

《东方财富证券致盈1号集合资产管理计划资产管理合同》

合同变更及征询公告

尊敬的投资者：

由东方财富证券股份有限公司（以下简称“我公司”）担任管理人、宁波银行股份有限公司担任托管人的东方财富证券致盈1号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）自成立以来，坚持规范运作，稳健运营。根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令〔第203号〕）《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2023〕2号）相关监管精神以及资产管理计划资管合同中相关条款规定，我公司拟对《东方财富证券致盈1号集合资产管理计划资产管理合同》进行变更，具体变更内容见附件《东方财富证券致盈1号集合资产管理计划资产管理合同变更对照表》。

根据《东方财富证券致盈1号集合资产管理计划资产管理合同》第二十四章第（一）款“资产管理合同的变更”相关约定，我公司与托管人已对资产管理合同变更内容协商一致，现对合同变更内容向全体投资者公告。

本次变更内容包括提前终止观察日、投资范围、投资比例、投资限制，并且根据前述变更，新增相应的估值方法、风险揭示等相关条款，请投资者充分知悉。

管理人特别提示，本次变更将对本计划的估值程序、退出的程序及确认等带来一定影响，请投资者了解，并自愿承担因修改事项带来的风险。

本次变更内容将于2024年1月19日起生效。投资者对合同变更内容有异议的，可在本合同变更生效前的最近一次退出开放日（即2024年1月18日）申请退出本计划。

投资者可通过本公司官网（www.18.cn）或本集合计划推广营业部网点了解本次公告情况。如有任何疑问，请咨询本集合计划推广机构网点工作人员。

衷心感谢您一直以来对我司产品的大力支持。

特此公告。



附件：《东方财富证券致盈1号集合资产管理计划资产管理合同变更对照表》

东方财富证券致盈 1 号集合资产管理计划

资产管理合同变更对照表

根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令〔第 203 号〕）《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2023〕2 号）相关监管精神以及资产管理计划资管合同中相关条款规定，《东方财富证券致盈 1 号集合资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》）本次合同变更内容对照如下：

1、对《资产管理合同》项下第二章“释义”的“提前终止观察日”作如下变更：

变更前	变更后
提前终止观察日：本计划设置提前终止观察日，自本计划投资起始运作日后第 3 个月开始，每月设置一个，原则上为本计划投资起始运作日满 i 个月（ $i=3, 4, 5, \dots, 60$ ）之对日的前一个交易日（如该日为法定节假日、发生市场中断事件或/及暂停估值等情形，则顺延至下一交易日，并由管理人届时公告；如该日临近法定长假或遇其他特殊情形，管理人也可将该日附近的另一个交易日确定为提前终止观察日，并予以公告），对应称做第 i 个月提前终止观察日，具体日期由资产管理人于投资起始运作日后 2 个工作日内、开放期后 2 个工作日内在资产管理人网站公告下一开放日前的提前终止观察日，投资者应自行查阅。资产管理人在管理人网站上发布了相关信息，即视为资产管理人履行了本合同约定的信息披露义务。	提前终止观察日：本计划设置提前终止观察日，自本计划投资起始运作日后第 3 个月开始，每月设置一个，原则上为本计划投资起始运作日满 i 个月（ $i=3, 4, 5, \dots, 60$ ）之对日的前一个为周五的交易日（如该日为法定节假日、发生市场中断事件或/及暂停估值等情形，则顺延至下一交易日，并由管理人届时公告；如该日临近法定长假或遇其他特殊情形，管理人也可将该日附近的另一个交易日确定为提前终止观察日，并予以公告），对应称做第 i 个月提前终止观察日，具体日期由资产管理人于投资起始运作日后 2 个工作日内、开放期后 2 个工作日内在资产管理人网站公告下一开放日前的提前终止观察日，投资者应自行查阅。资产管理人在管理人网站上发布了相关信息，即视为资产管理人履行了本合同约定的信息披露义务。

