

关于西部证券安心 2 号集合资产管理计划资产管理合同变更意见征询函

兴业银行股份有限公司：

中国证监会于 2023 年初发布修订后的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》和《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“《资管规定》及配套文件”），结合西部证券安心 2 号集合资产管理计划的运作情况，我公司拟对《西部证券安心 2 号集合资产管理计划资产管理合同（第一次修订）》中的相关条款进行变更。具体如下：

一、合同变更主要内容

| 标题 | 变更前 | 变更后 |
|---------|---|---|
| | 根据修订后的《资管规定》及配套文件，更新与管理人向协会、证监会及其相关派出机构等监管部门或自律组织的备案/报告工作安排相关的内容。 | |
| | 更新涉及法律法规的名称及文号 | |
| 第一部分 前言 | 三、…… 投资者保证委托资产的来源及用途合法，承诺已经履行反洗钱职责，确认不存在洗钱行为，不得将自有资金和募集资金混同操作。并在签订本合同前，已经签署了风险揭示书及客户风险承受能力调查表（如需），投资者阅知本合同全文，了解相关权利、义务和风险，并根据自身能力审慎决策参与本计划，对投资行为承担完全后果，独立承担投资风险。 | 三、…… 投资者保证委托资产的来源及用途合法，承诺已经履行反洗钱职责，确认不存在洗钱行为，不得将自有资金和募集资金混同操作。并在签订本合同前，投资者阅知本合同及附件全文，了解相关权利、义务和风险，并根据自身能力审慎决策参与本计划，对投资行为承担完全后果，独立承担投资风险。 |
| 第二部分 释义 | （二十九）万份收益、每万份收益：指每日每万份集合资产管理计划单位实现的净收益金额，也就是万份集合资产管理计划单位 | 删除 |

| | | |
|------------|--|---|
| | <p>净收益。</p> <p>(三十)七日年化收益率：指集合资产管理计划最近七日平均净收益水平，进行年化以后得出的数据。</p> | |
| 第二部分 释义 | <p>(三十四)计划份额净值：指计算日计划资产净值除以当日资产管理计划份额余额总数后得出的资产管理计划每份额资产净值。</p> | <p>(三十二)计划份额净值/单位净值：指计算日计划资产净值除以当日资产管理计划份额余额总数后得出的资产管理计划每份额资产净值。</p> |
| 第三部分 承诺与声明 | | <p>增加：</p> <p>四、本合同当事人承诺：各方都清楚并愿意严格遵守中华人民共和国有关反商业贿赂的法律规定和廉洁从业的行业规范以及行业普遍遵守的职业道德和行为准则，坚决拒绝商业贿赂、行贿及其他不正当之商业行为及违反廉洁从业的行为，各方都清楚任何违反廉洁自律要求的行为都将受到惩处；各方及其工作人员或委托人员均不得利用职务便利向其他方及其工作人员或委托人员索要、收受、提供、给予合同约定外的任何利益，既包括金钱利益和实物利益，也包括可以用金钱计算数额的财产性利益；如一方工作人员或其委托人员主动向其他方索（行）贿或索取（给予）不正当利益，被索方（被给予方）有权向其内部相关职能部门或向相关行政主管部门实名举报，并提供相关证据，配合该方对其工作人员或委托人员的查处；若一方违反前述承诺需承担法律后果，同时其他方有权采取如下措施追究其相应责任：（1）立即终止本合同且无需承担违约责任；（2）向任何第三方披露、或向社会公开其违法违规行；（3）提请行政主管部门依法追究其行政责任，或提请司法机关依法追究其刑事责任。</p> |

| | | |
|---|---|--|
| <p>第四部分 当事人的权利与义务</p> <p>一、合同当事人</p> <p>(二) 管理人</p> | <p>西部证券股份有限公司</p> <p>注册地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室</p> <p>办公地址：上海市浦东新区耀体路 276 号 1501 室-1508 室</p> <p>法定代表人：徐朝晖</p> <p>联系人：吕珂忻</p> <p>联系电话：021-68867065</p> <p>传真号码：021-68866317</p> <p>网址：www.west95582.com</p> | <p>西部证券股份有限公司</p> <p>注册地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室</p> <p>办公地址：上海市浦东新区耀体路 276 号 1501 室-1508 室</p> <p>法定代表人：徐朝晖</p> <p>联系人：王蓓蓓</p> <p>联系电话：021-68862863</p> <p>传真号码：021-68866317</p> <p>网址：www.west95582.com</p> |
| <p>第四部分 当事人的权利与义务</p> <p>一、合同当事人</p> <p>(三) 托管人</p> | <p>兴业银行股份有限公司</p> <p>法定代表人：吕家进</p> <p>住所：福州市湖东路 154 号</p> <p>通讯地址：上海市浦东新区银城路 167 号</p> <p>联系人：林诗琪</p> <p>联系电话：021-52629999</p> | <p>兴业银行股份有限公司</p> <p>法定代表人：吕家进</p> <p>住所：福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦</p> <p>通讯地址：上海市浦东新区银城路 167 号</p> <p>联系人：林诗琪</p> <p>联系电话：021-52629999</p> |
| <p>第四部分 当事人的权利与义务</p> <p>四、本计划投资者的义务包括但不限于：</p> | | <p>增加：</p> <p>(十一) 如投资者资金来源为募集资金，投资者保证委托资产的来源及用途合法，承诺已经在募集资金环节履行客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存、大额交易和可疑交易报告等反洗钱职责，确认不存在洗钱行为，管理人无需对投资者募集资金客户履行反洗钱职责。投资者不得将自有资金和募集资金混同操作；投资者在初始和持续募集资金过程中不得接受资管产品作为募集资金来源；</p> <p>(十二) 投资者应当听取管理人或销售机构的适当性匹配意见并进行自主决策，在购买本产品或接受相应服务时，应当按照管理人和销售机构明示的要求提供管理人和销售机</p> |

| | | |
|---|---|---|
| | | 构履行适当性管理和开展反洗钱工作所需的真实信息。如投资者向管理人或销售机构提供虚假信息或证明材料，管理人、销售机构据此作出销售产品或提供金融服务行为的，由投资者自行承担不利后果及责任。 |
| 第四部分 当事人的权利与义务 五、管理人的权利包括但不限于： | (二) 按照本合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬 | (二) 按照本合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬 (如有) |
| 第四部分 当事人的权利与义务 五、管理人的权利包括但不限于： | | 增加： (七) 管理人或销售机构已按规定向投资者进行揭示(含不时发布的公告和沟通函件)或提出建议而投资者拒绝听取的，管理人、销售机构不承担投资者自主决定认申购、持有、赎回等所产生的责任。 |
| 第四部分 当事人的权利与义务 六、管理人的义务包括但不限于： | | 增加： (二十八) 保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户； |
| 第四部分 当事人的权利与义务 八、托管人的义务包括但不限于： | (十五) 投资于《管理办法》 第三十七条第(五)项 规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示； | (十五) 投资于《管理办法》 第三十八条第(五)项 规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示； |
| 第五部分 本计划的基本情况 一、本计划的基本情况： (五)本计划的投资范围 第十一部分 本计划的 投资 二、本资产管理计划的 | 本集合计划投资于现金、货币市场基金、银行存款、同业存单、债券回购、国债、央行票据、金融债、政策性金融债、公司债(包括非公开发行)、企业债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、资产支持证券优先级、短期融资券、 超级短期融资券 、中期票据(含非公开定向债务融资工具、如PPN、ABN等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具)、以及法律法规或 | 本集合计划投资于现金、货币市场基金、银行存款、同业存单、债券回购、国债、央行票据、金融债、政策性金融债、公司债(包括非公开发行)、企业债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、资产支持证券优先级、短期融资券、 超短期融资券 、中期票据(含非公开定向债务融资工具、如PPN、ABN等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具)、以及法律法规或中国证 |

