格以人民币 1.00 元为基准进行计算份额；存续期开放申购日内集合计划参与价格以申请当日的单位净值为基准进行计算。

（3）本集合计划份额参与金额或参与人数不超过每次发行公告上限。管理人使用“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对集合计划每次参与规模和人数实行限量控制。

（4）委托人参与本集合计划，应当是合格投资者。合格投资者是指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力且符合下列条件之一的单位和个人：

具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：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；

最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；

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、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

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；

基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

中国证监会视为合格投资者的其他情形。

### 3、参与的程序和确认

（1）投资者按推广机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

（2）投资者应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔参与申请；

（3）投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认后有效后，构成本合同的有效组成部分；

（4）投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销；

（5）投资者于 T 日提交参与申请后，管理人按照“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对参与总规模实行限量控制。投资者可于 T+2 日后在办理参与的网点查询参与确认情况。

### 4、参与费及参与份额的计算

（1）参与费率：本集合计划无参与费

（2）参与份额的计算方法：

#### ①推广期参与

参与份额 = (参与金额 + 参与资金利息) ÷ 计划单位面值

#### ②存续期参与

参与份额 = 参与金额 ÷ 参与日计划单位净值

委托人参与份额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。

### 5、参与资金利息的处理方式

委托人的参与资金在推广期产生的利息按照银行同期活期存款利率计算，并将折算为计划份额归委托人所有，其中利息以注册登记机构的记录为准。

## 6、暂停参与的情形

如出现如下情形，集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划委托人的参与申请：

- (1) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运行；
- (2) 管理人认为本集合计划出现或可能出现超额募集情况；
- (3) 证券交易场所所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的集合计划资产净值；
- (4) 管理人认为集合计划资产规模过大，可能对集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有集合计划委托人的利益；
- (5) 集合计划管理人、集合计划托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；
- (6) 推广机构对委托人资金来源表示疑虑，委托人不能提供充分证明的；
- (7) 集合计划管理人认为会有损于现有集合计划委托人利益；
- (8) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形；

发生上述（1）到（5）项情形时，集合计划管理人应当通过管理人网站报告委托人。

## （二）集合计划的退出

### 1、退出的办理时间

本集合计划投资者在集合计划的开放期的第一个工作日可办理退出本集合计划的业务，具体安排以管理人公告为准。

### 2、退出的原则

（1）集合计划各份额的退出采取“未知价”原则，即退出集合计划的价格以集合计划单位净值为基准进行计算；

（2）采用份额退出的方式，即退出以份额申请。

（3）“先进先出”原则，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额。

### 3、退出的程序和确认

### （1）退出申请的提出

集合计划委托人必须根据集合计划推广机构规定的手续，向集合计划推广机构提出参与或退出的申请。退出申请，委托人需于 T-5 日前向推广机构提交预约退出材料，管理人有权拒绝未预约退出的退出申请。

### （2）退出申请的确认和款项划付

委托人可在 T+2 日（包括该日）之后到推广机构取得 T 日退出申请成交确认单。

### （3）退出款项划付

委托人的退出申请确认后，退出款项将在 T+5 日内从托管账户划出。

## 4、退出费及退出份额的计算

### （1）退出费用

本集合计划无退出费。

### （2）退出金额的计算方法

委托人在开放日退出本计划，管理人根据计划单位份额净值计算其退出金额。

退出金额=退出份额×T 日计划单位净值（扣除业绩报酬及分红后）

退出金额采用四舍五入保留到小数点后两位，由此产生的误差计入集合计划资产。

### （3）收取方式

本集合计划无退出费用，不存在退出费用的收取。

## 5、退出的限制与次数

集合计划份额持有人持有的集合计划资产净值高于 30 万元时，可以选择部分退出集合计划份额，集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30 万元。集合计划份额持有人申请退出集合计划份额时，其持有的集合计划资产净值低于 30 万元的，必须选择一次性退出全部集合计划份额，集合计划份额持有人没有一次性全部退出持有份额的，管理人将该集合计划份额持有人所持份额做全部退出处理。

## 6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

### （1）单个委托人大额退出的认定

对单个委托人单日退出份额超过上一工作日计划总份额数的 10%时，即视为

单个委托人大额退出。如果大额退出情况触发巨额退出条件，按照巨额退出进行认定和处理。

#### (2) 单个委托人大额退出的申请和处理方式

委托人必须提前 5 个工作日直接或通过销售机构向管理人预约申请；大额退出未预约申请，管理人有权拒绝接受其退出申请。

### 7、巨额退出的认定和处理方式

#### (1) 巨额退出的认定

单个开放日，委托人当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一工作日计划总份额数的 20%时，即为巨额退出。

#### (2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出：

**全额退出：**当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时，按正常退出程序办理。

**部分顺延退出：**当管理人认为支付委托人的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额 10%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，委托人可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以该工作日的计划单位份额净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

#### (3) 告知客户的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

### 8、连续巨额退出的认定和处理方式

#### (1) 连续巨额退出的认定

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

#### (2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按说明书及资产管理合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在管理人指定网站上进行公告。

#### 9、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理委托人的退出申请：

- (1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常工作；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；
- (3) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有委托人利益时；
- (4) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；
- (5) 法律、行政法规和中国证监会认定的其他情形或其他在说明书、资产管理合同中已载明且中国证监会无异议的特殊情形。

#### (三) 集合计划份额的转让

集合计划存续期间，经管理人同意后投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。

转让后，持有资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。受让方首次参与集合计划，应满足合格投资者的条件。转让完成之日，受让人即自动成为本合同当事人，享有合同项下相关权利义务。

#### (四) 集合计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定及费用标准办理。

#### (五) 集合计划份额的冻结



资产管理计划份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

资产管理计划注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的资产管理计划份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的资产管理计划份额的冻结与解冻。

当资产管理计划份额处于冻结状态时，资产管理计划注册登记机构或其他相关机构有权拒绝资产管理计划份额的退出、非交易过户等业务的申请。

**(六) 管理人自有资金参与集合计划**

管理人可选择以自有资金参与本集合计划份额。

(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的相关规定。

(2) 自有资金参与的金额和比例：自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 50%。

(3) 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。

(4) 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时的处理原则及处理措施：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，管理人将在 5 个工作日内公告退出安排。

(5) 信息披露：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。

(6) 自有资金责任承担方式和金额：管理人自有资金参与的享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。

(7) 收益分配以管理人的公告为准。”

**变更为：**

**“(一) 参与和退出场所**

本集合计划运作期间的销售机构包括计划管理人和/或计划管理人委托的销售机构。

本集合计划投资者应当按照销售机构提供的方式办理本集合计划份额的申购和赎回。管理人可根据情况变更或增减计划销售机构，并予以通知。

## （二）参与和退出的开放日及时间

投资者可在本集合计划开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本集合计划，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。

本集合计划每 12 个月开放一次，开放期为 1 个交易日，具体以管理人公告为准，开放期内接受投资者参与和退出申请。除上述开放期开放参与外，本集合计划自运作周期起始运作日起（运作周期起始日视为第 1 个自然日）的第 7 个自然日开放参与申请，当日不受理退出申请，开放期为 1 个交易日，若开放期遇法定节假日、休息日等则顺延至下一交易日，具体参与开放期届时以管理人公告为准。

## （三）临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

本合同可以在合同变更等符合监管规定的条件下设置临时开放期。临时开放期的触发条件、程序及披露的相关安排详见“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”。

## （四）参与和退出的方式、价格、程序及确认

1、投资者参与本集合计划时，按照参与申请所对应开放日的集合计划份额净值为基准计算集合计划份额。集合计划份额持有人退出本集合计划时，按照退出申请所对应开放日的集合计划份额净值计算退出金额。

2、“未知价”原则，即本集合计划的参与价格、退出价格以开放日收市后计算的集合计划份额净值为基准进行计算。

3、本集合计划参与采用金额申请的方式，退出采用份额申请的方式。

4、本集合计划份额持有人退出集合计划时，管理人按先进先出的原则，按投资者认购、申购本集合计划份额的先后次序进行顺序赎回。

### 5、参与和退出的程序及确认

#### （1）参与的程序及确认

①投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

②投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请；

③投资者签署本合同后，方可申请参与本集合计划。参与申请经管理人确认

有效后，构成本合同的有效组成部分；

④投资者参与申请确认后，其参与申请不得撤销；

⑤投资者于 T 日提交参与申请后，管理人按照“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对参与总人数实行限量控制。投资者可于 T+2 日后在办理参与的网点查询参与确认情况。

## （2）退出的程序及确认

### ①退出申请的提出

投资者必须根据集合计划销售机构规定的手续，向本集合计划销售机构提出退出的申请。

### ②退出申请的确认和款项划付

投资者可在 T+2 日（包括该日）之后到销售机构取得 T 日退出申请成交确认单。

### ③退出款项划付

投资者的退出申请确认后，退出款项将在 T+5 日内从托管账户划出，T+8 个交易日到账。

## （五）参与和退出的金额限制

### 1、参与的金額限制

投资者在存续期开放日购买本集合计划份额的，应符合合格投资者标准，首次参与金额应不低于 30.00 万元人民币（不含参与费）。

### 2、退出的金額限制

本集合计划份额持有人持有的集合计划资产净值高于 30.00 万元时，可以选择部分退出集合计划份额，退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30.00 万元。本集合计划份额持有人申请退出集合计划份额时，其持有的集合计划资产净值低于 30.00 万元的，必须选择一次性退出全部集合计划份额，没有一次性全部退出持有份额的，管理人将对该集合计划份额持有人所持份额做全部退出处理。

## （六）参与和退出的费用

### 1、参与费用

本集合计划无参与费。

### 2、退出费用

本集合计划无退出费。

(七) 参与份额与退出金额的计算方式

1、参与份额计算

参与份额=参与金额÷参与日计划单位净值

委托人参与份额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。

2、退出金额计算

退出金额=申请退出份额×申请退出日集合计划单位净值-业绩报酬(如有)-退出费用(如有)

退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。

(八) 参与资金的利息处理方式

委托人的参与资金在初始募集期产生的利息按照银行同期活期存款利率计算，并将折算为计划份额归委托人所有，其中利息以注册登记机构的记录为准。

(九) 报送投资者更新情况

管理人应定期将本集合计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

(十) 单个委托人大额退出、巨额退出和连续巨额退出

1、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

(1) 单个委托人大额退出的认定

对单个委托人单日退出份额超过上一交易日计划总份额数的10%时，即视为单个委托人大额退出。如果大额退出情况触发巨额退出条件，按照巨额退出进行认定和处理。

(2) 单个委托人大额退出的申请和处理方式

委托人必须提前5个交易日通过销售机构向管理人预约申请；大额退出未预约申请的，管理人有权拒绝其退出申请。

2、巨额退出的认定和处理方式

(1) 巨额退出的认定

单个开放日，委托人当日累计净退出申请份额(退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额)超过上一交易日计划总份额数的20%时，即为巨额退出。

## （2）巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出：

**全额退出：**当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时，按正常退出程序办理。

**部分顺延退出：**当管理人认为支付委托人的退出申请可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额 10% 的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，委托人可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个交易日内办理，并以该交易日的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间 20 个交易日，转入下一个交易日的退出申请不享有优先权。

## （3）告知客户的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个交易日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

### 3、连续巨额退出的认定和处理方式

#### （1）连续巨额退出的认定

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

#### （2）连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按说明书及本合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个交易日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个交易日，并在管理人指定网站上进行公告。

## （十一）延期支付及延期退出的情形和处理方式

1、因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

2、发生本合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日集合计划资

产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额退出。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有集合计划份额持有人利益的情形时，管理人可暂停接受集合计划份额持有人的赎回申请。

6、当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受本集合计划赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应在当日报中国证券投资基金业协会备案，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按本合同的相关条款处理。集合计划份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

## （十二）拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式

### 1、暂停参与的情形

如出现如下情形，管理人可以拒绝或暂停委托人的参与申请：

（1）战争、自然灾害等不可抗力的原因导致本集合计划无法正常运作；

（2）管理人认为本集合计划出现或可能出现超额募集情况；

（3）证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的集合计划资产净值；

（4）本集合计划管理人、托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；

（5）管理人认为继续参与会加大本集合计划投资难度或有损于现有委托人利益；

（6）销售机构对委托人资金来源表示疑虑，委托人不能提供充分证明的；

（7）法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。

发生上述（1）到（5）项情形时，管理人应当通过管理人网站向委托人公告。

## 2、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理委托人的退出申请：

- (1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；
- (3) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有委托人利益时；
- (4) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金出现困难时，管理人可以拒绝或暂停接受本集合计划的退出申请；
- (5) 法律、行政法规和中国证监会、基金业协会认定的其他情形。

### (十三) 集合计划份额的转让

集合计划存续期间，经管理人同意后投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。

转让后，持有资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过 200 人。受让方首次参与集合计划，应满足合格投资者的条件。转让完成之日，受让人即自动成为本合同当事人，享有合同项下相关权利义务。

### (十四) 集合计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定及费用标准办理。

### (十五) 集合计划份额的冻结

集合计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。

### (十六) 自有资金参与集合计划

证券期货经营机构及其子公司可选择以自有资金参与本集合计划，自有资金参与本集合计划的方式可以为认购、申购、强制调增。

### 1、自有资金参与及退出的条件

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于6个月。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与或退出前，管理人应当提前5个工作日采用包括但不限于函件、公告等形式告知全体投资者和托管人，并取得其同意后方可参与或退出。投资者如不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出，可以在管理人发布的函件、公告等文件中告知的开放期提出退出申请并退出本集合计划。如公告期届满，投资者未退出本集合计划的，则默认其同意自有资金相关变动。托管人如不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出，可以按管理人发布的函件、公告等文件中告知的方式向管理人提出异议。如公告期届满，托管机构未提出异议，则默认其同意自有资金相关变动。证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出份额或比例以管理人公告为准。