2、对《资产管理合同》项下第四章“当事人及权利义务”第（一）款第 3 条“托管人”作如下变更：

变更前	变更后
3、托管人 托管人名称：宁波银行股份有限公司 法定代表人：陆华裕 住所：中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号 通讯地址：中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号 邮政编码：315042 联系人：徐银央 联系电话：0574-83895886	3、托管人 托管人名称：宁波银行股份有限公司 法定代表人：陆华裕 住所：中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号 通讯地址：中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号 邮政编码：315042 联系人：胡银杰 联系电话：0574-83895886

3、对《资产管理合同》项下第五章“资产管理计划的基本情况”第（四）款第 2 条“主要

投资方向”、第3条“投资比例”作如下变更:

变更前	变更后
<p>2、主要投资方向</p> <p>(1)现金类资产:包括现金、银行存款;</p> <p>(2)固定收益类资产:包括货币市场基金、同业存单、国内依法发行的国债、地方政府债、政策性金融债、中央银行票据、债券逆回购;</p> <p>(3)权益类资产:包括在国务院同意设立的交易场所交易的上市公司股票;</p> <p>(4)商品及金融衍生品类资产:在证券/期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的标准化商品及金融衍生品类资产,包括国债期货、股指期货、商品期货、商品期权、在交易所上市的股票期权(含ETF期权)和股指期权;</p> <p>(5)资产管理产品:公开募集证券投资基金(含ETF、LOF、QDII)。</p>	<p>2、主要投资方向</p> <p>(1)现金类资产:包括现金、银行存款;</p> <p>(2)固定收益类资产:包括货币市场基金、同业存单、国内依法发行的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债(含次级债、混合资本债、政策性金融债、无固定期限资本债券、保险公司资本补充债券)、二级资本工具、国际开发机构债、外国主权政府人民币债券、永续债、公司债(含面向公众投资者的公开发行的公司债券、面向合格投资者的公开发行的公司债券、非公开发行的公司债券)、企业债(含非公开发行、项目收益债券)、资产支持证券(ABS)、资产支持票据(ABN)、可转债、可交换债、债券逆回购(含质押式回购、质押式协议回购、买断式回购)、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、标准化票据、非公开定向债务融资工具;</p> <p>(3)权益类资产:包括在依法设立的交易场所交易的上市公司股票;</p> <p>(4)期货和衍生品类资产:在证券/期货交易所等依法设立的交易场所集中交易清算的标准化期货和衍生品类资产,包括国债期货、股指期货、商品期货、商品期权、在交易所上市的股票期权(含ETF期权)和股指期权;</p> <p>(5)资产管理产品:包括公开募集证券投资基金(含ETF、LOF、QDII、对标公募基金完成整改并取得确认函的存量证券公司大集合产品)、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、银行理财产品、资金信托计划、基金公司及其子公司发行的资产管理计划、证券公司及其子公司发行的资产管理计划、期货公司及其子公司发行的资产管理计划、保险资产管理机构发行的保险资产管理产品;</p> <p>(6)债券正回购(含质押式回购、质押式协议回购、买断式回购)。</p> <p>本计划投资范围包含私募资产管理产品,但是前述私募资产管理产品穿透后不包含非标准化资产,请投资者详细阅读相关风</p>

	<p>险揭示。</p> <p>本计划投资范围包含债券回购，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险，请投资者注意。</p>
<p>3、投资比例</p> <p>(1) 穿透后投资于固定收益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%；</p> <p>(2) 穿透后投资于权益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%；</p> <p>(3) 穿透后投资于商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值的比例不超过本计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%；</p> <p>(4) 本计划的总资产不得超过净资产的 200%；本计划投资于资产管理产品的，计算本计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。</p>	<p>3、投资比例</p> <p>(1) 穿透后投资于固定收益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%；</p> <p>(2) 穿透后投资于权益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%；</p> <p>(3) 穿透后投资于期货和衍生品类资产的持仓合约价值的比例不超过本计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%；</p> <p>(4) 本计划的总资产不得超过净资产的 200%；本计划投资于资产管理产品的，计算本计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产；</p> <p>(5) 本计划投资于私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合《管理办法》及中国证监会相关规定；</p> <p>(6) 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本计划净资产 50%，本计划的总资产不得超过本计划净资产的 120%；本计划投资于国债、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。</p>