| | | |
|--|---|--|
| <p>投资范围及比例；</p> <p>1、投资范围</p> | <p>中国证监会允许投资的其他金融工具。</p> | <p>监会允许投资的其他金融工具。</p> |
| <p>第五部分 本计划的基本情况</p> <p>一、本计划的基本情况：</p> <p>（六）本计划的投资比例</p> <p>第十一部分 本计划的投资</p> <p>二、本资产管理计划的投资范围及比例；</p> <p>2、投资比例</p> | <p>（六）本计划的投资比例</p> <p>固定收益类投资品种：现金、货币市场基金、银行存款、同业存单、债券逆回购、国债、央行票据、金融债、政策性金融债、公司债（包括非公开发行）、企业债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、资产支持证券优先级、短期融资券、超级短期融资券、中期票据（含非公开定向债务融资工具、如PPN、ABN等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）：占计划资产总值的比例不低于80%。</p> <p>本集合计划可以投资债券回购，投资债券正回购资金余额或逆回购资金余额均不超过上一日净资产的100%。</p> <p>本集合计划的总资产不超过净资产的200%。</p> | <p>（六）本计划的投资比例</p> <p>固定收益类投资品种：现金、货币市场基金、银行存款、同业存单、债券逆回购、国债、央行票据、金融债、政策性金融债、公司债（包括非公开发行）、企业债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、资产支持证券优先级、短期融资券、超短期融资券、中期票据（含非公开定向债务融资工具、如PPN、ABN等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）：占计划资产总值的比例不低于80%。</p> <p>本集合计划可以投资债券回购，投资债券正回购资金余额或逆回购资金余额均不超过上一日净资产的100%。</p> <p>本集合计划的总资产不超过净资产的180%。</p> |
| <p>第五部分 本计划的基本情况</p> <p>（七）本计划的产品风险等级</p> | <p>根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为R2，仅适合向风险承受能力等级为C2及高于C2的合格投资者推广，具体以销售机构确认的风险等级为准。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。</p> | <p>根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为R2，仅适合向风险承受能力等级为C2及高于C2的合格投资者推广，具体以销售机构确认的风险等级为准。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。</p> <p>本计划的产品风险等级仅表示管理人基于产品基本情况的一般认定，未参考单一投资者特性。为详尽了解产品风险，投资者应重点关注本合同“风险揭示”部分内容，并结合自身年龄、职业、教育经历或投资经验等个性情况进行深入理解。因各种因素影响，本</p> |

| | | |
|---|--|--|
| | | 资产管理计划仍有可能发生超出预期之外的损失。 |
| <p>第五部分 本计划的基本情况</p> <p>(十二) 预警止损措施</p> | | <p>增加</p> <p>本集合计划预警线为份额净值 0.95 元，本集合计划止损线为份额净值 0.9 元。</p> <p>当本集合计划份额净值低于 0.95 元，管理人将根据市场情况和财产运用状况对本集合计划持有的标的资产进行调整，在 15 个工作日内将总资产与净资产的比例降低至 140% 以下（含 140%），直至集合计划份额净值达到或高于 0.95 元。</p> <p>当本集合计划份额净值低于 0.9 元，管理人应自下一个交易日（T+1 日）起，对本计划持有的全部非现金资产进行不可逆变现操作，并于 10 个交易日内全部处置完毕。因持有流通受限证券及其他投资品种等管理人之外的因素导致本计划财产无法在 10 个交易日全部变现的，管理人应积极采取措施推进资产变现，待上述资产可以变现时，管理人应及时完成剩余可变现资产的变现操作。计划资产全部变现的当日为本合同提前终止日。</p> <p>预警、止损线由管理人进行监控；托管人负责按本合同约定复核份额净值，配合进行账务处理。</p> <p>虽然本计划设计有预警止损机制，但在极端情况下，计划终止时的计划单位净值仍有可能远低于本资产管理计划的止损线，届时本计划委托财产面临全部或者部分损失的风险。</p> |
| <p>第六部分 本计划的募集</p> <p>一、本计划的募集对象</p> | <p>……</p> <p>(三) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司</p> | <p>……</p> <p>(三) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、</p> |

| | | |
|---|---|--|
| | <p>司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>(四)接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；</p> <p>(五)基本养老金、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)；</p> <p>.....</p> | <p>基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>(四)接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；</p> <p>(五)基本养老金、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)；</p> |
| <p>第六部分 本计划的募集</p> | | <p>增加：</p> <p>十一、投资者服务</p> <p>(一)信息查询服务</p> <p>投资者可以通过管理人网站 www.west95582.com，查询本集合计划相关信息披露。具体披露信息及内容详见第二十三部分信息披露与报告。</p> <p>(二)投诉及建议受理服务</p> <p>投资人可以通过基金管理人客户服务中心人工热线 95582 及各销售机构网点柜台等不同的渠道对管理人和销售网点所提供的服务进行投诉或提出建议。</p> |
| <p>第八部分 本计划的参与、退出与转让</p> <p>六、参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> | <p>(一)本计划的参与采用“确定价”原则，即参与价格以每份额 1.00 元人民币为基准进行计算。</p> <p>(二)本计划采用份额退出的方式，即退出以份额申请。</p> | <p>(一)“未知价”原则，即本计划的参与和退出价格以参与和退出申请提交日所在交易日收市后计算的计划份额净值为基准进行计算。</p> <p>(二)本计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。</p> |

| | | |
|--|--|---|
| <p>第八部分 本计划的参与、退出与转让</p> <p>九、参与份额和退出金额的计算方式</p> | <p>(一) 本计划参与份额的计算方式</p> <p>本计划参与份额的计算方式如下： 参与份额=参与总金额/单位面值</p> <p>其中，参与份额的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。</p> <p>(二) 本计划退出金额的计算方式</p> <p>本计划退出金额的计算方式如下： 退出金额=退出份额×单位面值</p> <p>其中，退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。</p> | <p>(一) 本计划参与份额的计算方式</p> <p>本计划参与份额的计算方式如下： 参与份额=(参与总金额-参与费用(若有))/参与申请所在交易日的资产管理计划份额净值</p> <p>其中，参与份额的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。</p> <p>(二) 本计划退出金额的计算方式</p> <p>本计划退出金额的计算方式如下： 退出总金额=退出份额×退出申请所在交易日的资产管理计划份额净值 退出金额=退出总金额-退出费用(若有)-业绩报酬(若有)</p> <p>其中，退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此产生的误差产生的收益或损失由计划财产承担。</p> |
| <p>第八部分 本计划的参与、退出与转让</p> <p>十一、巨额退出和连续巨额退出</p> <p>(三) 告知客户方式</p> | <p>当发生巨额退出、连续巨额退出时，管理人应当及时告知投资者。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。</p> | <p>当发生巨额退出、连续巨额退出并采用超额部分延期退出或者发生暂停退出情形时，管理人应当及时告知投资者。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。</p> |
| <p>第八部分 本计划的参与、退出与转让</p> | <p>十八、管理人以自有资金参与本计划</p> <p>(一) 自有资金参与的条件</p> <p>管理人以自有资金参与本计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定。</p> <p>(二) 自有资金的参与方式</p> <p>管理人在推广期和存续期内可以以自有资金参与本计划。</p> <p>(三) 自有资金参与的份额比例</p> | <p>十八、证券期货经营机构及其子公司管理人以自有资金参与及退出本计划</p> <p>(一) 自有资金参与的条件</p> <p>证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司相关授权程序的批准。</p> |

自有资金参与的份额不得超过本计划总份额的 15%。管理人及其附属机构以自有资金参与本计划的份额合计不得超过计划总份额的 50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，管理人应当依照中国证监会规定及本合同约定及时调整达标。

(四) 自有资金的收益分配

管理人自有资金所持的集合资产管理计划份额，应当与投资者所持有的同类份额享有同等权益、承担同等风险。

(五) 自有资金的责任承担

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

(六) 自有资金的退出

管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。自有资金参与、退出时，应提前 5 个工作日告知投资者和托管人。为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人自有资金的参与、退出可不受前述比例和持有期限限制，但应及时告知投资者和托管人，并向相关证监会派出机构及协会报告。此处管理人自有资金的参与、退出并非管理人的法定或者合同约定义务，管理人享有最终选择权。