投资者和托管人签署本合同即表明同意证券期货经营机构及其子公司在本集合计划成立时可以以自有资金参与本集合计划。

### 2、自有资金参与的金额和比例

管理人以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的20%，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不超过本集合计划总份额的50%。为应对巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合资产管理计划可以在履行内部审批程序并符合证监会其他规定的情况下，适当提高自有资金参与比例，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。具体参与比例以管理人公告为准。

### 3、客观因素导致自有资金超限的处理原则及措施

因本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，证券期货经营机构及其子公司应当在5个工作日内退出。

### 4、自有资金参与计划信息披露要求

证券期货经营机构及其子公司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并征求托管人及投资者意见（因集合资产管理计划规模变动导致自有资金被动超限的除外）。



#### 5、自有资金责任承担方式

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与，享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。

#### 6、证券期货经营机构及其子公司自有资金的收益分配

收益分配以管理人的公告为准。

上述证券期货经营机构，指管理人及其关联方、关联方的关联方中从事证券期货业务的证券公司、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，若监管部门有其他要求的，以监管部门最新要求为准。”

#### 十、原合同“九、份额持有人大会及日常机构”部分，

原：

“本计划不设置份额持有人大会及日常机构。”

变更为：

“本集合计划不设置份额持有人大会及日常机构。”

#### 十一、原合同“十、资产管理计划份额的登记”部分，

原：

“本集合资产管理计划的份额登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。全体资产管理计划份额持有人同意管理人将集合资产管理计划投资者名称、身份信息以及本集合资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。”

变更为：

“（一）本集合资产管理计划的份额登记机构为中国证券登记结算有限责任公司（业务登记编码：91100000710927994X）。

（二）全体资产管理计划份额持有人同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将集合资产管理计划投资者名称、身份信息以及集合资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。”

#### 十二、原合同“十一、资产管理计划的投资”部分，

原：

#### “（一）投资目标

本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资，在有效控制投资风险的基础上，力争获取稳健的投资回报。

#### （二）投资范围及比例

##### 1、投资范围

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

##### 2、资产配置比例

（1）固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、同业存单、企业债、项目收益债（NPB）、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、资产支持证券（含证监会和银保监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券，限优先级，且底层不为产品）、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等银行间市场交易的投资品种、超过7天的债券逆回购、债券型公募基金等。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在AA及以上级别，短期融资券、超短期融资券、短期公司债券如有债项评级则不低于A-1。

（2）现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在1年内（含1年）的国债、到期日在1年内（含1年）的央行票据、到期日在1年内（含1年）的政府债券、不超过7天（含7天）的债券逆回购等。

（3）固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的80%-100%。

全体委托人一致同意，在本资产管理计划存续期间，为规避特定风险保护投资者合法权益的，本产品投资于固定收益资产的比例可以低于计划总资产的80%，但不得持续6个月低于计划总资产的80%。

（4）债券回购：债券正回购或逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的100%。

（5）本资产管理计划的总资产不得超过净资产的200%。

（6）以成本价计算，本集合计划投资于单一标的债券金额不得超过该债券

存续规模的 25%，且不得超过本计划资产净值的 25%。本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的 25%，也不得超过该资产的 25%，银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

(7) 本集合资产管理计划不得直接投资商业银行信贷资产；也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。

(8) 本集合资产管理计划不得投资于将资管/信托产品或其收/受益权作为底层资产的资产支持证券或资产支持票据。

(9) 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。

本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。

委托人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、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，交易完成 10 个工作日内，管理人应书面通知委托人和托管人，并采取有效措施防范利益冲突保护投资者合法权益。

### (三) 投资比例超限的处理方式及流程

本集合计划的建仓期为自产品成立之日起 6 个月的期限。本计划自投资运作期开始之日起 6 个月内使集合资产管理计划的投资组合比例符合上述资产组合比例的要求。建仓期的投资活动，应当符合资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

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证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。计划持有债券资产期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，管理人应在评级报告发布之日起且具备交易条件的 10 个工作日内予以全部卖出。

委托人在此同意，本计划存续期间，为规避特定风险，本计划投资于固定收益类资产的比例可以低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。

#### （四）风险收益特征

本计划属于中低风险 R2 的证券投资产品。

#### （五）业绩比较基准

本计划不设业绩比较基准。

#### （六）投资策略

##### 1、决策依据

集合计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护集合计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

（1）《管理办法》、《运作规定》、《指导意见》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关规范性文件；

（2）根据宏观、微观经济环境和有关经济政策以及证券市场趋势制定投资策略；

（3）在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是本集合计划维护投资者利益的重要保障。在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，力争保护投资者的本金安全，在控制风险的前提下追求收益的最大化。

##### 2、投资程序

（1）投资经理根据研究报告，结合对投资品种的分析判断，形成本集合计划的投资预案。

（2）交易人员依据投资经理指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易；投资经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

（3）管理人风控岗对投资计划的过程进行日常监督和风险控制，投资经理根据本集合资产管理计划退出的情况控制投资组合的流动性；

（4）管理人在确保本集合资产管理计划委托人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

##### 3、具体的投资策略

### （1）资产配置策略

本集合计划主要资产投资于固定收益类金融工具，并在严格控制风险的基础上，通过对全球经济形势、中国经济发展（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况）、证券市场估值水平等的研判，动态调整计划各类资产的投资比例，力争为计划资产获取稳健回报。

### （2）债券投资策略

#### 1) 利率预期策略

管理人通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平。

#### 2) 收益率曲线策略

管理人通过对债券市场微观因素的分析判断，形成对未来收益率曲线形状变化的预期，获取收益率曲线形变带来的投资收益。

#### 3) 信用策略

信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响，因此，一方面，本集合计划将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势；另一方面，采用内外结合的信用研究和评级制度，研究债券发行主体企业的基本面，以确定企业主体债的实际信用状况。

#### 4) 个券优选策略

管理人根据债券市场收益率数据，对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

### （3）新券申购策略

对于新发行的证券品种，管理人将凭借丰富的资产管理经验以及新券定价能力，可在询价与配售过程中把握主动、发挥优势，追求可控风险之下的收益最大化。

### （4）基金投资策略

本集合计划坚持从研究基金价值入手，采用定性分析与定量分析相结合的方

法，选择管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金构建备选基金池，对基金的投资理念和投资价值进行判断。

#### （七）投资限制

为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：

- 1、参见集合计划合同对投资范围、投资比例的约定；
- 2、证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资，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，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

#### （八）禁止行为

本集合计划的禁止行为包括：

- 1、违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；
- 2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；
- 3、向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；
- 4、挪用集合计划资产；
- 5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；
- 6、募集资金超过计划说明书约定的规模；
- 7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；
- 8、使用集合计划资产进行不必要的交易；
- 9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；
- 10、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

#### （九）集合计划的预警和止损机制

本计划无预警、止损机制。

#### （十）资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配

开放退出期内，其资产组合中7个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的10%，7个工作日可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具以及同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。”

## 变更为：

### “（一）投资目标

本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资，在有效控制投资风险的基础上，力争获取稳健的投资回报。

### （二）投资范围及比例

#### 1、投资范围

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等标准化债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。

（1）固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债、金融机构次级债）、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和银保监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、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等投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型公募基金。

（2）现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在 1 年内（含 1 年）的国债、到期日在 1 年内（含 1 年）的央行票据、到期日在 1 年内（含 1 年）的政府债券、不超过 7 天（含 7 天）的债券逆回购。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别（若无主体评级则取债项评级，若无债项评级则取主体评级）。短期融资券、超短期融资券发行人主体评级不得低于 AA，短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于 A-1。资产支持证券债项评级不得低于 AA。

（3）本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。

#### 2、资产配置比例及限制

（1）固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的 80%-100%。

（2）债券逆回购资金余额不超过上一日计划资产净值的 100%。

（3）债券正回购资金余额不超过上一日计划资产净值的 100%。

（4）本集合计划的总资产不得超过该产品净资产的 200%。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。

(5) 本集合计划参与债券发行申购时，本集合计划所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，本集合计划所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。

(6) 本集合计划投资于单一债券的投资金额不得超过债券存续规模的 25%，且投资于单一债券的金额（以市值计）不得超过本集合计划资产净值的 25%；本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的 25%，也不得超过该资产的 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，本集合计划管理人管理的全部集合资管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。

主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不超过本资产管理计划资产净值的 20%。

本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。

### (三) 投资比例超限的处理方式及流程

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证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 20 个交易日内将投资比例降至许可范围内。计划持有债券资产期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，管理人应在评级报告发布之日起且具备交易条件的 20 个交易日内予以全部卖出。

### (四) 风险收益特征

本集合计划属于 R2 证券投资产品。

当销售机构评定的风险等级与管理人评定的不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

### (五) 业绩比较基准

本集合计划不设业绩比较基准。



## （六）投资策略

### 1、决策依据

集合计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护集合计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

（1）《管理办法》《运作规定》《指导意见》《集合资产管理合同》《说明书》等有关规范性文件；

（2）根据宏观、微观经济环境和有关经济政策以及证券市场趋势制定投资策略；

（3）在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下做出投资决策，是本集合计划维护投资者利益的重要保障。在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，在控制风险的前提下追求收益的最大化。

### 2、投资程序

（1）投资经理根据研究报告，结合对投资品种的分析判断，形成本集合计划的投资预案。

（2）交易人员依据投资经理指令，制定交易策略，统一执行证券投资组合计划，进行具体品种的交易；投资经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权严格分离的规定。

（3）管理人风控岗对投资计划的过程进行日常监督和风险控制，投资经理根据本集合资产管理计划退出的情况控制投资组合的流动性。

（4）管理人在确保本集合资产管理计划委托人利益的前提下，有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整。

### 3、具体的投资策略

#### （1）资产配置策略

本集合计划主要资产投资于固定收益类金融工具，并在严格控制风险的基础上，通过对全球经济形势、中国经济发展（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况）、证券市场估值水平等的研判，动态调整计划各类资产的投资比例，力争为计划资产获取稳健回报。

#### （2）债券投资策略

##### ①利率预期策略

管理人通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平。

#### ②收益率曲线策略

管理人通过对债券市场微观因素的分析判断，形成对未来收益率曲线形状变化的预期，获取收益率曲线形变带来的投资收益。

#### ③信用策略

信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响，因此，一方面，本集合计划将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势；另一方面，采用内外结合的信用研究和评级制度，研究债券发行主体企业的基本面，以确定企业主体债的实际信用状况。

#### ④个券优选策略

管理人根据债券市场收益率数据，对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

#### （3）新券申购策略

对于新发行的证券品种，管理人将凭借丰富的资产管理经验以及新券定价能力，可在询价与配售过程中把握主动、发挥优势，追求可控风险之下的收益最大化。

#### （4）基金投资策略

本集合计划坚持从研究基金价值入手，采用定性分析与定量分析相结合的方法，选择管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金构建备选基金池，对基金的投资理念和投资价值进行判断。

#### （七）投资限制

为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：

- 1、参见本合同对投资范围、投资比例的约定；
- 2、本集合计划如参与证券逆回购交易，管理人应当加强流动性风险和交易对手风险的管理。本集合计划应当合理分散逆回购交易的到期日、交易对手及回

购证券的集中度。管理人应当按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查，对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整。管理人应当建立健全证券逆回购交易质押品管理制度，根据质押品资质审慎确定质押率水平，持续监测质押品的风险状况与价值变动，质押品按公允价值计算应当足额。

3、证券法规规定和本合同约定禁止从事的其他投资，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，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

#### （八）资产管理计划的建仓期

本集合计划的建仓期为自产品成立之日起6个月的期限。本集合计划自投资运作期开始之日起6个月内使本集合计划的投资组合比例符合上述资产组合比例的要求。建仓期的投资活动应当符合本合同约定的投向和本集合计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，本集合计划资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

#### （九）禁止行为

本集合计划的禁止行为包括：

- 1、违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；
- 2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；
- 3、向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；
- 4、挪用集合计划资产；
- 5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；
- 6、募集资金超过计划说明书约定的规模；
- 7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；
- 8、使用集合计划资产进行不必要的交易；
- 9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；

10、违规为地方政府及其部门提供融资，要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；

11、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

**（十）资产管理计划特定风险**

委托人同意，在本集合计划存续期间，为规避固定收益类产品特定风险，本产品投资于债权类资产的比例可以低于资产管理计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于资产管理计划总资产的 80%。

相关特定风险包括但不限于以下内容：

特定风险包括市场趋势性风险及发生巨额或连续巨额退出、预警止损引发的流动性风险等。其中趋势性风险包括但不限于基于对股市、债市、衍生品市场风险的判断，调整资产配置比例的情形。

**（十一）集合计划的预警和止损机制**

本集合计划无预警、止损机制。

**（十二）资产组合的流动性与参与、退出安排**

开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%，7 个工作日可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及标准化期权合约和同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。

本资产管理计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本资产管理计划资产净值的 20%。流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。”

**十三、原合同“十二、投资顾问”部分，**

**原：**

“本计划未聘请投资顾问。”

**变更为：**

“本集合计划未聘请投资顾问。”

**十四、原合同“十三、分级安排”部分，**

**原：**

“本计划未进行分级安排。”

**变更为：**

“本集合计划未进行分级安排。”

**十五、原合同“十四、利益冲突及关联交易”部分，**

**原：**

“1、存在或可能存在利益冲突的情形

(1) 集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划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。

(2) 集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。

(3) 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合资产管理计划的，管理人应当向投资者进行披露，对该资产管理计划账户进行监控，并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。

2、存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率

(1) 存在利益冲突的处理方式

集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划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，但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人

及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

集合计划投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意本集合计划将进行上述关联交易。管理人从事重大关联交易的，应提前二十个工作日公告并取得投资者同意，且有充分证据证明未损害投资者利益，同时应向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