(二) 自有资金的参与方式

证券期货经营机构及其子公司在推广期和存续期内可以以自有资金参与本计划。

(三) 自有资金参与的份额比例

管理人自有资金参与的份额不得超过本计划总份额的 15%。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过计划总份额的 50%，中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，证券期货经营机构及其子公司应当依照中国证监会规定及本合同约定及时调整达标，无需事先告知和征询投资者及托管人，但事后应及时告知投资者及托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

(四) 自有资金的收益分配

证券期货经营机构及其子公司以自有资金所持的集合资产管理计划份额，应当与投资者所持有的同类份额享有同等权益、承担同等风险。

(五) 自有资金的责任承担

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

(六) 自有资金的参与及退出条件

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。投资者和托管人签署本合同即视为其同意初始募集期内证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与本集合计划。本计划存续期间，证券期货经营机构及其子公司拟于开放期以自有资金参与、退出本集合计划的，管理人

| | | |
|--|---|--|
| | | <p>应提前5个工作日以邮件方式征询托管人并取得其同意，并通过管理人网站公告方式征询投资者。如果投资者和托管人未在征询发出后的3个工作日内提出异议的，应视为同意上述自有资金参与和退出本集合计划的安排。若投资者不同意的，可于公告日至上述自有资金参与和退出本集合计划日（含）之间的退出开放日退出本集合计划。如上述期间内无退出开放日，则管理人将自有资金参与和退出本集合计划当日设置为临时退出开放日，保障投资者退出的权利。逾期未退出且未有意见答复的以及答复不同意但逾期未退出的投资者，均视为同意上述自有资金的参与和退出安排。</p> <p>为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金的参与、退出可不受前述比例和持有期限限制，管理人无需事先告知和征询投资者及托管人，但应及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>此处证券期货经营机构及其子公司自有资金的参与、退出并非其法定或者合同约定义务，不构成对自有资金参与、退出的承诺，证券期货经营机构及其子公司享有最终选择权。</p> |
| <p>第十一部分 资产管理计划的投资</p> <p>三、投资比例超限的处理方式及流程</p> | <p>除本合同另有约定外，因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日</p> | <p>除本合同另有约定外，因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十个交易日内调整至</p> |

| | | |
|-------------------------------------|---|---|
| | 内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的,资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。 | 符合相关要求,法律法规另有规定的按其规定。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的,资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。 |
| 第十一部分 资产管理计划的投资 三、投资比例超限的处理方式及流程 | 本合同终止前1个月为产品变现期间,管理人有权对资产管理计划财产所投资证券进行变现,由此造成投资比例、投资范围不符合投资政策规定的,视为变现期间被动超标,不属于管理人违反本合同的情形,不做另行调整安排。 | 删除 |
| 第十一部分 资产管理计划的投资 | | 增加 五、业绩比较基准 本集合计划不设置业绩比较基准。 |
| 第十一部分 资产管理计划的投资 六、本资产管理计划的投资策略 | 上述投资策略为管理人主要运用的投资策略,本集合计划投资策略包括但不限于上述策略。 投资主办人 可在本集合计划投资范围内,根据市场变动及自主判断采用其他投资策略。 | 上述投资策略为管理人主要运用的投资策略,本集合计划投资策略包括但不限于上述策略。 投资经理 可在本集合计划投资范围内,根据市场变动及自主判断采用其他投资策略。 |
| 第十一部分 资产管理计划的投资 七、投资限制 | 2、本计划投资于同一资产的资金,不得超过该计划资产净值的 25% ; 投资于单一信用债券的金额不得超过其债券发行总量的25%。 4. 本计划的总资产不得超过该计划净资产的 200% , 投资债券正回购资金余额或逆回购资金余额均不超过上一日净资产的100%。 5、除 短期融资券 以外的信用类债券(中期票据、企业债、公司债、次级债等)的债项评级在AA(含AA)以上;若无债项评级的,则主体评级应在AA(含AA)以上(本条所述评级均不含中债资信评级,本条投资限制 | 2、本计划投资于同一资产的资金,不得超过该计划资产净值的 22.5% ; 投资于单一信用债券的金额不得超过其债券发行总量的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 4. 本计划的总资产不得超过该计划净资产的 180% , 投资债券正回购资金余额或逆回购资金余额均不超过上一日净资产的100%。 5. 除 短期融资券及超短期融资券 以外的信用类债券(中期票据、企业债、公司债、次级债等)的债项评级在AA(含AA)以上;若无债项评级的,则主体评级应在AA(含AA) |

| | | |
|--------------------------------------|---|--|
| | <p>不含持仓标的发生评级下调情形);</p> <p>.....</p> <p>7. 不得投资于境内二级市场公开交易的股票或与其相关的证券投资基金; 不得投资于未上市企业股权和上市公司非公开发行或交易的股份;</p> | <p>以上 (本条所述评级均不含中债资信评级, 本条投资限制不含持仓标的发生评级下调情形);</p> <p>.....</p> <p>7. 不得投资于境内二级市场公开交易的股票以及股票型或混合型证券投资基金; 不得投资于未上市企业股权和上市公司非公开发行或交易的股份;</p> |
| <p>第十一部分 资产管理计划的投资</p> <p>七、投资限制</p> | | <p>增加</p> <p>9、若本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产 50%，则本计划的总资产不得超过其净资产的 120%。投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制;</p> |
| <p>第十一部分 资产管理计划的投资</p> | <p>八、本集合计划成立后建仓期为一个月。建仓期的投资活动,应当符合本资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的,投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</p> <p>在建仓期结束后,本资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。</p> <p>本计划到期终止或提前终止前 1 个月为本计划变现期,管理人在变现期内可安排对计划中未变现资产提前进行变现。由此造成投资比例、投资范围不符合投资比例及限制规定的,视为变现期间被动超标,不属于管理人违反本合同的情形,不做另行调整安排。</p> | <p>九、本集合计划成立后建仓期为一个月。建仓期的投资活动,应当符合本资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的,投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</p> <p>在建仓期结束后,本资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。</p> |

| | | |
|---|--|---|
| <p>第十一部分 资产管理计划的投资</p> <p>十、资产管理计划的特定风险</p> | <p>集合计划存续期间，为规避特定风险，经全体投资者同意后，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。</p> <p>“特定风险”主要指市场趋势性风险，例如，基于股市、债市、衍生品市场风险判断，调整资产配置比例。</p> | <p>投资者知晓并同意，集合计划存续期间，为规避特定风险，投资于固定收益类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。</p> <p>“特定风险”主要指市场趋势性风险，例如，基于股市、债市、衍生品市场风险判断，调整资产配置比例。</p> |
| <p>第十四部分 利益冲突及关联交易</p> | <p>一、在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定并严格遵守内外部管控要求的前提下，本产品可能投资于投资者、管理人、托管人及其关联方所发行、管理、保荐、托管、销售或存在其他法律关系或利益联系的金融产品，或者与该等金融产品以公平合理的价格进行交易，但投资者或托管人各自就其自身或其关联方另有限制并书面通知管理人的除外。投资者知悉并同意本计划从事上述关联交易。</p> <p>二、投资者同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及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。交易完成 5 个工作日内，管理人应通过管理人指定网站公告告知投资者和托管人，并向证券交易所、证券投资基金业协会以及中国证监会相关派出机构报告。并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护客户合法权益。</p> <p>三、投资者同意并授权管理人可以将集合计划的资产从事重大关联交易，管理人应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，有充分的证据证明未损害投资者利益，遵循投资者利益优先原则。交易完成 5 个工作日内，管理人应通过管理人指定网站公告告知投资者和托管人，并向证券交</p> | <p>一、关联方范围</p> <p>资产管理计划关联方包括：</p> <p>（一）管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方（关联方范围按照《企业会计准则》的规定确定）；</p> <p>（二）托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方（关联方范围按照《企业会计准则》的规定确定）；</p> <p>（三）法律法规、监管机构、行业协会规定的其他情形。</p> <p>管理人已在本计划资产管理合同附件中披露管理人关联方名单和托管人关联方名单，后续更新管理人的关联方以管理人官网公告为准，托管人关联方以托管人官网、年报或其他方式披露为准。</p> <p>二、资产管理计划存在的或可能存在的关联交易的情形，包括但不限于：</p> <p>（一）投资于资产管理计划关联方所设立的资产管理产品；</p> <p>（二）投资于资产管理计划关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>（三）资产管理计划与关联方开展交易；</p> <p>（四）法律法规、监管规定、自律规则等规定为关联交易的其他事项。</p> <p>三、重大关联交易和一般关联交易的界定</p> <p>资产管理计划的关联交易分为重大关联交易</p> |