集合计划份额持有人不得因本集合计划投资收益劣于集合计划管理人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向集合计划管理人或集合计划托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

#### (2) 发生利益冲突情形信息披露的方式

本集合计划发生利益冲突情形的信息披露将严格按照《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他规定进行。

本集合计划包含利益冲突情形的定期报告和临时报告等有关集合计划的信息将在管理人网站上披露，委托人可随时查阅。

管理人网站：[www.sczq.com.cn](http://www.sczq.com.cn)

#### (3) 发生利益冲突情形信息披露的内容和时间

##### 1、定期报告

定期报告包括集合计划份额净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、年度审计报告。

发生利益冲突情形需在集合计划的资产管理季度（年度）报告进行信息披露。

##### 2、临时报告

本集合计划运用受托管理资产从事关联交易的，应当于签订交易协议后 10 个工作日内（无交易协议的，自事项发生之日起 10 个工作日内），按照规定在管理人网站发布信息披露公告。

本集合计划未聘请投资顾问，不存在与投资顾问之间存在利益冲突情形。”

#### **变更为：**

“（一）存在或可能存在利益冲突的情形

1、管理人运用集合计划财产买卖管理人、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关联方在承销期内承销的证券。

2、管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理的符合本合同投资范围规定的投资产品。

3、管理人运用集合计划财产与关联方开展现券交易、债券借贷、回购交易、期权交易及接受或提供服务等其他关联交易，含逆回购交易对手方、质押券。

4、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划的，管理人应当以公告的形式在事后向投资者进行披露，对上述投资者账户进行监控，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。

(二) 存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率

1、存在利益冲突的处理方式

(1) 本集合计划的关联交易包括：

①管理人运用集合计划财产买卖管理人、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关联方在承销期内承销的证券。

②管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理的符合本合同投资范围规定的投资产品。

③与关联方开展现券交易、债券借贷、回购交易、期权交易及接受或提供服务等其他关联交易，含逆回购交易对手方、质押券；

④法律法规或监管机构另有规定的，以另有规定为准。

(2) 管理人对关联交易按照重要性原则进行分层管理，关联交易分为一般关联交易和重大关联交易。管理人关联方范围、一般关联交易和重大关联交易的划分标准、关联交易审批机制等内部管控机制如下：

①资产管理产品的关联方主要包括：

a、管理人管理的其他资产管理产品、提供投资顾问建议的其他资产管理产品，管理人及其关联方；

b、产品托管人及其控股股东、实际控制人或与其有其他重大利害关系的公司；

c、产品投资顾问及其控股股东、实际控制人或者与其有其他关联关系的机构；

d、其他可能导致资产管理计划存在利益输送的业务主体。

②资产管理产品的重大关联交易包括：

a、投资交易对手或投资标的为产品关联方，且单笔结算金额达到 2000（不含）万元人民币以上，且占该资产管理计划上一日资产净值的比例达到 20%（不含）以上的，构成重大关联交易。前述交易不包括以下情形：

b、投资于银行存款、同业存单、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等现金管理类投资品种涉及的相关交易。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按监管最新规定履行。

③产品一般关联交易指产品重大关联交易之外的其他关联交易。

④关联交易审批情况：资产管理业务关联交易除履行正常交易审批程序外，尚需经过资产管理事业部合规岗、风控岗和公司合规部、风险管理部审批。

### （3）关联方名单

①管理人关联方名单以管理人官网披露为准。

②托管人关联方名单及更新以托管人年报或官网披露的最新版年报为准，若因托管人关联方信息未及时披露或更新造成的后果，管理人不承担责任。管理人依据年报生成的托管人关联方清单与托管人监督口径不一致的，管理人不承担责任。

对于一般关联交易，委托人签署本合同即表明其事先同意管理人开展一般关联交易，事后管理人可以采用定期统一披露或逐笔单独披露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。对于重大关联交易，管理人采用事先逐笔征求意见或公告确认方式取得委托人同意，并事后采用逐笔单独披露方式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。

资产管理计划份额持有人不得因本资产管理计划投资收益劣于资产管理计划管理人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向资产管理计划管理人或资产管理计划托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

除上述情形外，管理人不得将其管理的资产管理计划资产，直接或者通过投



资其他资产管理计划等间接形式，为本机构、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部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，并且事先取得投资者同意的资产管理计划除外。

## 2、发生利益冲突情形信息披露的方式

本集合计划发生利益冲突情形的信息披露将严格按照《指导意见》《管理办法》《运作规定》《集合资产管理合同》《说明书》及其他规定进行。

本集合计划包含利益冲突情形的定期报告和临时报告等有关集合计划的信息将在管理人网站上披露，委托人可随时查阅。

管理人网站：[www.sczq.com.cn](http://www.sczq.com.cn)

## （三）发生利益冲突情形信息披露的内容和时间

### 1、定期报告

定期报告包括集合计划份额净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、年度审计报告。

发生利益冲突情形需在本集合计划的资产管理季度（年度）报告进行信息披露。

### 2、临时报告

本集合计划运用受托管理资产从事重大关联交易的，应当于签订交易协议后 10 个工作日内（无交易协议的，自事项发生之日起 10 个工作日内），按照规定在管理人网站发布信息披露公告。

## （四）与投资顾问的利益冲突情形

本集合计划未聘请投资顾问，不存在与投资顾问之间存在利益冲突情形。”

## 十六、原合同“十五、投资经理的指定与变更”部分，

原：

### “1、投资经理的指定：

资产管理计划投资经理由管理人负责指定。

马超凡，首创证券资产管理事业部固定收益投资部总经理助理，投资经理，2014年毕业于中央财经大学，管理学学士；2016年毕业于中央财经大学，统计学硕士。偏向于通过数据分析调整投资组合来寻找固定收益投资机会。2016年

加入首创证券资产管理事业部任职固定收益交易员、投资经理助理，负责资管产品的资产配置、流动性管理；2019年担任资产管理事业部固定收益投资部投资经理。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。”

**变更为：**

“（一）投资经理的指定

本集合计划投资理由管理人负责指定。本集合计划投资经理为马超凡和任亚楠，简介如下：

马超凡，首创证券资产管理事业部固定收益投资部副总经理，投资经理，2014年毕业于中央财经大学，管理学学士；2016年毕业于中央财经大学，统计学硕士。偏向于通过数据分析调整投资组合来寻找固定收益投资机会。2016年加入首创证券资产管理事业部任职固定收益交易员、投资经理助理，负责资管产品的资产配置、流动性管理。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

任亚楠，首创证券资产管理事业部固定收益投资部投资经理，南开大学金融工程硕士。2019年加入首创证券资产管理事业部，历任资产管理部债券交易员、交易主管、投资经理助理，现任资产管理事业部固定收益投资部投资经理。在信用债方面具有投研优势，擅长资产配置，挖掘债券市场投资机会，具有丰富的券商资管产品管理和投资经验。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。”

**原：**

“2、投资经理的变更

委托人同意，管理人有权根据本资产管理计划投资运作需求及内部审批流程变更投资经理。投资经理发生以下情形时，管理人应及时变更：”

**变更为：**

“（二）投资经理的变更

委托人同意，管理人有权根据本集合计划投资运作需求及内部审批流程变更投资经理。投资经理发生以下情形时，管理人应及时变更：”

十七、原合同“十六、集合计划账户与资产”更名为“十六、资产管理计划的财产”，其中：

原：

“（一）集合计划账户的开立

管理人授权托管人办理托管资金账户的开立、销户、变更工作，托管资金账户无需预留印鉴，具体按托管人要求办理。管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。该资金账户同时也是资产托管人在法人集中清算模式下，代表资产托管人所托管的包括本项委托财产在内的所有托管资产与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。托管人为本集合计划开立证券账户、资金账户以及其他相关账户。资金账户名称应当包含“首创证券创赢4号集合资产管理计划”，证券账户名称应当是“首创证券—平安银行—首创证券创赢4号集合资产管理计划”。【备注：账户名称以实际开立为准】

因业务发展而需要开立的其他账户，可以根据法律法规和本合同的规定，经管理人与托管人进行协商后进行办理。新账户按有关规则使用并管理。

集合计划账户、专用交易单元应由集合计划管理人报证券交易所、证券登记结算机构以及证券公司住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会备案。

（二）集合计划资产的构成

本集合计划资产的构成主要有：

集合计划所拥有的债券、基金和银行存款本息、应收款项、根据有关规定缴纳的保证金、其它投资等资产及孳息。

（三）集合计划资产的管理与处分

集合计划资产由托管人托管，并独立于管理人及托管人的自有资产及其管理、托管的其他资产。管理人或托管人的债权人无权对集合计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除依照《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定处分外，集合计划资产不得被处分。”

变更为：

“（一）资产管理计划财产的保管与处分

1、本集合计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任，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。

2、本集合计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人和托管人不得将本集合计划财产归入其固有财产。因为管理人投资产生的存放或存管在托管人以外机构的委托财产，由相应的保管机构承担保管职责，管理人应审慎选择保管机构。

3、管理人、托管人因本集合计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入本集合计划财产。

4、管理人、托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对本集合计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，本集合计划财产不属于其清算财产。

5、本集合计划财产产生的债权不得与不属于本集合计划财产本身的债务相互抵销。非因本集合计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对本集合计划财产强制执行。上述债权人对本集合计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知本集合计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

## （二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

1、管理人或托管人按照规定开立集合计划财产的托管资金账户、证券账户等投资所需账户。证券账户、资金账户的名称应当符合基金业协会的有关规定。开立的上述集合计划财产账户与管理人、托管人、销售机构和份额登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。

2、管理人授权托管人办理托管资金账户的开立、销户、变更工作，托管资金账户无需预留印鉴，具体按托管人要求办理。管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付集合计划收益，均需通过本集合计划的托管资金账户进行。本托管资金账户仅限于本集合计划使用，仅限于满足开展本集合计划业务的需要。

3、证券账户以及本集合计划投资运作有关的其他账户由管理人与托管人协商后办理。管理人和托管人不得随意假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户。如本集合计划投资运作有关的其他账户是由管理人负责开立的，管理人应保证该账户专款专用，并聘请资金监管机构对该账户的资金划付进行监管。相应的投资回款及收益，也由管理人负责及时原路划回托管资金账户，已聘请资金监管机构的，管理人应配合资金监管机构完成投资回款的划付。管理人开立此类账户后需及时通知托管人。

托管人按照规定开立本集合计划财产的托管账户及其他投资所需账户，管理人应给予必要的配合。”

**十八、原合同“十七、集合计划资产托管”更名为“十七、投资指令的发送、确认和执行”，其中：**

**原：**

“集合计划资产由计划管理人委托平安银行股份有限公司北京分行托管，管理人已经与托管银行签订了托管协议。托管人将严格遵照有关法律法规及双方达成的托管协议对集合资产进行托管。托管人的托管职责以托管协议的约定为准，如管理合同、说明书与托管协议冲突，托管事务方面相关约定以托管协议为准。

委托人签署本合同的行为本身即表明对现行证券交易、登记结算制度下托管人托管职能有充分的了解，并接受本合同约定的托管职责和范围。”

**变更为：**

“（一）交易清算授权

1、管理人应当事先向托管人发出书面授权通知，向托管人提供指令的预留印鉴样本和签字样本，并在授权通知上载明管理人有权发送指令的人员名单及联系方式。管理人应指定至少两名以上的有权发送指令人员。

2、管理人向托管人发出的授权通知应加盖公章。托管人在收到授权通知后以约定方式确认。授权通知于载明的日期生效（如果授权通知载明的生效日期与托管人确认日期不一致时，以时间在后的日期为生效日期），管理人应及时将授权通知的正本送交托管人，管理人若已向托管人出具了统一授权通知的，以统一授权通知为准。

3、管理人和托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向有权发送指令人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

## （二）投资指令的内容

1、指令包括管理人在运作计划资产时，向托管人发出的划款指令（含纸质指令和电子指令），包括付款指令（含退出、收益分配付款指令）及其他资金划拨指令等。

2、管理人发给托管人的指令应写明款项事由、支付时间、收款人开户银行、金额、收款人账户名称、账号等要素信息，加盖预留印鉴并由被授权人签章。

## （三）投资指令的发送、确认和执行

### 1、指令的发送

（1）纸质指令需有授权通知确定的预留印鉴和签章，并由有权发送指令人员在指令上签章后，代表管理人用电子邮件或传真的方式向托管人发送，传真为备份方式。电子指令由管理人通过深证通电子指令直连系统或者托管网银系统向托管人发送。管理人以上述方式发送指令后需及时与托管人进行电话或其他双方一致认可的方式确认。因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时清算所造成的损失，由管理人承担责任。

（2）托管人应指定专人接收管理人的指令，并预先通知管理人接收人名单和联系方式。

### 2、指令的确认

（1）托管人在接收指令时，应对指令是否由有权发送指令人员发送、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相符进行一致性验证，如发现问题，应及时通知管理人。经确认的指令，管理人不得否认其效力，但如果管理人已经撤销或更改对有权签署、发送指令人员的授权，并且通知托管人，经托管人确认，则对于此后该类相关人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，管理人不承担责任。

（2）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指令的有效性。

（3）托管人收到划款指令后，应根据本合同约定，审核管理人的划款指令。托管人对划款指令以及管理人提交的与划款指令相关的所有材料进行一致性审

核。

托管人应对下列内容进行审核：

一是划款指令要素、印鉴和签名是否正确完整；

二是划款指令金额与指令附件投资协议等证明文件中约定的投资金额一致；

三是划款指令中的收款账户信息与指令附件投资协议等证明文件中约定的收款账户信息一致（若有）。若指令附件投资协议未约定收款账户信息的，划款指令中的收款户名应与本合同约定的投资方向一致。