易所、证券投资基金业协会以及中国证监会相关派出机构报告。并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护客户合法权益。

四、本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率

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

除前款规定外，证券期货经营机构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。

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

管理人与托管人应提供各自关联方名单，在合同期限内根据变化应及时更新关联方名单，并以书面形式告知。

和一般关联交易。

(一) 本计划重大关联交易包括但不限于：
1、将本计划的资产投资于上述关联交易情形金额在3,000万元人民币以上（不含本数）且超过资产管理产品总资产的20%；
2、有关法律法规、中国证监会、中国证券投资基金业协会等相关监管部门或自律组织规定的其他资产管理计划重大关联交易。

(二) 除重大关联交易之外的关联交易为一般关联交易。

四、利益冲突及关联交易内部控制机制

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

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

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

3、其他法律法规、监管规定及管理人内部管理制度规定的审批要求。

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

(二) 管理人明确要求不得以资产管理计划

的资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等法律、行政法规或中国证监会禁止的行为。

五、处理方式

- (一) 当管理人利益与投资者利益冲突时，以保护投资者利益为原则；
- (二) 当投资者之间利益冲突时，以公平对待为原则；

(三) 投资者同意，管理人可以将本计划的资产投资于本部分“三、重大关联交易和一般关联交易的界定”中属于管理人内部管控机制认定的一般关联交易，管理人进行一般关联交易后，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告；如属于管理人重大关联交易的，管理人应事先征询投资者意见。管理人应提前通过管理人网站公告的方式征询投资者。如果投资者未在公告发出后的3个工作日内提出异议的，应视为其同意该重大关联交易。投资者不同意的，可在公告发出后的3个工作日内提出退出申请，如上述期间无退出开放日，则管理人将公告发出后的第3个工作日设置为临时退出开放日；逾期未退出且未有意见答复的以及答复不同意但逾期未退出的投资者，均视为同意本次重大关联交易。管理人进行关联交易后，应事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

六、信息披露

(一) 披露方式

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

| | | |
|-------------------------|--|---|
| | | <p>(二) 披露内容</p> <p>资产管理人应当将本计划当期涉及的关联交易内容、关联方、处理方式等进行披露。</p> <p>(三) 披露频率</p> <p>资产管理人应当根据本合同“第二十三部分、信息披露与报告”的相关内容履行信息披露义务。发生关联交易的，管理人应充分证明未损害投资者利益，并应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>七、其他事项</p> <p>管理人、托管人应于合同生效前向对方提供关联方名单，并在该名单有变化时及时予以更新并明确告知对方。</p> <p>如法律法规、监管规定及自律规则等相关文件中，对一般、重大关联交易的分类标准及管控要求另有规定的，从其规定。</p> |
| <p>第十五部分 投资经理的指定与变更</p> | <p>一、资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。</p> <p>二、本计划的投资经理的资料如下： 本计划的投资经理由秦喜平先生担任。 秦喜平，毕业于厦门大学，金融工程硕士研究生，8年固定收益从业经历。先后在国联证券资产管理部、华宝兴业基金、长城证券资产管理部从事研究、交易和投资工作，现任西部证券股份有限公司上海证券资产管理分公司投资经理。 本计划投资经理无外部兼职、已具备证券从业资格和基金从业资格，近三年未有被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>三、资产管理人可以根据需要变更投资经理。管理人与托管人协商后变更投资经理。</p> | <p>一、资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。</p> <p>二、本计划的投资经理的资料如下： 本计划的投资经理由秦喜平先生、杨政祎先生担任。 秦喜平先生，毕业于厦门大学，金融工程硕士研究生，自2012年起从事固定收益业务。先后在国联证券资产管理部、华宝兴业基金、长城证券资产管理部从事研究、交易和投资工作，现任西部证券股份有限公司上海证券资产管理分公司投资经理。 杨政祎先生，上海财经大学金融硕士，自2014年起从事固定收益业务，曾任珠海农商行理财银行部债券配置岗、太平洋证券资产管理总部助理投资主办、云南国际信托债券投资</p> |

| | | |
|--|---|---|
| | <p>投资经理变更后,资产管理人应及时通知投资者,并及时书面通知销售机构。资产管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者通知的义务。投资经理发生变更时,原投资经理应当妥善保管投资业务资料,及时办理投资业务的移交手续,新投资经理或者临时投资经理应当及时接收。投资经理的选任与变更情况应报中国证监会/基金业协会备案。</p> | <p>经理、朝阳永续任基金研究员。2020年12月加入西部证券股份有限公司上海证券资产管理分公司,担任投资经理。</p> <p>本计划投资经理无外部兼职、已具备证券从业资格和基金从业资格,近三年未有被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>三、资产管理人可以根据需要变更投资经理。投资经理变更后,资产管理人应及时通知投资者,并及时通知销售机构。资产管理人应当于5日内在其网站上发布公告即视为履行了向投资者通知的义务。投资经理发生变更时,原投资经理应当妥善保管投资业务资料,及时办理投资业务的移交手续,新投资经理或者临时投资经理应当及时接收。</p> |
| <p>十八部分 越权交易的界定</p> <p>三、托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>(一)托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督:</p> <p>1. 对本计划以下投资范围进行监督:</p> | <p>本集合计划投资于现金、货币市场基金、银行存款、同业存单、债券回购、国债、央行票据、金融债、政策性金融债、公司债(包括非公开发行)、企业债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、资产支持证券优先级、短期融资券、超级短期融资券、中期票据(含非公开定向债务融资工具、如PPN、ABN等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具)、以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。</p> | <p>本集合计划投资于现金、货币市场基金、银行存款、同业存单、债券回购、国债、央行票据、金融债、政策性金融债、公司债(包括非公开发行)、企业债、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、资产支持证券优先级、短期融资券、超短期融资券、中期票据(含非公开定向债务融资工具、如PPN、ABN等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具)、以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。</p> |
| <p>第十八部分 越权交易的界定</p> <p>三、托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>(一)托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督:</p> <p>2、对本计划以下投资</p> | <p>(2) 本计划投资于同一资产的资金,不得超过该计划资产净值的25%;投资于单一信用债券的金额不得超过其债券发行总量的25%</p> <p>……</p> <p>4) 本计划的总资产不得超过该计划净资产的200%,投资债券正回购资金余额或逆回购资金余额均不超过上一日净资产的100%。</p> | <p>(2) 本计划投资于同一资产的资金,不得超过该计划资产净值的22.5%;投资于单一信用债券的金额不得超过其债券发行总量的25%,银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外;</p> <p>……</p> <p>4) 本计划的总资产不得超过该计划净资产的180%,投资债券正回购资金余额或逆回购资</p> |

| | | |
|--------------------------------------|---|---|
| 限制进行监督: | (5) 不得投资于境内二级市场公开交易的股票或与其相关的 证券投资基金 ;不得投资于未上市企业股权和上市公司非公开发行或交易的股份; | 金余额均不超过上一日净资产的100%。 (5) 不得投资于境内二级市场公开交易的股票以及 股票型或混合型证券投资基金 ;不得投资于未上市企业股权和上市公司非公开发行或交易的股份; |
| 第二十部分 资产管理 计划财产的估值和会计核算 一、估值目的 | …… 本集合计划单位净值是指集合计划资产净值除以计划总份额。本集合计划通过每日计算收益并分配的方式,使集合计划的单位净值保持在1.00元。 | 删除 |
| 第二十部分 资产管理 计划财产的估值和会计核算 三、估值方法 | 1、债券估值 (1) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值 净价 进行估值; (2) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值 净价 或推荐估值 净价 进行估值; (3) 交易所上市交易的可转换债券、实行全价交易的可交换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或债券发行机构发生影响债券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格; (4) 交易所上市实行净价交易的可交换债券,按估值日的收盘价估值;估值日无交易 | (一) 债券估值 1、交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值 全价 进行估值。 2、交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值 全价 或推荐估值 全价 进行估值。 3、对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券、可交换债券等有活跃市场的含转股权的债券,实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价;实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的,实行全价交易的债券选取最近交易日收盘价作为估值全价;实行净价交易的债券选取最近交易日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或债券发行机构发生影响债券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调 |

的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的,按最近交易日债券收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或债券发行机构发生影响债券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(5) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,管理人与托管人协商,并按相关法规的规定,谨慎确定公允价值,按最能反映公允价值的价格估值;

(6) 对于在上海证券交易所固定收益平台或者深圳证券交易所综合协议平台交易的债券,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值价格进行估值,若第三方估值机构未提供估值价格,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,管理人与托管人协商,并按相关法规的规定,谨慎确定公允价值,按最能反映公允价值的价格估值;

(7) 在对银行间市场的固定收益品种估值时,应主要依据**中债登公司公布的收益率曲线及估值价格估值**。对银行间市场未上市,且中债登公司未提供估值价格的固定收益品种,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,管理人与托管人协商,并按相关法规的规定,谨慎确定公允价值,按最能反映公允价值的价格估值;

(8) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券、资产支持票据和**私募债券**,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的

整最近交易市价,确定公允价格;对于非公开发行的可转债、可交换债,采用第三方估值机构提供的价格数据确定公允价值。若第三方估值机构未提供估值价格,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,管理人与托管人协商,并按相关法规的规定,谨慎确定公允价值,按最能反映公允价值的价格估值。

4、对于首次发行未上市债券采用第三方机构提供的估值价格确定公允价值;若第三方估值机构未提供估值价格,采用估值技术确定公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,管理人与托管人协商,并按相关法规的规定,谨慎确定公允价值,按最能反映公允价值的价格估值。

5、对于只在上海证券交易所固定收益平台或者深圳证券交易所综合协议平台交易的债券,选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值价格进行估值,若第三方估值机构未提供估值价格,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,管理人与托管人协商,并按相关法规的规定,谨慎确定公允价值,按最能反映公允价值的价格估值。

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

7、对在交易所市场挂牌转让的资产支持证

估值价格进行估值。若第三方估值机构未提供估值价格，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值；

(9) 非公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值；

(10) 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；

(11) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1) - (10)小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第(1) - (10)小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

2、债券逆(正)回购按首期实付金额作为成本列示，按合同利率扣除(增加)费用后在实际持有期间内逐日确定利息收入(利息支出)。有客观证据表明该证券回购资产的价值发生重大变化时，参考重大变化因素确定公允价值进行估值，应充分考虑其特点对信用风险的风险缓释作用，合理确认损失准备，对质押券的公允价值高于买入返售金融资产账面价值的**逆回购**，在计量预期信用损失时可认为违约损失率接近于零，在出现质

券、资产支持票据和**非公开发行债券**，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值价格进行估值。若第三方估值机构未提供估值价格，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值。

8、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

9、在任何情况下，资产管理人如采用本项第1-8小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第1-8小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

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

押券的公允价值不足以覆盖买入返售金融资产账面价值的情况时，计量预期信用损失，中国证券登记结算有限责任公司为中央对手方的债券质押式逆回购的情况除外。

3、银行存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入，应充分考虑其特点对信用风险的风险缓释作用，合理确认损失准备，对于提前支取利息不受损的定期存款和协议存款，参照活期存款，在计量预期信用损失时可认为违约损失率接近于零。如提前支取或利率发生变化，在知悉当日进行账务调整，不做追溯调整。

4、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值，若第三方估值机构未提供估值价格，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值。

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

6、本集合计划可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据，具体估值机构由管理人与托管人另行协商约定。

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

8、如有新增事项或变更事项，按国家最新

债券质押式逆回购，在计量预期信用损失时可认为预期信用损失率接近于零。

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

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

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

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

(七) 本集合计划可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据，具体估值机构由管理人与托管人另行协商约定。

(八) 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

| | | |
|---|--|---|
| | <p>规定估值。</p> <p>9、暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时，或因其他任何不可抗力（包括但不限于战争、自然灾害）致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。</p> | <p>计划资产公允价值的方法估值。如：银行间债券估值如遇特殊情况，由管理人和托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。</p> <p>（九）如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。</p> <p>（十）暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时，或因其他任何不可抗力（包括但不限于战争、自然灾害）致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。</p> |
| <p>第二十部分 资产管理计划财产的估值和会计核算</p> <p>五、估值程序</p> | <p>1、本集合计划为固定收益类产品，通过每日计算收益并分配的方式，使集合计划份额单位净值保持在面值人民币1元。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>2、集合计划管理人应于每个工作日对集合计划资产估值，计算每万份收益、七日年化收益率等结果，由集合计划托管人复核。集合计划管理人应于每个工作日结束后计算出当日的集合计划资产估值计算结果，并以双方约定的方式发送给集合计划托管人。集合计划托管人应在收到上述估值结果后对估值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给集合计划管理人；如果集合计划托管人的估值结果与集合计划管理人的估值结果存在差异，且双方经协商未能达成一致，集合计划管理人有权按照其对集合计划净值和每万份收益、七日年化收益率的计算结果对外予以公布，并向托管人就此事出具书面说明，集合计划托管人有权将相关情况报集合计划管理人住所地</p> | <p>（一）资产净值是指资产管理计划资产总值减去负债后的价值，资产管理计划份额净值等于计算日资产净值除以计算日资产管理计划份额总额。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；本计划份额净值的计算，保留到小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。由此产生的收益或损失由本计划财产承担。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>（二）管理人在每个交易日对计划财产进行估值，T日完成T日估值，估值原则应符合本合同及其他法律、法规的规定。管理人完成估值后，将估值结果以双方约定的方式发送托管人，资产托管人应在收到上述估值结果后对估值计算结果进行复核，并以双方约定的方式将复核结果传送给资管计划管理人。</p> <p>（三）本计划财产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。因此，就与本计划财产有关的会计问题，会计责任方是管理人。当资</p> |

| | | |
|--|---|--|
| | <p>中国证监会派出机构备案。</p> <p>3、集合计划的对账</p> <p>(1) 集合计划管理人和集合计划托管人在本集合计划成立后,应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则,分别独立地设置、登录和保管本集合计划的全套账册,对双方各自的账册定期进行核对,互相监督,以保证集合计划资产的安全。</p> <p>(2) 集合计划管理人按日编制集合计划估值表,与集合计划托管人核对,从而核对证券交易账目。集合计划托管人办理集合计划的资金收付、证券实物出入库所获得的凭证,由集合计划托管人保管原件并记账,集合计划管理人可通过查询电子回单的方式进行核实。集合计划管理人与集合计划托管人对集合计划账册每月核对一次。经对账发现双方的账目存在不符的,集合计划管理人和集合计划托管人应及时查明原因并纠正。</p> | <p>产管理人与资产托管人的估值结果不一致时,各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致意见,以管理人对本计划财产净值的计算结果为准,但托管人有权向监管部门报告。</p> |
| <p>第二十部分 资产管理</p> <p>计划财产的估值和会计核算</p> <p>九、资产管理计划份额净值的确认</p> | <p>计划财产净值和计划份额净值由管理人负责计算,管理人和托管人于【每日】按照双方约定的方式进行核对确认。</p> | <p>计划财产净值和计划份额净值由管理人负责计算,管理人和托管人于【每个交易日】按照双方约定的方式进行核对确认。</p> |
| <p>第二十部分 资产管理</p> <p>计划财产的估值和会计核算</p> <p>十、特殊情况的处理</p> | <p>(一) 管理人或托管人按估值方法的第5款进行估值时,所造成的误差不作为计划财产估值错误处理。</p> | <p>(一) 管理人或托管人按估值方法的第(八)款进行估值时,所造成的误差不作为计划财产估值错误处理。</p> |
| <p>第二十一部分 资产管理计划的费用与税收</p> <p>一、资产管理计划的费用种类</p> | <p>(七) 银行结算费用、开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费、注册登记机构收取的其他相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用。</p> | <p>(七) 银行结算费用、银行收取的询证函费、开户费、银行账户维护费、交易费、转托管费、注册登记机构收取的其他相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用。</p> |
| <p>第二十一部分 资产管</p> | | <p>新增</p> |