（4）管理人向托管人出具投资指令时，须提供相关投资证明材料。上述材料应加盖管理人印章。

管理人应保证以上所提供的划款指令及作为划款依据的文件资料的真实、有效、完整、准确、合法，没有任何重大遗漏或误导；托管人对划款指令及文件资料的真实性和有效性不作实质性判断。

### 3、指令的执行

（1）托管人确认指令有效后，方可执行指令。

（2）托管人在复核后应在规定期限内执行适当的指令，不得延误。指令执行完毕后，托管人应通知管理人。托管人发现管理人的指令违反法律法规规定或者集合资产管理合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并向证券公司住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

（3）相关登记结算机构向托管人发送的结算通知视为管理人向托管人发出的有效指令，托管人应予以执行。

（4）针对纸质指令，在指令未执行的前提下，若管理人撤销该指令，管理人应在该指令原件上注明“作废”、“废”、“取消”等字样并加盖预留印鉴及被授权人签章后用电子邮件或传真的方式发送给托管人，并电话通知资产托管人；针对电子指令，在指令未执行的前提下，若管理人撤销该指令，管理人应在电子系统上进行撤销操作，并电话通知资产托管人。

### 4、执行中相关问题的处理方法

（1）管理人下达的指令必须要素齐全，词语准确，管理人下达的指令要素不全或语意模糊的，托管人有权附注相应的说明后立即将指令退还给管理人，要求其重新下达有效的指令。

(2) 托管人因故意或重大过失错误执行指令或未及时执行指令，致使本计划资产的利益受到损害，应负赔偿责任。除此之外，托管人对执行管理人的合法指令对计划造成的损失不承担赔偿责任。

(3) 管理人在发送指令时，应为托管人执行指令留出执行指令时所必需的时间，至少为 2 个工作小时。管理人发送有效指令（包括原指令被撤销、变更后再次发送的新指令）的截止时间为：交易所等场内投资发送指令的截止时间为当天的 15:30；场外、银行间市场及限时发送指令的截止时间为当天的 16:00。对于管理人于上述规定时间以后发送至托管人的指令，托管人应尽力配合，但如未能出款时托管人不承担责任。如管理人要求当天某一时点到账，则交易结算指令及其证明材料最迟需提前 2 个工作小时发送并与托管人进行电话确认。指令传输不及时，未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行，所造成的损失由管理人承担。

通过上交所固定收益证券综合电子平台达成的私募债券转让，中国证券登记结算公司上海分公司根据证券交易所发送的转让成交结果办理实时逐笔全额结算（RTGS）。RTGS 的最终交收时点为 T 日的 15:50 分，为保证 RTGS 交易成功，管理人应于交易 T 日的 15:00 之前，将买入私募债券的指令传至托管人。

通过深圳综合协议平台的公司债、私募债，结算方式为逐笔全额非担保交收，最终交收时点为 T 日 16:00，因此管理人应于 T 日 15:30 之前向托管人发送非担保交收债券的买入指令。指令及其证明材料传输不及时，未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行，所造成的损失由管理人承担。

(4) 对非金融衍生品，管理人应确保计划的银行存款账户有足够的资金余额，确保计划的证券账户有足够的证券余额；对金融衍生品，通过操作备忘录的形式另行协商。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指令，托管人可不予执行，由此造成的损失，由管理人负责赔偿。

#### (四) 更换投资指令被授权人的程序

1、管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于有权发送指令人员的名单、联系方式的修改，指令上预留印鉴和签章样本的修改等），应当至少提前 1 个工作日通知托管人；修改授权通知的文件应为变更后的完整授权，且由管理人加盖公章。管理人对变更后的完整授权应当以电子邮件的形式发送给托管人，



同时电话通知托管人。托管人收到变更后的完整授权通知后向管理人修改授权通知后的有权发送指令人员电话确认。管理人对授权通知的内容的修改自载明的日期起生效，若载明的生效日期早于托管人确认日期的，自托管人确认日期起生效，管理人应在此后三个工作日内将对授权通知修改的文件原件送交托管人。新的授权通知生效之后，原件送达之前，托管人按照新的授权通知传真件内容执行有关业务，如果新的授权通知原件与传真件内容不同，以托管人收到的传真件为准。

2、托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式，应至少提前1个工作日以电话或其他双方一致认可的方式发送管理人。托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式自管理人电话确认后生效。

#### （五）投资指令的保管

投资指令由管理人保存20年以上。”

### 十九、原合同“十八、越权交易的界定”部分，

原：

#### “（一）越权交易的界定

本合同约定的越权交易是指集合计划管理人违反本合同的约定而进行的投资交易行为，包括：（1）违反本合同约定的投资范围和投资比例限制等进行的投资交易行为；（2）法律法规禁止的超买、超卖行为。

集合计划管理人应在本合同规定的投资范围和投资限制权限内运用集合计划财产进行投资管理，不得违反本合同关于投资范围和投资限制的约定，超越权限从事投资。

#### （二）对越权交易的处理程序

##### 1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为

集合计划托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反托管协议附件《交易监控合规表》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证券投资基金业协会。

集合计划托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反托管协议附件《交易监控合规表》约定的，应立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证券投资基金业协会。

集合计划管理人应向托管人主动报告越权交易。托管人有权督促管理人在限

期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。集合计划管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证券投资基金业协会。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

集合计划托管人在行使监督职能时，如果发现集合计划资产投资过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人。如果因管理人原因发生交易所场内超买行为，必须于发生超买行为日的下一个工作日上午 10:00 点之前完成融资，保证完成清算交收。

3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本集合计划资产所有。

### （三）集合计划托管人对管理人越权交易的监督

1、集合计划托管人对管理人的越权交易行使监督权，具体投资监督事项见托管协议附件《交易监控合规表》。

集合计划托管人对集合计划管理人进行本集合计划越权交易的监督和检查自本计划建账估值之日起开始。

2、投资范围或投资限制变更，集合计划管理人应以书面形式通知集合计划托管人，并应与集合计划托管人重新协商调整投资监督事项。

### （四）越权交易的例外

以下不属于越权交易情形：

- 1、非因管理人主观原因导致本集合计划投资比例不符合本合同约定；
- 2、本集合计划终止前 10 个交易日内，管理人对所投资的资产进行变现造成投资比例不符合本合同约定。”

### 变更为：

#### “（一）越权交易的界定

本合同约定的越权交易是指管理人违反本合同的约定而进行的投资交易行为，包括：

- （1）违反本合同约定的投资范围和投资比例限制等进行的投资交易行为；
- （2）法律法规禁止的超买、超卖行为。

管理人应在本合同规定的投资范围和投资限制权限内运用集合计划财产进

行投资管理，不得违反本合同关于投资范围和投资限制的约定，超越权限从事投资。

## （二）越权交易的处理程序

### 1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为

托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反本合同约定的投资范围和投资比例限制的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会派出机构。

托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的投资范围和投资比例限制的，应立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会派出机构。

管理人应在接到托管人通知后向托管人主动披露越权交易。托管人有权督促管理人在限期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会派出机构。

### 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

管理人在委托财产投资过程中出现超买或超卖现象，由管理人负责解决，由此给委托财产及托管人托管的其他财产造成的损失及相关交易费用由管理人承担，托管人不承担任何责任。如果因管理人原因发生交易所场内超买行为，必须于发生超买行为日的下一个工作日上午 10:00 点之前完成融资，保证完成清算交收。

3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本集合计划资产所有。

## （三）托管人对管理人投资运作的监督

### 1、集合计划托管人对管理人的越权交易行使监督权。

托管人对管理人进行本集合计划越权交易的监督和检查自本集合计划建账估值之日起开始。

2、投资范围或投资限制变更，管理人应以书面形式通知集合计划托管人，并应与托管人重新协商调整投资监督事项。

### 3、托管人越权交易监督的真实性、准确性、及时性和完整性受限于管理人、

证券经纪商、期货经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。

4、对于管理人的任何投资行为、投资策略、投资决定或由于本集合计划产品设计缺陷或越权交易造成的任何损失，由过错方承担责任。

（四）越权交易的例外

以下不属于越权交易情形：

非因管理人主观原因导致本集合计划投资比例不符合本合同约定。”

**二十、原合同“十九、资产管理计划的估值和会计核算”部分，**

**原：**

“管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序，并定期对其执行效果进行评估，保证集合资产管理计划估值的公平、合理。

（一）资产总值

集合计划资产总值是指其所购买的各类证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产的价值总和。

（二）资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的余额。

（三）单位净值

集合计划单位净值是指集合计划资产净值除以当日集合计划份额总数计算得到的每集合计划份额的价值。

（四）估值目的

客观、准确地反映集合计划资产的价值。经集合计划资产估值后确定的集合计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出集合计划的基础。

（五）估值对象

集合计划所拥有的债券、基金和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

（六）估值日

估值日指本集合计划成立后的每个工作日，即上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

（七）估值方法

1、证券投资基金估值方法

持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的每万份收益

计算。

持有的债券型公募基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的单位净值计算。

在任何情况下，资产管理人如采用本项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

2、银行存款以成本列示，每日按照约定利率预提收益。

3、回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计算利息；

4、债券估值方法

①在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的相应品种对应的估值净价估值；

②在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；

③首次发行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，采用估值技术确定公允价值；

④交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用第三方估值机构（中证指数有限公司）确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债，采用第三方估值机构（中证指数有限公司）确定公允价值；

⑤在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构（中债金融估值中心有限公司）公布的收益率曲线及估值价格；

⑥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。

5、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

6、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，

按国家最新规定估值。

根据有关法律法规，资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布，托管人对由此造成的损失不承担责任。

（八）估值程序：

管理人应每个工作日对集合计划资产估值，但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。用于披露的资产净值等数据由管理人完成估值后，将估值结果以书面或邮件形式报送托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核，复核无误后以书面或邮件形式返回给管理人，如有出入，原则上以管理人提供的数值为准。

由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

（九）估值错误与遗漏的处理方式：

因发生估值差错导致本计划资产或本计划持有人损失的，由本计划管理人负责赔偿，本计划管理人在赔偿本计划资产或本计划持有人后，对不应由其承担的责任，有权根据过错责任原则，向存在过错的一方追偿。

（十）估值调整的情形与处理

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

（十一）暂停估值的情形：当出现下列情形致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。

1、集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使集合计划管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，管

理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### （十二）资产管理计划份额净值的确认：

用于集合计划信息披露的集合计划资产净值和集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个交易日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。

#### （十三）特殊情况的处理

（1）管理人或托管人按估值方法的第 1-6 项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。

（2）由于不可抗力原因，或由于证券交易所、证券经纪机构及登记结算公司发送的数据错误等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### （十四）集合计划的会计政策

1、集合计划管理人为本计划的会计责任方；

2、集合计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；集合计划首次募集的会计年度按如下原则：如果《资管合同》生效少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；

3、集合计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计核算制度执行国家有关会计制度；

5、本集合计划独立建账、独立核算；

6、集合计划管理人或其委托的服务机构保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表；集合计划托管人定期与集合计划管理人就集合计划的会计核算、报表编制等进行核对。”

#### **变更为：**

“（一）集合计划的估值

管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序，并定期对其执行效果进行评估，保证本集合计划估值的公平、合理。

#### 1、资产总值

集合计划资产总值是指其所购买的各类证券、银行存款本息、集合计划各项应收款以及其他资产的价值总和。

#### 2、资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的余额。

#### 3、单位净值

集合计划单位净值是指集合计划资产净值除以当日集合计划份额总数计算得到的每集合计划份额的价值。

#### 4、估值目的

客观、准确地反映集合计划资产的价值。经集合计划资产估值后确定的集合计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出集合计划的基础。

#### 5、估值对象

本集合计划所拥有的债券、基金和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

#### 6、估值日

估值日指本集合计划成立后的每个交易日，即上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

#### 7、估值方法

##### (1) 证券投资基金估值方法

持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的每万份收益计算。

持有的场内债券型公募基金，按交易所的收盘价估值；持有的场外债券型公募基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的单位净值计算。

在任何情况下，资产管理人如采用本项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。



(2) 银行存款以成本列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如利率发生变化，托管人须及时提供更改后的协议或合同，管理人及时进行账务调整；

(3) 回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计算利息；

(4) 债券估值方法

①对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价；

②对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价；

③首次发行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，采用估值技术确定公允价值；

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。

(5) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，管理人可与托管人协商后确定估值方法。

(6) 管理人如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

(7) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

根据有关法律法规，资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布。

## 8、估值程序

管理人应每个工作日对集合计划资产估值，但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。

用于披露的资产净值等数据由管理人完成估值后，将估值结果以书面或邮件形式报送托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核，复核无误签章后于收到估值结果当日返回给管理人，如有出入，原则上以管理人提供的数值为准。

资产净值的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责的，由管理人承担相应的责任。

#### 9、估值错误与遗漏的处理方式

本集合计划单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误。

因发生估值差错导致本集合计划资产或本集合计划持有人损失的，由本集合计划管理人负责赔偿，本集合计划管理人在赔偿本集合计划资产或本集合计划持有人后，对不应由其承担的责任，有权根据过错责任原则，向存在过错的一方追偿。

#### 10、估值调整的情形与处理

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 11、暂停估值的情形

当出现下列情形致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。

(1) 集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

(2) 因不可抗力或其他情形致使集合计划管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，管

理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

#### 12、资产管理计划份额净值的确认

用于集合计划信息披露的集合计划资产净值和集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个交易日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。由此给资产委托人或资产管理计划造成损失的由资产管理人承担责任。

#### 13、特殊情况的处理

(1) 管理人或托管人按估值方法的第 1-7 项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。

(2) 由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所、证券经纪机构、期货公司及登记结算公司发送的数据错误等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

#### (二) 集合计划的会计政策

1、集合计划管理人为本集合计划的会计责任方；

2、集合计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；集合计划首次募集的会计年度按如下原则：如果《资管合同》生效少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；

3、集合计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计核算制度执行国家有关会计制度；

5、本集合计划独立建账、独立核算；

6、集合计划管理人或其委托的服务机构保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表；集合计划托管人定期与集合计划管理人就集合计划的会计核算、报表编制等进行核对。”

二十一、原合同“二十、集合计划的费用、业绩报酬”更名为“二十、资产管理计划的费用与税收”，其中：

原：

“（一）费用种类

- 1、管理人的管理费和业绩报酬
- 2、托管人的托管费
- 3、证券交易费用
- 4、证券账户开户费
- 5、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用
- 6、本集合计划成立后的会计师费和律师费
- 7、按照国家有关规定可以列入的其他费用

（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

1、托管人托管费计提和支付：

本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的 0.05% 年费率计提，计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div 365$$

H 为每日应支付的托管费；

E 为前一日集合计划资产净值。

集合计划托管费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令将上一季度计提的托管费从集合计划资产中一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

托管费收入账户：

户 名：待处理托管手续费

账 号：99262005300010

开户银行：平安银行北京分行清算中心

2、管理人管理费计提和支付：

本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为 0.7%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

管理人的管理费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次，经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

### 3、业绩报酬的计提和支付：

#### (1) 管理人核算业绩报酬的原则：

在本集合计划存续过程中，业绩报酬计提日可以为本集合计划收益分配日（以管理人的分红公告为准）、投资者退出时、计划开放日、临时开放日或本集合计划终止日。以上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日）至本次业绩报酬计提日的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准，按照业绩报酬计提基准以上部分的 60%提取业绩报酬，具体提取方式如下：

$$R = \frac{A - B}{C} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

其中，A 为业绩报酬计提日的累计单位净值；

B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；

C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为上一业绩报酬计提日与本次业绩报酬计提日间隔天数。若管理人于某个业绩报酬计提日未实际计提业绩报酬（即业绩报酬为 0），则该日仍然作为管理人下一次业绩报酬计提起始日。

| 年化收益率 (R)    | 计提比例 | 业绩报酬计提方法                                   |
|--------------|------|--------------------------------------------|
| R ≥ 业绩报酬计提基准 | 60%  | H = 【R - 业绩报酬计提基准】 × 60% × C × F × D / 365 |
| R < 业绩报酬计提基准 | 0    | H = 0                                      |

注：F 为提取业绩报酬的份额

由于涉及注册登记数据，由管理人计算，托管人不承担复核责任。

管理人收取业绩报酬按委托人参与份额计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

管理人业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，但因投资者退出集合计划提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

#### (2) 业绩报酬的支付

每个自然季度起10个工作日内或产品终止时，管理人有权全额提取当期计提的业绩报酬，具体以管理人安排和计算为准。支付时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人发送的指令于3个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时，支付日期顺延。

业绩报酬的计算和复核由管理人完成。托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。

#### 4、证券交易费用：

本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，作为交易成本直接扣除。

#### 5、审计费用：

本集合计划的年度审计费用，按管理人与会计师事务所确定的金额，审计费用按年度一次性计提。

#### 6、注册登记费：

本集合计划成立后的注册登记费用由计划承担，收费标准按照中国证券登记结算有限责任公司公布费率执行，管理人在收到缴费通知单后按照份额登记机构要求进行费用支付。

#### 7、其他费用：

本集合计划成立后的信息披露费用、会计师费、律师费和银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。

#### (三) 不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。

#### （四）税收

根据财政部、国家税务总局发布的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）以及《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90号）等文件的相关规定：自2018年1月1日起，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。”

#### 变更为：

##### “（一）费用种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、管理人业绩报酬；
- 4、证券交易费用；
- 5、证券账户开户费；
- 6、本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用；
- 7、本集合计划成立后的会计师费和律师费；
- 8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

如本集合计划涉及上述费率调整，管理人将以合同变更的方式征询委托人及托管人的意见。

##### （二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

##### 1、管理人管理费计提和支付

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费率为0.70%/年。计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% \div 365$$

H为每日应计提的管理费；

E为前一自然日集合计划资产净值。

管理费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次，经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起10个

工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

管理费收入账户：

户 名：首创证券股份有限公司

账 号：11001018500056001700

开户银行：建设银行北京安慧支行

大额支付号：105100004034

## 2、托管人托管费计提和支付

本集合计划的托管费按前一自然日集合计划的资产净值计提，托管费率为0.05%/年，计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div 365$$

H为每日应支付的托管费；

E为前一自然日集合计划资产净值。

托管费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起10个工作日内依据管理人的划款指令将上一季度计提的托管费从集合计划资产中一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

托管费收入账户：

户 名：待处理托管手续费

账 号：99262005300010

开户银行：平安银行北京分行清算中心

## 3、业绩报酬的计提和支付

### (1) 管理人收取业绩报酬的原则

①本集合计划对投资者持有的集合计划份额进行业绩报酬计提；

②同一投资者不同时间多次参与集合计划，本集合计划对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；

③在符合业绩报酬计提条件时，在集合计划分红日、投资者退出日和集合计划终止日计提业绩报酬；管理人从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次；



④在集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除，在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

⑤集合计划分红时，业绩报酬按投资者集合计划分红时持有的份额进行核算。

⑥投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或集合计划终止时持有份额进行核算。

⑦管理人有权于集合计划份额发行前公告业绩报酬计提基准等规则。

⑧业绩报酬提取原则：

1) 当集合计划份额年化收益率  $R \leq$  业绩报酬计提基准  $r$  时，则管理人不提取业绩报酬；

2) 当集合计划份额年化收益率  $R >$  业绩报酬计提基准  $r$  时，管理人对年化收益率超过业绩报酬计提基准的收益部分收取 60% 作为业绩报酬；

$$F = \max \{ (R - r) \times 60\% \times C \times (N / 365), 0 \}$$

其中：

$$R = [ (PA - PC) / PC* ] \times (365 / N) \times 100\%$$

F：投资者每笔认购/存续期参与集合计划份额应提取的业绩报酬；

R：该笔认购/存续期参与份额的年化收益率；

r：业绩报酬计提基准

PA：本次发生业绩报酬计提日单位累计净值；

PC：上一个发生业绩报酬计提日的单位累计净值；

PC\*：上一个发生业绩报酬计提日的单位净值；

C：投资者每笔认购/存续期参与的集合计划份额在上一个发生业绩报酬计提日的资产净值总额；

N：上一个发生业绩报酬计提日到本次发生业绩报酬计提日的天数。

业绩报酬计提日为本集合计划分红确认日、退出确认日和计划终止确认日。业绩报酬的计提，以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准。上一个业绩报酬计提基准日，如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提，认购所得的份额，以本集合计划成立日份额面值为准；追加所得的份额，以追加申请对应日份额净值为准；委托人退出时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔认购/追加应收的管理人业绩报酬。

## （2）业绩报酬的支付

每个自然季度起 10 个工作日内或产品终止时，管理人有权全额提取当期计提的业绩报酬（如有），具体以管理人安排和计算为准。支付时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时，支付日期顺延。

业绩报酬的计算和复核由管理人完成。托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。

管理人有权修改业绩报酬计提基准，管理人应于新的业绩报酬计提基准启用前至少三个工作日在管理人指定网站公告。新的业绩报酬计提基准生效后，所有投资者退出时均按照退出时点对应的业绩报酬计提基准，计算整个持有期的业绩报酬，不同意业绩报酬计提基准变更的投资者可在基准变更生效前的（临时）开放日按原业绩报酬计提基准申请退出。业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的计算使用，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。

### 4、证券交易费用

本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，作为交易成本直接扣除。

### 5、审计费用

本集合计划的年度审计费用，按管理人与会计师事务所确定的金额，审计费用按年度一次性计提。

### 6、注册登记费

本集合计划成立后的注册登记费用由计划承担，收费标准按照中国证券登记结算有限责任公司公布费率执行，管理人在收到缴费通知单后，按照份额登记机构要求进行费用支付。

### 7、其他费用

本集合计划成立后的信息披露费用、会计师费、律师费和银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际

支出金额支付，列入当期集合计划费用。

### （三）不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与本集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。

### （四）税收

根据财政部、国家税务总局发布的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）以及《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90号）等文件的相关规定：自2018年1月1日起，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。前述税费由本集合计划委托财产承担，管理人将按相关法规和税务机关的规定计算和缴纳。委托人知悉因本集合计划所适用的税收征管法律法规及执行要求可能会因国家相关税收政策变化或管理人主管税务机关指导意见调整而发生改变。”

**二十二、原合同“二十一、集合计划的收益分配”更名为“二十一、资产管理计划的收益分配”，其中：**

**原：**

#### “（一）收益的构成

收益包括：集合计划投资所得债券利息、红利、股息、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。

（二）可供分配利润：指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

#### （三）收益分配原则

（1）每一集合计划份额享有同等的收益分配权，若收益分配基准日可供分配利润大于0，管理人可以视情况选择进行收益分配；

(2) 在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，由管理人拟定分红方案进行收益分配，分配比例不超过收益分配基准日全部可分配利润的 100%；

(3) 集合计划收益分配日的每份额净值减去每份额分红金额后不能低于集合计划份额面值；

(4) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(四) 收益分配方案的确定与披露

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，由管理人报告委托人。管理人应在指定网站提前公告收益分配方案。

(五) 收益分配方式

本集合计划的分红方式为现金分红，管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令将收益分配划入注册登记机构，注册登记机构将收益分配款划入相应推广机构结算备付金账户，由推广机构划入委托人的交易账户，现金红利扣除管理人业绩报酬后在 T+7 日内划转到委托人的交易账户。”

**变更为：**

“（一）收益的构成

收益包括本集合计划投资所得债券利息、红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。本集合计划的净收益为本集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。

（二）可供分配利润

截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（三）收益分配原则

1、每一集合计划份额享有同等的收益分配权，若收益分配基准日可供分配利润大于 0，管理人可以视情况选择进行收益分配，收益分配的具体方案以管理人公告为准；

2、在符合有关本集合计划收益分配条件的前提下，由管理人拟定分红方案进行收益分配，分配比例不超过分配基准日全部可分配收益的 100%；

3、本集合计划收益分配日的每份额净值减去每份额分红金额后不能低于集

合计划份额面值；

4、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案的确定与通知

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，由管理人告知委托人。管理人应在指定网站提前公告收益分配方案。

#### （五）收益分配的执行方式

本集合计划分红方式为现金分红。委托人同意遵守登记结算机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制定的规则）。

现金分红形成的收益分配金额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额计入本集合计划资产的损益。”

### 二十三、原合同“二十二、信息披露与报告”部分，

原：

“本集合计划的信息披露应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》及相关自律规则的规定。如中国证监会、中国基金业协会更新了相关信息披露规则或制定了其他相关规则，则从其规则执行。

#### （一）定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告和年度审计报告。

##### 1、集合计划单位净值披露

披露时间：至少每周披露一次经托管人复核的集合计划的单位净值，并于初始募集期或开放期前公告下一个封闭期的业绩报酬计提基准。

披露方式：披露文件等信息将在管理人指定网站上披露，委托人可随时查阅。

##### 2、集合计划的资产管理季度报告

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的季度报告，报告包括但不限于以下内容：

（1）管理人履职报告；

（2）托管人履职报告；

（3）资产管理计划投资表现；

- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 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；
- (7) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (8) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (9) 中国证监会及自律组织规定的其他事项。

资产管理季度报告由管理人、托管人编制，由管理人公告，每季度结束之日起一个月内通过管理人网站披露季度报告，并报送管理人住所地中国证监会派出机构，并向中国证券投资基金业协会备案（如需）。本集合计划成立不足三个月时，可以不编制当期的季度报告。

### 3、集合计划的资产管理年度报告

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，年度报告包括但不限于以下内容：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告（如适用）；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 资产管理计划财务会计报告；
- (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；
- (8) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (10) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理年度报告由管理人、托管人编制，报送管理人住所地中国证监会派出机构，并向中国证券投资基金业协会备案（如需）。托管人每年度向管理人提供一次年度托管报告，由管理人向委托人公告。年度报告在每年度结束后四个月内通过管理人网站披露。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编

制披露当期的年度报告。

#### 4、年度审计报告

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所进行年度审计，并在每年度结束之日起4个月内将审计报告按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。本资产管理计划成立不足3个月时，管理人可不进行年度审计。

#### 5、临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人指定网站、销售机构网站、或其他途径和方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

- (1) 集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的投资经理发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；
- (2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；
- (3) 发生巨额退出并延期支付；
- (4) 集合计划终止和清算；
- (5) 集合计划存续期满并展期；
- (6) 管理人以自有资金参与和退出；
- (7) 合同的补充、修改与变更；
- (8) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- (9) 负责本集合计划的销售机构发生变更；
- (10) 集合计划资产投资于管理人、托管人及前述机构控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；
- (11) 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；
- (12) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- (13) 集合计划分红；
- (14) 资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；
- (15) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；
- (16) 其他发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的

事件。

(二) 其他事项

如发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时,在事项发生之日起五日内向投资者披露。

管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划,应向投资者充分披露。”

**变更为:**

“(一) 定期报告

定期报告包括本集合计划单位净值、本集合计划的资产管理季度(年度)报告和托管人履职报告、年度审计报告。

1、资产管理计划单位净值披露

披露时间: 每交易日披露经托管人复核的上一交易日集合计划的单位净值。

披露方式: 管理人及销售机构指定网站。

2、资产管理计划季度报告

管理人在每季度向委托人提供一次准确、完整的季度报告,报告包括但不限于以下内容:

(1) 管理人履职报告;

(2) 托管人履职报告;

(3) 资产管理计划投资表现;

(4) 资产管理计划投资组合报告;

(5) 资产管理计划运用杠杆情况(如有);

(6) 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;

(7) 资产管理计划投资收益分配情况;

(8) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项;