| | | |
|--|---|---|
| <p>理计划的费用与税收</p> <p>二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式</p> <p>(七) 费率的调整</p> | | <p>法律法规或监管规定对上述费用另有限制性要求等规定的，从其规定。</p> |
| <p>第二十二部分 资产管理计划的收益分</p> | <p>一、资产管理计划收益分配方案依据现行法律法规以及合同约定执行。</p> <p>二、可供分配利润的构成</p> <p>资产管理计划利润指计划投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入扣除相关费用后的余额。</p> <p>三、收益分配原则</p> <p>(一)本集合计划的每一份额享有同等收益分配权；</p> <p>(二)集合计划存续期间，T日参与的计划份额不享有当日分红权益，自下一工作日起享有分红权益；T日退出的计划份额享有当日分红权益，自下一工作日起不享有分红权益；</p> <p>(三)本集合计划的收益分配方式为红利再投资，“每日分配，按日支付”。本集合计划根据每日收益情况，以每万份收益为基准，以人民币元方式簿记，为投资者每日计算当日收益并全部分配，按日支付且结转为相应的集合计划份额，投资者可通过退出计划份额获得现金收益。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后2位。</p> <p>(四)法律、法规或中国证监会另有规定的，从其规定。</p> <p>四、收益分配的方式</p> <p>本集合计划按日计算并分配收益，支付给投资者若实际收益为负值，管理人将相应</p> | <p>一、资产管理计划收益分配方案依据现行法律法规以及合同约定执行。</p> <p>二、可供分配利润的构成</p> <p>资产管理计划利润指计划投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入扣除相关费用后的余额。</p> <p>本计划可供分配利润指截至收益分配基准日本计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。</p> <p>三、收益分配原则</p> <p>(一)本集合计划的每一份额享有同等收益分配权，本计划存续期内，本计划份额净值大于1.00元，且有可供分配利润时，管理人可根据投资运作情况决定是否向投资者分配收益，且分配后净值不得低于1.00元，每一计划份额享有同等分配权。具体分配方案、分配比例及收益分配时间以管理人公告为准；</p> <p>(二)集合计划存续期间，T日参与的计划份额不享有当日分红权益，自下一工作日起享有分红权益；T日退出的计划份额享有当日分红权益，自下一工作日起不享有分红权益；</p> <p>(三)本集合计划的收益分配方式原则上采用现金分红方式。</p> <p>(四)法律、法规或中国证监会另有规定的，从其规定。</p> |

| | | |
|--|---|---|
| | <p>缩减投资者份额。投资者可通过退出集合计划份额获得现金收益。管理人另行公告收益分配方案。管理人于每个交易日公告前一个交易日的每万份收益和七日年化收益率。若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个工作日，披露节假日期间的每万份收益和七日年化收益率，以及节假日后首个开放日的每万份收益和七日年化收益率。法律另有规定的，从其规定。</p> <p>每万份收益和七日年化收益率的计算公式如下：</p> <p>每万份收益 = (当日集合计划净收益 / 当日集合计划总份额) * 10000</p> $\text{七日年化收益率} = \left\{ \left[\prod_{i=1}^7 \left(1 + \frac{R_i}{10000} \right)^{\frac{365}{7}} \right] - 1 \right\} \times 100\%$ <p>其中，R_i 为最近第 i 个公历日 ($i=1, 2, \dots, 7$) 的集合计划的每万份收益。</p> <p>每万份收益的计算保留到小数点后 4 位，七日年化收益率的计算保留到小数点后 3 位。</p> <p>五、收益分配中发生的费用</p> <p>计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。</p> | <p>四、收益分配方案的确定与通知</p> <p>(一) 计划收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</p> <p>(二) 计划收益分配方案由管理人拟订，由托管人复核，通过管理人网站或推广机构通告投资者。</p> <p>五、收益分配的执行方式</p> <p>收益分配方案确定后，管理人依据具体方案的规定进行收益分配，托管人依据收益分配方案配合执行管理人收益分配划款指令。托管人仅依据合同约定及管理人指令，对收益分配方案中的收益范围、分配方式、分配金额等要素进行核对。若划至管理人、销售机构/推广机构 (管理人或销售机构/推广机构统一分配)，托管人对于收益分配方案的复核内容仅限于对收益分配的总金额进行复核，对于在不同投资者之间分配的金额、分配顺序不承担复核义务，托管人不对向受益人划转资金本息的及时性、准确性负责。</p> |
| <p>第二十三部分 信息披露与报告</p> <p>二、资产管理计划运作期间，管理人应向投资者披露以下信息</p> <p>(一) 净值报告</p> | <p>本集合计划通过每日计算收益并分配的方式，使集合计划份额单位净值保持在面值人民币 1.00 元。本集合计划存续期内，管理人在每个交易日向投资者披露经过托管人审核的上一交易日的集合计划每万份收益及七日年化收益率。</p> | <p>本计划每工作日向投资者披露前一工作日经托管人复核的计划份额净值。</p> |
| <p>第二十三部分 信息披露与报告</p> <p>二、资产管理计划运作</p> | <p>2. 年度报告内容应包括但不限于下列信息：</p> <p>(1) 管理人履职报告；</p> <p>(2) 托管人履职报告；</p> | <p>2. 年度报告内容应包括但不限于下列信息：</p> <p>(1) 管理人履职报告；</p> <p>(2) 托管人履职报告；</p> |

| | | |
|---|--|--|
| <p>期间，管理人应向投资者披露以下信息</p> <p>(二) 季度报告和年度报告</p> | <p>(3) 资产管理计划投资表现；</p> <p>(4) 资产管理计划投资组合报告；</p> <p>(5) 资产管理计划运用杠杆情况；</p> <p>(6) 资产管理计划财务会计报告；</p> <p>(7) 资产管理计划支付的管理费、托管费等费用的计提基准、计提方式和支付方式；</p> <p>(8) 资产管理计划投资收益分配情况；</p> <p>(9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；</p> <p>(10) 中国证监会规定的其他事项。</p> | <p>(3) 资产管理计划投资表现；</p> <p>(4) 资产管理计划投资组合报告；</p> <p>(5) 资产管理计划运用杠杆情况；</p> <p>(6) 资产管理计划财务会计报告；</p> <p>(7) 资产管理计划支付的管理费、托管费等费用的计提基准、计提方式和支付方式；</p> <p>(8) 资产管理计划投资收益分配情况；</p> <p>(9) 关联交易事项；</p> <p>(10) 投资经理变更等涉及投资者权益的重大事项；</p> <p>(11) 中国证监会规定的其他事项。</p> |
| <p>第二十三部分 信息披露与报告</p> <p>三、临时报告</p> | <p>发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向投资者披露。</p> | <p>发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项； 2. 集合计划终止和清算； 3. 合同的补充、修改与变更； 4. 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项； 5. 负责本集合计划的代理销售机构发生变更； 6. 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格； 7. 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责； 8. 管理人认为重大的其他事项。 |
| <p>第二十四部分 风险揭示</p> <p>一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：</p> <p>(一) 一般风险揭示</p> | | <p>增加</p> <p>10. 关联交易的风险</p> <p>(1) 重大关联交易风险</p> <p>本计划进行重大关联交易时，管理人应遵守法律法规、监管规定、行业自律组织要求、合同约定及管理人相关内控制度，保护投资</p> |

者的合法权益，但投资者仍有可能面临重大关联交易存在相关投资风险、未能取得预期效果等情况，导致投资者利益受到损害的风险。

另外，管理人从事重大关联交易的，会事先以公告形式通知全体投资者并征询投资者意见，可能存在投资者未及时查阅相关信息导致未及时反馈意见的风险，或发生因投资者未按照管理人通知中要求的时间和方式进行反馈、或反馈中意见表示不明确而被视为反馈了同意意见的情形，从而可能存在一定风险，请投资者充分关注。