(9) 中国证监会及自律组织规定的其他事项。

资产管理计划季度报告由管理人编制,经托管人复核后由管理人公告,上述报告应于每季度截止日后 30 日内通过管理人指定网站通告,并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。



本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的季度报告。

### 3、资产管理计划年度报告

管理人在每年度向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，年度报告包括但不限于以下内容：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告（如适用）；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 资产管理计划财务会计报告；
- (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；
- (8) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (10) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划年度报告由管理人编制，托管人复核，由管理人公告，每年度结束之日起四个月内通过管理人网站披露年度报告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的年度报告。

### 4、托管人履职报告

托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作，确定托管人履职报告内容并用印后向管理人反馈，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。

管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 10 日内向管理人反馈复核意见。管理人应当在每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。

因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

#### 5、年度审计报告

管理人进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务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集合计划出具单项审计意见。管理人在每年度结束之日起4个月内将审计报告通过管理人指定网站向委托人提供。本集合计划成立不足3个月时，管理人可不提供审计报告。

管理人应当将审计结果按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。

#### （二）临时报告

本集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人指定网站、销售机构网站、或其他途径和方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

1、本集合计划运作过程中，投资经理发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

2、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

3、发生巨额退出并延期支付；

4、本集合计划终止和清算；

5、本集合计划存续期满并展期；

6、管理人以自有资金参与和退出；

7、本合同的补充、修改与变更；

8、与本集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

9、负责本集合计划的销售机构发生变更；

10、本集合计划投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券或关联方在承销期内承销的证券；

11、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；

12、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

13、本集合计划分红；

14、资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位

以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误)；

15、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；

16、其他发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件。

### (三) 其他信息披露事项

如发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起五个工作日内向投资者披露。

管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划，应向投资者充分披露。”

## 二十四、删去原合同“二十三、集合计划的展期”章节内容，

### 删去：

#### “1、展期的条件

(1) 在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反《集合资产管理合同》、《说明书》的约定；

(2) 展期没有损害委托人利益的情形；

(3) 托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；

(4) 展期后符合本集合计划的成立条件；

(5) 中国证监会规定的其他条件。

#### 2、展期的安排

##### (1) 通知展期的时间

在集合计划到期前 7 个月。

##### (2) 通知展期的方式

管理人拟定展期方案，经托管人确定后，管理人将通过管理人网站、邮件或者短信等方式通知委托人。

##### (3) 委托人回复的方式

委托人应当在 5 个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确意见。

#### 3、委托人不同意展期的处理办法

若委托人明确表示不同意展期，委托人有权在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续。若不同意展期的委托人未在存续期届满日前（含届满

日)到销售机构办理退出手续,管理人将对此类委托人进行强制退出。委托人回复意见不明确或不回复意见的,视为同意展期,管理人不再另行通知确认。

#### 4、展期的实现

如果同意集合计划展期的委托人户数不少于2户,则集合计划存续期将依法展期;如果同意本集合计划展期的各委托人户数低于2户则集合计划到期终止,将按照《集合资产管理计划管理合同》等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。”

**二十五、原合同“二十四、集合计划终止和清算”更名为“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”,同时删去原合同“二十八、合同的补充、修改与变更”章节内容,其中:**

**原:**

“(一)有下列情形之一的,集合计划应当终止:

1、管理人因重大违法、违规行为,被中国证监会取消业务资格,而无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的;

2、托管人因重大违法、违规行为,被监管机关取消业务许可,不能继续担任集合计划托管人,而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的;

3、管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责,而无其他适当的管理人承接其原有权利、义务的;

4、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责,而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的;

5、在不违反法律法规规定不损害委托人权益的前提下,经管理人认为有必要终止集合计划的,在与托管人协商一致后,可提前终止集合计划;

6、集合计划存续期间,持续5个工作日投资者少于2人;

7、资产管理计划存续期届满且不展期;

8、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形;

9、不可抗力的发生导致本集合计划不能存续;

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。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内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(如需),前述第8项约定的情形除外。

## （二）集合计划的清算

1、自集合计划终止之日起5个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；

2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；

3、集合计划清算程序

（1）集合资产管理计划终止日后5个工作日内启动清算程序，并由集合计划清算小组将终止事项向委托人披露；

（2）集合计划清算小组统一接管集合计划资产；

（3）集合计划清算小组对集合计划资产进行清理和确认；

（4）集合计划清算小组对集合计划资产进行估价；

（5）集合计划清算小组对集合计划资产进行变现；

（6）集合计划清算小组出具集合计划清算报告

（7）集合计划清算小组披露集合计划清算报告；

（8）清算报告披露后5个工作日内进行集合计划剩余资产的分配；

（9）集合计划清算小组注销集合计划相关账户。

4、清算结束后15个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户；

5、清算结束后15个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果；

6、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，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，以货币形式全部分配给委托人。”

### **变更为：**

#### “（一）合同的变更

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结

算机构业务规则以及证券交易所、基金业协会、证券业协会等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人指定网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人指定网站公告时生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。临时开放期内，本集合计划不接受任何参与申请。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后按照约定的开放日或临时开放日提出退出本资产管理计划的申请；委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：委托人不同意变更的，管理人保障其退出资产管理计划的权利；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本资产管理计划的委托人，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理。合同变更生效日以管理人公告为准。临时开放期内，本资产管理计划不接受任何参与申请。

委托人同意，无论其是否同意合同变更或提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

其中，由于其他原因需要变更合同的情形，包括但不限于以下情形：

(1) 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接。

(2) 托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他托管人承接。

3、本合同变更后，委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。管理人应按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。

4、委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。

管理人特别提示，合同变更可能涉及委托人的各项权益调整（包括但不限于

权利义务的重大变动，管理费、托管费、业绩报酬的提高或降低等），委托人应实时关注管理人网站（www.sczq.com.cn）公告；委托人同意，管理人通过网站公告的方式视为已合理征询委托人的意见，无论其是否同意合同变更或提出退出申请，管理人在与托管人达成一致意见并通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见后，按照上述程序变更本合同属于委托人认可的行为。

## （二）资产管理计划的展期

### 1、展期的条件

（1）在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反《集合资产管理合同》《说明书》的约定；

（2）展期没有损害委托人利益的情形；

（3）托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；

（4）满足本集合计划成立条件；

（5）中国证监会规定的其他条件。

### 2、展期的安排

（1）通知展期的时间

在本集合计划到期前 7 个月。

（2）通知展期的方式

管理人拟定展期方案，经托管人确定后，管理人将通过管理人网站、邮件或者短信等方式通知委托人。

（3）委托人回复的方式

委托人应当在展期方案发出后的 5 个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确意见。

### 3、委托人不同意展期的处理办法

若委托人明确表示不同意展期，委托人有权在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续。若不同意展期的委托人未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续，管理人将对此类委托人进行强制退出。委托人回复意见不明确或不回复意见的，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。

### 4、展期的实现

如果同意本集合计划展期的委托人户数不少于 2 户，则存续期将依法展期；

如果同意本集合计划展期的各委托人户数低于 2 户则集合计划到期终止,将按照本合同及相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。展期后,应符合本集合计划的成立条件。

(三) 有下列情形之一的,集合计划应当终止

- 1、本集合计划存续期届满且不展期;
- 2、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的;
- 3、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,且在六个月内没有新的管理人承接;
- 4、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,且在六个月内没有新的托管人承接;
- 5、管理人认为必要时可终止本集合计划;
- 6、本集合计划存续期间,持续五个工作日投资者少于二人;
- 7、不可抗力的发生导致本集合计划不能存续;
- 8、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形;
- 9、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内应按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送,前述第 8 项约定的情形除外。

(四) 托管人发现管理人有下列情形的,托管人有权提出终止托管服务

- 1、被依法取消从事资产管理业务的相关资质或经营异常;
- 2、被依法解散、被依法撤销、被依法宣告破产或失联。
- 3、法律法规明确规定和合同约定的其他情形。

托管人要求终止托管服务的,应与本合同当事人签署终止协议,将托管资金移交至继任托管人并向中国证券投资基金业协会报告。

(五) 资产管理计划的清算

自集合计划终止之日起 5 个工作日内开始组织清算资产管理计划资产,以及财产清算的有关事项:

- 1、成立资产管理计划清算小组

(1) 本集合计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成。清算小组可以



聘用必要的工作人员。

(2) 本集合计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。管理人负责资产管理计划财产的清算、估价、变现和分配，托管人负责资产管理计划财产的保管，执行管理人分配指令划付资金。

清算过程中的有关重大事项应当及时公布。

## 2、资产管理计划清算程序

(1) 资产管理计划终止日后 5 个工作日内启动清算程序，并由集合计划清算小组将终止事项向委托人披露；

- (2) 集合计划清算小组统一接管集合计划资产；
- (3) 集合计划清算小组对集合计划资产进行清理和确认；
- (4) 集合计划清算小组对集合计划资产进行估价；
- (5) 集合计划清算小组对集合计划资产进行变现；
- (6) 集合计划清算小组出具集合计划清算报告；
- (7) 集合计划清算小组披露集合计划清算报告；
- (8) 清算报告披露后 5 个工作日内进行集合计划剩余资产的分配；
- (9) 集合计划清算小组注销集合计划相关账户。

## 3、资产管理计划清算费用

集合计划清算小组在进行清算过程中发生的所有合理费用（如：清算审计费用等），清算费用由集合计划清算小组优先从集合计划财产中支付。

## 4、资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

依据本集合计划财产清算的分配方案，将清算后的全部剩余资产扣除清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按本集合计划份额持有人持有的份额比例进行分配。

## 5、资产管理计划延期清算处理方式

资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送；

## 6、资产管理计划财产清算报告的告知安排

清算过程中的有关重大事项须及时公告；资产管理计划财产清算报告经会计师事务所审计并报中国证券投资基金业协会备案并公告。资产管理计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证券投资基金业协会备案后 5 个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告。

#### 7、资产管理计划财产相关账户的注销

资产管理计划财产清算完毕后，托管人及管理人应按照交易所、银行的有关规定注销托管资金专门账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。

#### 8、资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

9、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，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，以货币形式全部分配给委托人。监管政策允许的情况下，管理人也可以将未变现资产按照委托人持有份额的比例分配给委托人，具体事宜以管理人公告为准。”

#### **删去：**

#### “二十八、合同的补充、修改与变更

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所、基金业协会、证券业协会等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告之日起生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照管理人开放公告中约定的开放日申请退出本集合计划。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的 10 个工作日内开放日或 10 个工作日内期限届满后的合同变更临时开放期内提出退出本集合计划的申请；委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意合同变更。委托人不同

意变更的,管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排:委托人不同意变更的,管理人保障其退出集合计划的权利;对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人,管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理。合同变更生效日以管理人公告为准。

委托人同意,无论其是否同意合同变更或提出退出申请,管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

其中,由于其他原因需要变更合同的情形,包括但不限于以下情形:

(1) 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,资产管理计划由其他管理人承接;

(2) 托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,资产管理计划由其他托管人承接。

3、合同变更后,委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利,履行相应义务。

4、委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式,约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失,或排除委托人自行承担投资风险和损失。

管理人特别提示,合同变更可能涉及委托人的各项权益调整(包括但不限于权利义务的重大变动,管理费、托管费、业绩报酬的提高或降低等),委托人应实时关注管理人网站(www.sczq.com.cn)公告;委托人同意,管理人通过网站公告的方式视为已合理征询委托人的意见,无论其是否同意合同变更或提出退出申请,委托人同意,无论其是否同意合同变更或提出退出申请,管理人在与托管人达成一致意见并通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见后,按照上述程序变更本合同属于委托人认可的行为。”

**二十六、原合同“二十五、违约责任与争议处理”拆分为“二十五、违约责任”及“二十六、争议的处理”,**

**原:**

“二十五、违约责任与争议处理

(一) 违约责任

1、管理人、托管人在履行各自职责的过程中,违反法律、行政法规的规定

或者本合同约定，给计划财产或者委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给计划财产或者委托人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

(1) 不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于相关法律法规的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划财产损失扩大。任何一方当事人延迟履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

(2) 管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

(3) 在没有欺诈、故意或重大过失的情况下，管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

(4) 在没有过错或重大过失的情况下，托管人执行管理人的生效指令对集合计划资产造成的损失；

(5) 在计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

(6) 管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给集合计划财产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。

(7) 相关法律、行政法规和规定的变更。

2、合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。

3、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约

方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

4、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成计划财产或委托人损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

5、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

6、管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

7、托管人对于没有保管在托管人处的有价证券及其他集合计划资产不负有保管责任，由于非托管人的过错致使其保管的资产发生毁损或灭失的，托管人不承担赔偿责任。

委托人的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成集合计划资产损失的，管理人和托管人不承担任何责任。

## （二）争议的处理

因履行本合同发生的争议，由协议签订各方将争议提交“中国证券业协会证券纠纷调解中心”调解，调解不成的，任何一方均有权将争议提交北京仲裁委员会并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在北京，适用该会当时合法有效的仲裁规则，仲裁费用由败诉方承担。争议处理期间，合同当事人仍应履行本合同规定的义务，维护各方合法权益。”

## 变更为：

### “二十五、违约责任

1、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，但不因各自职责以外的事由与其他当事人承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

#### （1）不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但

不限于相关法律法规的变更；国际、国内金融市场风险事故的发生；战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划财产损失扩大。任何一方当事人延迟履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

(2)管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等。

(3)在没有欺诈、故意或重大过失的情况下，管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等。

(4)在没有过错或重大过失的情况下，托管人执行管理人的生效指令对集合计划资产造成的损失。

(5)在计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

(6)因司法、行政等有权机关对集合计划财产采取冻结、扣划等非托管人原因造成损失，托管人不承担任何责任。

(7)相关法律法规和规定的变更。

2、合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。

3、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

4、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成计划财产或委托人损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