(2) 一般关联交易风险

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

11. 提前终止风险

本计划存在提前终止风险，包括持续5个工作日投资者少于2人的情形，以及本资产管理合同约定的其他可提前终止的情形。

12. 其他风险

(1) 不可抗力风险

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，可能导致计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约、托管行违约等超出资产管理人

| | | |
|---|--|---|
| | | <p>自身直接控制能力之外的风险，可能导致投资者利益受损。</p> <p>(2) 交易执行风险</p> <p>根据交易所、登记机构等发布的交易申报、清算交收、资金前端控制等规则，本计划项下投资交易指令存在确认失败或无法有效执行的风险。</p> <p>(3) 操作或技术风险</p> <p>相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。</p> |
| <p>第二十四部分 风险揭示</p> <p>一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：</p> <p>(二) 特定风险揭示</p> | <p>6、收益不确定的风险</p> <p>本集合计划重点投资于高流动性资产，并可能持有较大比例的银行定期存款资产。当出现银行定期存款提前解付，本集合计划将丧失银行定期存款利息收入，仅获得同期银行活期存款利息，从而产生机会损失。同时，集合计划持有的债券在变现时，也存在买卖价差损失的可能。</p> <p>此外，本集合计划于每个交易日公告前一个交易日的每万份收益和七日年化收益率，此种收益分配和净值公布方式不代表承诺一定取得收益，当日“收益”也可能为负。例如：投资者于T日查询到的可退出份额为100万份（该份额实际上是前一交易日（T-1日）的份额）并于T日申请退出100万份，由于T日“收益”为负导致T日日终份额缩减为99.9万份，则实际退出份额为99.9万份。</p> <p>.....</p> <p>16. 本计划存在募集完成后未在中国证券投资基金业协会完成备案或者中国证券投</p> | <p>6、收益不确定的风险</p> <p>本集合计划重点投资于高流动性资产，并可能持有较大比例的银行定期存款资产。当出现银行定期存款提前解付，本集合计划将丧失银行定期存款利息收入，仅获得同期银行活期存款利息，从而产生机会损失。同时，集合计划持有的债券在变现时，也存在买卖价差损失的可能。</p> <p>.....</p> <p>16. 资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案的相关风险</p> <p>管理人应当在资产管理计划成立之日起五个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、资产缴付证明等材料报证券投资基金业协会备案。证券投资基金业协会按照法律、行政法规和中国证监会规定对证券期货经营机构资产管理计划实施备案管理和监测监控，本计划可能出现被要求整改的情形，可能导致本计划合同变更或提前终止，请投资者注意此风险。若计划出现不予备案情形，</p> |

| | | |
|---|--|--|
| | 资基金业协会不予备案情形,导致计划财产不能进行投资运作,甚至终止清算的风险。 | 可能导致本计划提前终止,请投资者注意此风险。 |
| <p>第二十四部分 风险揭示</p> <p>一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险,包括但不限于:</p> <p>(二) 特定风险揭示</p> | | <p>增加</p> <p>18、投资比例暂时不符合合同约定的风险 投资者知晓并同意,集合计划存续期间,为规避特定风险,投资于固定收益类资产的比例可以低于计划总资产80%,但不得持续6个月低于计划总资产80%。“特定风险”主要指市场趋势性风险,例如,基于股市、债市、衍生品市场风险判断,调整资产配置比例,从而产生一定的风险。</p> <p>本计划存续期间,因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素导致本计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的,管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十个交易日内调整至符合相关要求,法律法规另有规定的按其规定,从而产生一定的风险。</p> <p>19、预警、止损操作可能引起的特定风险 为保护投资者的利益,本计划设置预警、止损机制。在触及止损线,管理人对持仓进行变现处理时,由于投资的债券等资产估值可能持续向不利方向变动,或者由于所投资的债券等资产因流通受限无法及时变现,在此过程中可能给本集合计划带来损失,导致计划终止时的计划份额净值仍有可能远低于本资产管理计划的止损线,届时本计划委托财产面临全部或者部分损失的风险。</p> |
| <p>第二十四部分 风险揭示</p> <p>一、资产管理计划</p> | <p>(十一) 其他风险</p> <p>1. 关联交易风险</p> <p>本计划可能投资于管理人、托管人及其控股</p> | 删除 |

| | | |
|---|--|---|
| <p>投资将可能面临下列各项风险，包括但不限于：</p> | <p>股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销的证券，或者从事其他重大关联交易，存在关联交易风险。</p> <p>2. 不可抗力风险</p> <p>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，可能导致计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约、托管行违约等超出资产管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致投资者利益受损。</p> <p>3. 交易执行风险</p> <p>根据交易所、登记机构等发布的交易申报、清算交收、资金前端控制等规则，本计划项下投资交易指令存在确认失败或无法有效执行的风险。</p> <p>4. 操作或技术风险</p> <p>相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。</p> <p>5. 提前终止风险</p> <p>本计划存在提前终止风险，包括：</p> <p>（1）经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止；</p> <p>（2）当持有人大会（如有）决议提前终止资产管理合同，本计划可提前终止。</p> | |
| <p>第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>一、资产管理合同的变更</p> <p>（一）本计划存续期</p> | <p>1、因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的；</p> <p>2. 投资经理的变更；</p> <p>3. 资产管理计划认购或参与、非交易过户的原则、时间、业务规则等变更；</p> <p>4. 对资产管理合同的变更不涉及合同当事</p> | <p>1、因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的。</p> <p>管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。管理人有权作出上述</p> |

| | | |
|---------------------------------|---|--|
| <p>间, 存在以下情形的:</p> | <p>人权利义务关系发生重大变化, 且对投资者利益无实质性不利影响。</p> <p>管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同, 并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。管理人有权作出上述调整并及时在管理人网站公告, 无需另行征求投资者意见。投资者对变更后的内容有异议, 且在合同变更公告日起至合同变更生效日内无开放期的, 则管理人将合同变更生效日前的 1 个工作日设置为临时开放期, 接受投资者的退出申请。逾期未退出的投资者, 视为同意本合同变更。</p> | <p>调整并及时在管理人网站公告, 无需另行征求投资者意见。</p> |
| <p>第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> | | <p>增加:</p> <p>三、或有事项</p> <p>根据相关法律法规的规定, 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公司。投资者在此同意, 如果或有事件发生, 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上一条所述的从事资产管理业务的公司, 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投资者。管理人保障投资者退出本资产管理计划的权利, 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。</p> |
| <p>第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> | <p>三、管理人和托管人的更换</p> <p>当发生以下事项:</p> <p>(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</p> | <p>四、管理人和托管人的更换</p> <p>当发生以下事项:</p> <p>(一) 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</p> |

| | |
|--|---|
| <p>理计划由其他管理人承接；</p> <p>(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。</p> <p>管理人或承接管理人将及时公告上述变更具体事宜。变更生效之日，新的管理人或托管人将承接本合同约定的当事人的权利及义务。</p> <p>(3) 新管理人接收计划管理业务或新托管人接收计划财产和计划托管业务前，原管理人或原托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对投资者的利益造成损害的行为。</p> | <p>理计划由其他管理人承接；</p> <p>(二) 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。</p> <p>管理人或承接管理人将及时公告上述变更具体事宜。变更生效之日，新的管理人或托管人将承接本合同约定的当事人的权利及义务。</p> <p>(三) 管理人或托管人变更程序</p> <p>(1) 发生管理人、托管人变更的情形的，需在发生之日起6个月内完成变更程序，否则本集合计划终止；</p> <p>(2) 管理人或托管人变更需经过投资者同意。管理人应当通过管理人网站公告方式向投资者通知变更征询意见；投资者需在征询意见发出之日起5个工作日内向管理人做出是否同意回复。投资者不同意变更的，应在征询意见发出之日起5个工作日内向管理人提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见或意思表示不明确或未在征询意见发出之日起5个工作日内提出退出计划申请的，视为投资者同意管理人或托管人变更，不再接受投资者退出申请；</p> <p>(3) 管理人变更公告，应当在管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让生效后由新管理人通过指定的网站等方式向投资者公告；托管人变更公告，应当在托管人变更后，由新托管人通过网站公告方式告知投资者；</p> <p>(4) 管理人变更/托管人变更公告生效后，管理人应当与托管人重新签署资产管理合同，并将签署后的资产管理合同进行披露。</p> <p>(5) 对于不同意管理人或托管人变更的投资者，管理人应当在公告生效后5个工作日内设置开放期，为不同意变更的投资者办理强</p> |
|--|---|

| | | |
|--|---|---|
| | | <p>制退出；</p> <p>(6) 完成管理人或托管人变更工作后，管理人、托管人及变更后管理人、变更后托管人应当根据相关规定进行报备或报告（如需）。</p> <p>(四) 新管理人接收计划管理业务或新托管人接收计划财产和计划托管业务前，原管理人或原托管人应继续履行相关职责，并保证不做出对投资者的利益造成损害的行为。</p> |
| <p>第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>四、资产管理计划的展期</p> <p>(三) 展期的安排</p> | <p>5. 展期的实现</p> <p>如果同意计划展期的投资者人数不少于2人，则本计划存续期将依法展期；如果同意计划展期的各投资者人数低于2人，则本计划到期终止，管理人将按照本合同约定办理计划到期终止和清算事宜。</p> | <p>5. 展期的实现</p> <p>如果同意计划展期的投资者人数不少于2人且产品总资产不低于1000万元，则本计划存续期将依法展期；如果同意计划展期的各投资者人数低于2人或产品总资产低于1000万元，则本计划到期终止，管理人将按照本合同约定办理计划到期终止和清算事宜。</p> |
| <p>第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>五、资产管理计划终止的情形，包括但不限于下列事项：</p> | <p>(七) 未在基金业协会完成备案或不予备案的情形；</p> <p>(八) 法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。</p> | <p>(七) 在证券投资基金业协会备案时被要求整改导致本计划提前终止的情形；</p> <p>(八) 如因后续法律、法规、监管机构要求发生变更，导致交易系统不能继续使用且无法更换其他合适的交易系统，资管计划提前终止；</p> <p>(九) 法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。</p> |
| <p>第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>七、资产管理计划的清算</p> <p>(四) 资产管理计划财产清算及剩余资产的分配</p> | <p>3. 因持有流通受限证券及其他投资品种等原因导致本计划财产无法及时变现的，管理人应将已变现部分先行分配，并于本计划终止后对计划财产进行延期清算。清算期间不再计提管理费、托管费。待上述资产可以变现时，管理人应及时完成剩余可变现计划资产的变现操作后进行延期清算，并在扣除相关费用和业绩报酬（如有）后将该剩余财产分配给全体投资者。本计划持有多只流通受</p> | <p>3. 因持有流通受限证券及其他投资品种等原因导致本计划财产无法及时变现的，管理人应将已变现部分先行分配，并于本计划终止后对计划财产进行延期清算。清算期间将继续按合同约定提取管理费、托管费等相关费用及业绩报酬（如本合同已明确约定业绩报酬的收取）。待上述资产可以变现时，管理人应及时完成剩余可变现计划资产的变现操作</p> |

| | | |
|--|--|--|
| | <p>限的证券及其他投资产品的,管理人按本款约定进行多次变现及清算。管理人应在剩余计划财产变现并完成清算后3个工作日内向托管人发送指令,托管人按指令将剩余计划财产划至指定账户。</p> | <p>后进行延期清算,并在扣除相关费用和业绩报酬(如有)后将该剩余财产分配给全体投资者。本计划持有多只流通受限的证券及其他投资产品的,管理人按本款约定进行多次变现及清算。管理人应在剩余计划财产变现并完成清算后3个工作日内向托管人发送指令,托管人按指令将剩余计划财产划至指定账户。本计划财产仍无法变现的,管理人有权以计划财产现状方式向投资者返还。</p> |
| <p>第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算 七、资产管理计划的清算 (六)资产管理计划财产清算报告的告知安排</p> | <p>清算小组在本计划终止后20个工作日内编制计划财产清算报告,由管理人或销售机构按照投资者提供的联系方式或由管理人通过其公司网站告知投资者。投资者在此同意,上述报告不再另行审计,除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算结果报基金业协会备案,并抄报中国证监会相关派出机构。</p> | <p>清算小组在本计划终止后20个工作日内编制计划财产清算报告,由管理人或销售机构按照投资者提供的联系方式或由管理人通过其公司网站告知投资者。 管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算报告报基金业协会。</p> |
| <p>第二十六部分 违约责任</p> | <p>二、管理人、托管人及其他第三方机构在履行各自职责的过程中,因违反法律法规或者本合同约定,给计划财产或者投资者造成损害的,应按过错原则分别对各自的行为承担赔偿责任。</p> <p>发生下列情况的,当事人可以免责:</p> <p>(一)不可抗力;</p> <p>(二)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;</p> <p>(三)管理人由于按照本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;</p> | <p>二、管理人、托管人及其他第三方机构在履行各自职责的过程中,因违反法律法规或者本合同约定,给计划财产或者投资者造成损害的,应按过错原则分别对各自的行为承担赔偿责任。</p> <p>发生下列情况的,当事人可以免责:</p> <p>(一)不可抗力;</p> <p>(二)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;</p> <p>(三)管理人由于按照本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;</p> <p>(四)因投资者采信其他机构或人员作出的与本合同记载内容不符或相冲突的意思表示而造成的损失等;</p> |

| | | |
|------------------|-------------------|---|
| | | <p>(五) 管理人与销售机构(如有)为不同法律实体, 管理人不对销售机构因违法违规或不当销售行为而引起的损失承担责任。</p> <p>(六) 管理人不承担因投资者向管理人或销售机构提供虚假信息或证明材料而因此销售产品或提供服务的不利后果及责任。</p> <p>(七) 投资者因拒绝听取管理人或销售机构的建议等而认购或接受不适当产品、服务的, 管理人不承担由此产生的责任及损失。</p> <p>(八) 托管人对于存放在托管行之外的委托财产的任何损失, 及基于从第三方机构合法获得的信息(包括但不限于证券交易所、期货交易所等)合法获得的信息及合理信赖上述信息而操作等导致的委托财产的任何损失都应是免责的。</p> |
| 第二十八部分 资产管理合同的效力 | 三、本合同的有效期限为【10】年。 | 三、本计划终止, 本合同终止。但合同项下的费用及税收条款、清算条款、违约责任条款、争议解决条款、保密条款仍然有效。 |
| 第二十九部分 其他事项 | | <p>新增:</p> <p>五、合同其他方签署本合同即视为知悉/授权托管人可为订立、履行个人作为一方当事人的合同所必需或为履行法定职责或者法定义务所必需而处理个人信息; 托管人承诺对上述个人信息的处理合法合规, 其他方亦已知悉其享有《个人信息保护法》项下所有相关权利。如果个人信息系由一方向另一方提供的, 该方承诺已告知并获得相关个人同意向另一方提供个人信息, 且个人已知晓个人信息的使用用途。</p> |
| 附件五 | 更新管理人关联方名单 | |
| 附件六 | 更新托管人关联方名单 | |
| 附件七 | 新增《风险揭示书》作为附件 | |

二、合同变更具体流程

管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告，合同变更内容应当及时在管理人网站通告投资者。如果投资者未在通告发出后的3日内提出异议的，应视为其同意管理人对本合同做出变更。投资者不同意管理人对合同进行变更的，可在公告日起至合同变更生效日内的开放日提出退出申请，如在公告日起至合同变更生效日内无开放期，则管理人将合同变更生效日前的2个工作日设置为临时开放期；逾期未退出且未有意见答复的以及答复不同意合同变更但逾期未退出的投资者，均视为同意本合同变更。

合同变更生效后，管理人按监管规定，将合同变更事宜报中国证券投资基金业协会备案。

特致此函，请贵行确认。



关于《关于西部证券安心2号集合资产管理计划资产管理合同变更意见征询函》的回函

西部证券股份有限公司：

贵司《关于西部证券安心2号集合资产管理计划资产管理合同变更意见征询函》已收悉。经研究，我司对贵司《关于西部证券安心2号集合资产管理计划资产管理合同变更意见征询函》所列事项无异议。请贵司依据法律法规履行相关的报备和信息披露义务。

特此函复。

兴业银行股份有限公司