5、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

6、管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

7、委托人的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成本集合计划资产损失的，管理人和托管人不承担任何责任。

8、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者资产委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，但不因各自职责以外的事由与其他当事人承担连带赔偿责任；管理人、托管人因共同行为给计划财产或委托人造成损害的，应当根据各自的过错程度承担相应的赔偿责任。

## 二十六、争议的处理

因履行本合同发生的争议，由协议签订各方将争议提交“中国证券业协会证券纠纷调解中心”调解，调解不成的，任何一方均有权将争议提交北京仲裁委员会并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在北京，适用该会当时合法有效的仲裁规则，仲裁费用等由败诉方承担。争议处理期间，当事人仍应履行本合同规定的义务，维护各方合法权益。”

## 二十七、原合同“二十六、风险揭示”更名为“二十三、风险揭示”，其中：

原：

“本集合计划面临包括但不限于以下风险：

### （一）市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

#### 2、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性

的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

### 3、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

### 4、证券发行公司经营风险

证券发行公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

5、衍生品风险。金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

### 6、购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

## （二）管理风险

在集合资产管理计划运作过程中，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，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集合资产管理计划的收益水平，从而产生风险。

## （三）流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本集合计划在开放期出现投资者大额或巨额赎回，致使本集合计划没有足够的现金应付集合计划退出支付的要求所导致的风险。

（四）管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险

管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

## （五）信用风险

集合计划在交易过程中发生交收违约，或者集合计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，



造成集合计划资产损失的风险。

#### （六）其他风险

1、管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；

2、管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

3、参与失败风险。委托人参与本集合计划，必须足额交款，推广机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表推广机构确实接收到参与申请。如果委托人资金在规定时间内未全额到账，无论到帐金额高于、等于或低于本集合计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回委托人账户。

4、设立失败风险。推广期结束时，本集合计划受市场环境，或其他同业竞争（如基金多客户资产管理业务）的影响，募集规模可能未达到法律、法规规定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险。

5、突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

- （1）集合计划终止时，资产无法变现的情形；
- （2）相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；
- （3）交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；
- （4）无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

6、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；

7、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托资产的损失，从而带来风险；

8、投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，但投资者撤回同意，存在可能导致管理人无法为投资者提供相关产品或服务的风；

9、投资者已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但

仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险。

#### （七）本集合计划特有风险

##### 1、委托人可能无法参与的风险

由于本集合计划设定了推广期及存续期的规模上限，管理人将根据合同的约定对集合计划的规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

##### 2、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

##### 3、使用电子签名合同的风险（如有）

如本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。

##### 4、份额转让时可能面临的风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，在条件允许的情况下，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。在办理转让业务时可能出现的风险至少包括：

###### （1）操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些原因出现故障，从而影响转让业务办理。

###### （2）折溢价风险

在份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

##### 5、债券正回购投资风险

组合在进行正回购操作时，可能由于回购利率大于债券投资收益以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行正回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使组合的风险将

会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对组合造成损失的可能性也就越大。

#### （八）特别提示

本集合计划依法设立，投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件，并确保理解相关条款和业务规则，包括但不限于：

##### 1、提前终止条款

存续期内，集合计划持续 5 个工作日投资者少于 2 人，导致本集合计划提前终止。

##### 2、强制退出条款

集合计划份额持有人持有的集合计划资产净值高于 30 万元时，可以选择部分退出集合计划份额，集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30 万元。集合计划份额持有人申请退出集合计划份额时，其持有的集合计划资产净值低于 30 万元的，必须选择一次性退出全部集合计划份额，集合计划份额持有人没有一次性全部退出持有份额的，管理人将该集合计划份额持有人所持份额做全部退出处理。

##### 3、电子签名信息保护

如委托人签署电子签名合同进行交易的，应积极采取安全措施，加强账户、密码的保护。

##### 4、巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生委托人大量甚至巨额退出集合计划的情形，若出现合同约定的巨额退出，将可能导致集合计划面临流动性风险，增加集合计划所持有证券的变现成本，造成计划资产损失。对于委托人而言，在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。”

#### **变更为：**

##### “（一）本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，但不保证本集合计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本集合计划属于 R2 投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2 及以上的合格投资者。

若销售机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

## （二）市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

### 2、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

### 3、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

### 4、证券发行公司经营风险

证券发行公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

### 5、购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

### 6、再投资风险

再投资风险是债券持有者在持有期得到的利息收入、到期时得到的本息、出售时得到的资本收益等，用它们来再投资所能实现的报酬可能会低于当初购买该债券的收益率的风险。

### （三）管理风险

在集合资产管理计划运作过程中，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，如管理人判断有误、获取信息不全、对投资工具使用不当等影响集合资产管理计划的收益水平，从而产生风险。

### （四）流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本集合计划在开放期出现投资者大额或巨额退出，致使本集合计划没有足够的现金应付集合计划退出支付的要求所导致的风险。

### （五）信用风险

集合计划在交易过程中发生交收违约，或者集合计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，造成集合计划资产损失的风险。

### （六）其他风险

1、管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；

2、管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，可能导致委托资产的损失，从而带来风险；

3、参与失败风险。委托人参与本集合计划，必须足额交款，销售机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到参与申请。如果委托人资金在规定时间内未全额到账，无论到账金额高于、等于或低于本集合计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回委托人账户；

4、设立失败风险。初始募集期结束时，本集合计划受市场环境等影响，募集规模可能未达到法律、法规规定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险；

管理人的责任承担方式：

①以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

②在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内

返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

5、突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

- (1) 本集合计划终止时，资产无法变现的情形；
- (2) 相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；
- (3) 交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；
- (4) 无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

6、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；

#### 7、操作风险

操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险；

#### 8、技术风险

技术风险是指在集合资产管理各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自证券公司、注册登记机构、证券交易所、托管机构等；

9、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

#### 10、税收政策相关风险

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。委托人必须自行缴纳的税收由委托人负责，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。如依据相关法律法规或税务机关的认定，就本集合计划运营过程中发生的增值税等应税行为，管理人需要承担相应纳税义务的，除本集合计划已列明的资产管理业务费用产生的管理费、托管费、业绩报酬等税费由各收款方自行缴纳外，管理人有权以计划财产予以缴纳，且无需事先征得委托人的同意；管理人在向委托人交付相关收益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，委托人应按照管理人通知要求进行缴纳；委托人不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。

#### 11、投资者风险承受能力与本集合计划风险等级不匹配的风险

委托人应按照管理人或者销售机构的要求，真实、准确、完整的提供信息、资料，包括但不限于委托人身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险承受能力、诚信记录和投资偏好等信息，若委托人提供的信息、资料存在虚假、不完整、不准确情形或者上述信息发生变化定期更新不及时，可能导致委托人风险承受能力等级与本集合计划不匹配，最终委托人可能遭受超出其承受能力或被强制退出的风险。

#### 12、反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息，委托人无权知悉，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

#### 13、非居民金融账户涉税信息报送安排相关风险

根据《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送相关信息，管理人、销售机构无义务告知委托人报送安排及报送内容，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

#### 14、关联交易的风险

(1) 对于重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，逐笔征求意见或公告确认的方式征询投资者，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(2) 对于一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的划分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐笔征询并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

15、基于本产品固有风险及管理人的业务或者财产状况的不确定性，存在可能直接导致本金亏损及超过原始本金损失的风险。

16、因管理人的业务或者财产状况具有不确定性，存在影响委托人的判断并进而给委托人带来收益甚至本金亏损等风险。

17、投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，但投资者撤回同意，存在可能导致管理人无法为投资者提供相关产品或服务的风​​险。

18、投资者已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险。

19、集合计划的持仓债券存在信用等级波动而使得委托人参与集合计划时集合计划所持仓债券信用评级不符合合同约定信用等级的风险，管理人将按本合同约定及时调整持仓债券，但存在因市场状况或其他原因无法及时调整完毕造成集合计划资产损失的风险。

#### （七）本集合计划特有风险

##### 1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本集合计划资产管理合同在不违反相关法律法规、不违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》和证券投资基金业协会的合同指引及其他有关规定的​​前提下，根据本集合计划的具体交易安排及实际情况，在投资者利益最大化的原则下，对合同指引规定的内容做了部分更加具体细化的约定，对合同指引规定以外的内容做了部分约定，且对合同指引部分不完全适用于本资管计划的规定做了必要调整（或有），但相关内容的调整（如有）均以不损害投资者利益为基础。投资者应详细阅读本合同的各项条款，因此产生的或有风险特提示投资者注意。

##### 2、委托人可能无法参与的风险

由于本集合计划设定了初始募集期及存续期的规模上限，管理人将根据合同的约定对本集合计划的规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

##### 3、资产管理计划委托募集所涉风险

本集合计划可能委托除管理人之外的外部销售机构销售，虽然管理人通过签署相关协议与销售机构进行权利义务的划分，但仍可能存在因外部销售机构自身



的违法违规行为、违反合同约定的操作、技术系统故障或操作差错等原因而损害投资者权益的风险，请投资者知晓。

4、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

集合计划成立后，管理人将按照相关法律法规的要求向证券投资基金业协会申请办理计划备案手续，但不能保证一定能办理成功。如本集合计划最终未能在证券投资基金业协会完成备案手续或被不予备案的，本集合计划将按照本合同约定终止清算，由此将影响投资者参与本集合计划的投资目的。

5、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人或委托人疏于及时查看销售机构发布的公告，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本集合计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

6、本集合计划公布收益分配方案后，可能存在本集合计划净值浮动等原因导致收益分配日可供实际分配的资金少于收益分配方案公布的分配金额，届时管理人有权对实际分红金额进行适当调整，则委托人存在实际收到的分红金额与收益分配方案不完全相同的风险。

7、本集合计划有一定的封闭期，封闭期内委托人无法退出集合计划；且本集合计划不在交易所上市，委托人无法通过交易所市场公开交易。

8、使用电子签名合同的风险（如有）

如本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。

9、份额转让时可能面临的风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，在条件允许的情况下，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。在办理转让业务时可能出现的风险至少包括：

（1）操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些原因出现故障，从而影响转让业务办理。

## （2）折溢价风险

在份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

## 10、债券正回购投资风险

组合在进行正回购操作时，可能由于回购利率大于债券投资收益以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行正回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对组合造成损失的可能性也就越大。

## （八）特别提示

本集合计划依法设立，投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件，并确保理解相关条款和业务规则，包括但不限于：

### 1、提前终止条款

存续期内，持续五个工作日投资者少于二人，导致本集合计划提前终止。

### 2、强制退出条款

集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30.00 万元。若某笔退出导致该委托人持有的集合计划资产净值低于 30.00 万元，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

### 3、电子签名信息保护

如委托人签署电子签名合同进行交易的，应积极采取安全措施，加强账户、密码的保护。

### 4、巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生委托人大量甚至巨额退出集合计划的情形，若出现合同约定的巨额退出，将可能导致集合计划面临流动性风险，增加集合计划所持有证券的变现成本，造成计划资产损失。对于委托人而言，在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。”

二十八、原合同“二十七、合同的成立与生效”更名为“二十七、资产管理合同的效力”，其中：

原：

“（一）合同的成立与生效

本合同以电子签名或纸质方式签署，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款，委托人作为本合同一方，以电子签名或纸质方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款。本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- （1）委托人参与资金实际交付并确认；
- （2）本集合计划成立。

本集合计划终止，本合同终止。但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。

若合同变更通过重新签订合同的方式进行的，新签署合同的生效日期以管理人公告为准，同时在该生效日之前签订的合同同时废止。

（二）合同的组成

《首创证券创赢4号集合资产管理计划说明书》、经管理人确认有效的委托人参与、退出本集合计划的申请材料和各推广机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。”

变更为：

“（一）资产管理合同签署的方式

资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。本合同以电子签名或纸质方式签署，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款，委托人作为本合同一方，以电子签名或纸质方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款。

（二）资产管理合同的生效条件

资产管理合同以加盖管理人和托管人的公章或合同专用章以及双方法定代表人/负责人或授权代表签字或签章，投资者以电子签名或纸质方式签署后即告

成立。

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- (1) 委托人参与资金实际交付并经注册登记机构确认；
- (2) 本集合计划成立。

资产管理合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

本集合计划终止，本合同终止。但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。

若合同变更通过重新签订合同的方式进行的，新签署合同的生效日期以管理人公告为准，同时在该生效日之前签订的合同同时废止。

### (三) 合同的组成

《说明书》、经管理人确认有效的委托人参与、退出本集合计划的申请材料和各销售机构出具的本集合计划参与、退出业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

### (四) 资产管理合同的有效期限

本合同固定有效期为 10 年，如出现约定的终止情形时，终止清算，期满可展期。

委托人自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在本集合计划存续期间，委托人自全部份额退出之日起，该委托人不再是资产管理合同的当事人。

### (五) 合同的数量

若本合同的签署委托人采用电子签名的方式进行的，管理人与托管人双方同时签署纸质合同，纸质合同原件一式贰份，由管理人与托管人各执壹份，管理人确保投资者以电子签名方式签署的合同内容与管理人和托管人签署的纸质合同内容保持一致。

若本合同的签署委托人采用纸质方式签署的，本合同一式叁份，当事人各执壹份，每份具有同等的法律效力。”

**二十九、原合同“二十九、其他事项”更名为“二十八、其他事项”，其中：**

**原：**

“本合同所称的其他事项是指，根据相关法律法规的规定，在满足本合同约

定的情况下，本集合计划管理人与托管人可能发生变更。

（一）资产管理计划管理人和托管人的更换的情形

1、资产管理计划管理人的更换

有下列情形之一的，管理人职责终止：

- ①管理人被依法取消资产管理业务资格；
- ②管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；
- ③法律法规和基金合同规定的其他情形。

2、资产管理计划托管人的更换

有下列情形之一的，托管人职责终止：

- ①托管人被依法取消基金托管资格；
- ②托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产；
- ③法律法规和基金合同规定的其他情形。

（二）管理人的变更程序

1、经本集合计划全体委托人、托管人同意，本集合计划可变更管理人；

2、管理人应按照监管机构的要求办理转让手续；

3、管理人职责终止的，管理人应妥善保管资产管理业务资料，及时向新任管理人办理资产管理业务的移交手续，新任管理人应及时接收。新任管理人应与托管人核对本计划资产总值和净值；

4、管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报法律法规规定的监管机构、自律组织备案，审计费用从计划财产中列支；

5、管理人更换后，如果原任或新任管理人要求，应按其要求替换或删除计划名称中与原管理人有关的名称字样；

6、管理人变更程序的例外：管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的子公司。委托人在此同意，如果本事件发生，在管理人与托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务由从事资产管理业务的子公司承继，并无须就此项变更和委托人另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告委托人。管理人保障委托人退出本专项计划的权利，并在届时的通告中对相关事项作出合

理安排。管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

### （三）托管人的更换程序

1、经本集合计划全体委托人、管理人同意，本集合计划可变更托管人；

2、托管人应按照监管机构的要求办理转让手续；

3、托管人职责终止的，托管人应妥善保管资产管理业务资料，及时向新任托管人办理资产管理业务的移交手续，新任托管人应及时接收。新任托管人应与管理人核对本计划资产总值和净值；

4、托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报法律法规规定的监管机构、自律组织备案，审计费用从计划财产中列支。

（四）新任管理人接受资产管理或新任托管人接受计划财产和托管业务前，原管理人或托管人应依据法律法规和本合同的规定继续履行相关职责，并保证不对委托人的利益造成损害。原管理人或托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本合同的规定收取管理费或托管费。

（五）本部分关于管理人、托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需经委托人同意。”

### **变更为：**

“本合同所称的其他事项是指，根据相关法律法规的规定，在满足本合同约定的情况下，本集合计划管理人与托管人可能发生变更。

#### （一）资产管理计划管理人和托管人的更换的情形

##### 1、资产管理计划管理人的更换

管理人的更换条件，有下列情形之一的，管理人职责终止：

（1）管理人被依法取消资产管理业务资格；

（2）管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；

（3）法律法规和本合同规定的其他情形。

##### 2、资产管理计划托管人的更换

托管人的更换条件，有下列情形之一的，托管人职责终止：

- (1) 托管人被依法取消基金托管资格；
- (2) 托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产；
- (3) 法律法规和本合同规定的其他情形。

#### (二) 管理人的变更程序

- 1、经本集合计划全体委托人、托管人同意，本集合计划可变更管理人；
- 2、管理人应按照监管机构的要求办理转让手续；
- 3、管理人职责终止的，管理人应妥善保管资产管理业务资料，及时向新任管理人办理资产管理业务的移交手续，新任管理人应及时接收。新任管理人应与托管人核对本集合计划资产总值和净值；
- 4、管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报法律法规规定的监管机构、自律组织备案，审计费用从计划财产中列支；
- 5、管理人更换后，如果原任或新任管理人要求，应按其要求替换或删除计划名称中与原管理人有关的名称字样；
- 6、管理人变更程序的例外：管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的子公司。委托人在此同意，如果本事件发生，在管理人与托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给前述的从事资产管理业务的子公司，并无须就此项变更和委托人另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告委托人。管理人保障委托人退出本计划的权利，并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

#### (三) 托管人的变更程序

- 1、经本集合计划全体委托人、管理人同意，本集合计划可变更托管人；
- 2、托管人应按照监管机构的要求办理转让手续；
- 3、托管人职责终止的，托管人应妥善保管资产管理业务资料，及时向新任托管人办理资产管理业务的移交手续，新任托管人应及时接收。新任托管人应与管理人核对本集合计划资产总值和净值；

4、托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对计划财产进行审计，并将审计结果予以公告，同时报法律法规规定的监管机构、自律组织备案，审计费用从计划财产中列支。

#### （四）变更时机构履职的特别规定

新任管理人接受资产管理或新任托管人接受计划财产和托管业务前，原管理人或托管人应依据法律法规和本合同的规定继续履行相关职责，并保证不对委托人的利益造成损害。原管理人或托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本合同的规定收取管理费或托管费。

#### （五）法律法规或监管规则的变更时的适用

本部分关于管理人、托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需经委托人同意。”

### 三十、原合同新增“附件：《风险揭示书》”部分内容，

#### 新增：

“附件：《风险揭示书》

首创证券创赢4号

集合资产管理计划

风险揭示书

尊敬的客户：

投资有风险。当您/贵机构参与资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在作出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同，充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。

根据有关法律法规，首创证券股份有限公司及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

#### 一、管理人声明与承诺



（一）管理人向投资者声明，中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”）为资产管理计划办理备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。

（二）管理人保证在投资者签署资产管理合同前已（或已委托销售机构）向投资者揭示了相关风险；已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力。

（三）管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用资产管理计划财产，不保证资产管理计划财产一定盈利，也不保证最低收益。

## 二、风险揭示

### （一）本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，但不保证本集合计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本集合计划属于 R2 投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2 及以上的合格投资者。

若销售机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

### （二）市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

#### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

#### 2、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

#### 3、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

#### 4、证券发行公司经营风险

证券发行公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

#### 5、购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

#### 6、再投资风险

再投资风险是债券持有者在持有期得到的利息收入、到期时得到的本息、出售时得到的资本收益等，用它们来再投资所能实现的报酬可能会低于当初购买该债券的收益率的风险。

### （三）管理风险

在集合资产管理计划运作过程中，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，如管理人判断有误、获取信息不全、对投资工具使用不当等影响集合资产管理计划的收益水平，从而产生风险。

### （四）流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本集合计划在开放期出现投资者大额或巨额退出，致使本集合计划没有足够的现金应付集合计划退出支付的要求所导致的风险。

### （五）信用风险

集合计划在交易过程中发生交收违约，或者集合计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，造成集合计划资产损失的风险。

### （六）其他风险

1、管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；

2、管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，可能导致委托资产的损失，从而带来风险；

3、参与失败风险。委托人参与本集合计划，必须足额交款，销售机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到参与申请。如果委托人资金在规定时间内未全额到账，无论到账金额高于、等于或低于本集合计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回委托人账户；

4、设立失败风险。初始募集期结束时，本集合计划受市场环境等影响，募集规模可能未达到法律、法规规定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险；

管理人的责任承担方式：

①以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

②在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

5、突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

（1）本集合计划终止时，资产无法变现的情形；

（2）相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；

（3）交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；

（4）无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

6、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；

7、操作风险

操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险；

8、技术风险

技术风险是指在集合资产管理各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术

系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自证券公司、注册登记机构、证券交易所、托管机构等；

9、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

#### 10、税收政策相关风险

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。委托人必须自行缴纳的税收由委托人负责，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。如依据相关法律法规或税务机关的认定，就本集合计划运营过程中发生的增值税等应税行为，管理人需要承担相应纳税义务的，除本集合计划已列明的资产管理业务费用产生的管理费、托管费、业绩报酬等税费由各收款方自行缴纳外，管理人有权以计划财产予以缴纳，且无需事先征得委托人的同意；管理人在向委托人交付相关收益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，委托人应按照管理人通知要求进行缴纳；委托人不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。

#### 11、投资者风险承受能力与本集合计划风险等级不匹配的风险

委托人应按照管理人或者销售机构的要求，真实、准确、完整的提供信息、资料，包括但不限于委托人身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险承受能力、诚信记录和投资偏好等信息，若委托人提供的信息、资料存在虚假、不完整、不准确情形或者上述信息发生变化定期更新不及时，可能导致委托人风险承受能力等级与本集合计划不匹配，最终委托人可能遭受超出其承受能力或被强制退出的风险。

#### 12、反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息，委托人无权知悉，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

#### 13、非居民金融账户涉税信息报送安排相关风险

根据《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关的法律法规、监

管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送相关信息，管理人、销售机构无义务告知委托人报送安排及报送内容，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

#### 14、关联交易的风险

(1) 对于重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，逐笔征求意见或公告确认的方式征询投资者，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(2) 对于一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的划分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐笔征询并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

15、基于本产品固有风险及管理人的业务或者财产状况的不确定性，存在可能直接导致本金亏损及超过原始本金损失的风险。

16、因管理人的业务或者财产状况具有不确定性，存在影响委托人的判断并进而给委托人带来收益甚至本金亏损等风险。

17、投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，但投资者撤回同意，存在可能导致管理人无法为投资者提供相关产品或服务的风

18、投资者已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险。

19、集合计划的持仓债券存在信用等级波动而使得委托人参与集合计划时集合计划所持仓债券信用评级不符合合同约定信用等级的风险，管理人将按本合同约定及时调整持仓债券，但存在因市场状况或其他原因无法及时调整完毕造成集合计划资产损失的风险。

#### (七) 本集合计划特有风险

##### 1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本集合计划资产管理合同在不违反相关法律法规、不违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理

规定》和证券投资基金业协会的合同指引及其他有关规定的的前提下，根据本集合计划的具体交易安排及实际情况，在投资者利益最大化的原则下，对合同指引规定的内容做了部分更加具体细化的约定，对合同指引规定以外的内容做了部分约定，且对合同指引部分不完全适用于本资管计划的规定做了必要调整（或有），但相关内容的调整（如有）均以不损害投资者利益为基础。投资者应仔细阅读本合同的各项条款，因此产生的或有风险特提示投资者注意。

## 2、委托人可能无法参与的风险

由于本集合计划设定了初始募集期及存续期的规模上限，管理人将根据合同的约定对本集合计划的规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

## 3、资产管理计划委托募集所涉风险

本集合计划可能委托除管理人之外的外部销售机构销售，虽然管理人通过签署相关协议与销售机构进行权利义务的划分，但仍可能存在因外部销售机构自身的违法违规行、违反合同约定的操作、技术系统故障或操作差错等原因而损害投资者权益的风险，请投资者知晓。

## 4、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

集合计划成立后，管理人将按照相关法律法规的要求向证券投资基金业协会申请办理计划备案手续，但不能保证一定能办理成功。如本集合计划最终未能在证券投资基金业协会完成备案手续或被不予备案的，本集合计划将按照本合同约定终止清算，由此将影响投资者参与本集合计划的投资目的。

## 5、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人或委托人疏于及时查看销售机构发布的公告，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本集合计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

6、本集合计划公布收益分配方案后，可能存在本集合计划净值浮动等原因导致收益分配日可供实际分配的资金少于收益分配方案公布的分配金额，届时管

理人有权对实际分红金额进行适当调整，则委托人存在实际收到的分红金额与收益分配方案不完全相同的风险。

7、本集合计划有一定的封闭期，封闭期内委托人无法退出集合计划；且本集合计划不在交易所上市，委托人无法通过交易所市场公开交易。

#### 8、使用电子签名合同的风险（如有）

如本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。

#### 9、份额转让时可能面临的风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，在条件允许的情况下，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。在办理转让业务时可能出现的风险至少包括：

##### （1）操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些原因出现故障，从而影响转让业务办理。

##### （2）折溢价风险

在份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

#### 10、债券正回购投资风险

组合在进行正回购操作时，可能由于回购利率大于债券投资收益以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行正回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对组合造成损失的可能性也就越大。

#### （八）特别提示

本集合计划依法设立，投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件，并确保理解相关条款和业务规则，包括但不限于：

##### 1、提前终止条款

存续期内，持续五个工作日投资者少于二人，导致本集合计划提前终止。

## 2、强制退出条款

集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30.00 万元。若某笔退出导致该委托人持有的集合计划资产净值低于 30.00 万元，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

## 3、电子签名信息保护

如委托人签署电子签名合同进行交易的，应积极采取安全措施，加强账户、密码的保护。

## 4、巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生委托人大量甚至巨额退出集合计划的情形，若出现合同约定的巨额退出，将可能导致集合计划面临流动性风险，增加集合计划所持有证券的变现成本，造成计划资产损失。对于委托人而言，在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。

## 三、投资者声明

作为本计划的投资者，本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，自愿自行承担投资该计划所面临的风险。本人/机构作出以下陈述和声明，并确认（自然人投资者在每段段尾“【           】”内签名，机构投资者在本页、尾页盖章，加盖骑缝章）其内容的真实和正确：

1、本人/机构已仔细阅读资产管理业务相关法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本计划运作方式及风险收益特征，愿意承担由上述风险引致的全部后果。【           】

2、本人/机构知晓，管理人、销售机构、托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产的收益状况作出任何承诺或担保。【           】

3、本人/机构符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关合格投资者的要求，并已按照管理人或销售机构的要求提供相关证明文件。【           】



4、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【           】

5、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“当事人及权利义务”章节的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【           】

6、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“资产管理计划的投资”章节的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【           】

7、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“资产管理计划的费用与税收”章节中的所有内容。【           】

8、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“争议的处理”章节中的所有内容。【           】

9、本人/机构已经配合管理人或其销售机构提供了法律法规规定的信息资料及身份证明文件，以配合上述机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查以及反洗钱等监管规定的工作。

本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效。  
【           】

10、本人/机构知晓，证券投资基金业协会为资产管理计划办理备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。【           】

11、本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构购买（参与）资产管理计划。  
【           】

12、本人/机构承诺不以非法拆分转让为目的购买资产管理计划，不会突破合格投资者标准，将资产管理计划份额或其收益权进行非法拆分转让。【            】

13、本人/机构知悉本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。【            】

本人承诺已仔细的、完整的阅读上述所有陈述与声明，并在此签字确认：

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

管理人（盖章）：

日期：

销售机构经办人（签字）[集合资产管理计划适用]：

日期：”

上述变更内容如涉及到托管协议、计划说明书、风险揭示书，相应同步变更。

首创证券股份有限公司

2023年11月23日