4、对《资产管理合同》项下第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”第(二)款“资产管理计划的退出”第3条第(2)、(3)点作如下变更：

变更前	变更后
<p>(2) 退出申请的确认</p> <p>销售机构在 T 日规定时间受理的投资者申请，正常情况下管理人在 T+2 日内对该申请的有效性进行确认。投资者在 T+3 日后（包括该日）可向集合计划销售机构查询退出的成交情况。</p>	<p>(2) 退出申请的确认</p> <p>销售机构在 T 日规定时间受理的投资者申请，正常情况下管理人在 T+3 日内对该申请的有效性进行确认。投资者在 T+4 日后（包括该日）可向集合计划销售机构查询退出的成交情况。</p>
<p>(3) 退出款项划付</p> <p>集合计划退出的登记结算将按照注册与过户登记人（中国证券登记结算有限责任公司）的有关规定办理。</p> <p>若确认投资者退出申请成功，集合计划管理人应指示集合计划托管人于 T+5 日内将退出款项从集合计划托管专户划出。销售</p>	<p>(3) 退出款项划付</p> <p>集合计划退出的登记结算将按照注册与过户登记人的有关规定办理。</p> <p>若确认投资者退出申请成功，集合计划管理人应指示集合计划托管人于 T+15 日内将退出款项从集合计划托管专户划出。销售机构收到退出款后于五个工作日内划往退</p>

机构收到退出款后于五个工作日内划往退出投资者指定的银行账户。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定办理。	出投资者指定的银行账户。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定办理。
--	--

5、对《资产管理合同》项下第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”第（二）款“资产管理计划的退出”第6条第（2）点作如下变更：

变更前	变更后
若确认投资者退出申请成功，集合计划管理人应指示集合计划托管人于 T+5 日内将退出款项从集合计划托管专户划出。	若确认投资者退出申请成功，集合计划管理人应指示集合计划托管人于 T+15 日内将退出款项从集合计划托管专户划出。

6、对《资产管理合同》项下第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”第（二）款“资产管理计划的退出”第7条第（2）点作如下变更：

变更前	变更后
若确认投资者退出申请成功，集合计划管理人应指示集合计划托管人于 T+5 日内将退出款项从集合计划托管专户划出。销售机构收到退出款后于五个工作日内划往退出投资者指定的银行账户。	若确认投资者退出申请成功，集合计划管理人应指示集合计划托管人于 T+15 日内将退出款项从集合计划托管专户划出。销售机构收到退出款后于五个工作日内划往退出投资者指定的银行账户。

7、对《资产管理合同》项下第十一章“资产管理计划的投资”第（二）款第1条“投资范围”及第2条“投资比例”作如下变更：

变更前	变更后
<p>1、投资范围</p> <p>(1) 现金类资产：包括现金、银行存款；</p> <p>(2) 固定收益类资产：包括货币市场基金、同业存单、国内依法发行的国债、地方政府债、政策性金融债、中央银行票据、债券逆回购；</p> <p>(3) 权益类资产：包括在国务院同意设立的交易场所交易的上市公司股票；</p> <p>(4) 商品及金融衍生品类资产：在证券/期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的标准化商品及金融衍生品类资产，包括国债期货、股指期货、商品期货、商品期权、在交易所上市的股票期权（含ETF期权）和股指期货；</p> <p>(5) 资产管理产品：公开募集证券投资基金（含ETF、LOF、QDII）。</p>	<p>1、投资范围</p> <p>(1) 现金类资产：包括现金、银行存款；</p> <p>(2) 固定收益类资产：包括货币市场基金、同业存单、国内依法发行的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债（含次级债、混合资本债、政策性金融债、无固定期限资本债券、保险公司资本补充债券）、二级资本工具、国际开发机构债、外国主权政府人民币债券、永续债、公司债（含面向公众投资者的公开发行的公司债券、面向合格投资者的公开发行的公司债券、非公开发行的公司债券）、企业债（含非公开发行、项目收益债券）、资产支持证券（ABS）、资产支持票据（ABN）、可转债、可交换债、债券逆回购（含质押式回购、质押式协议回购、买断式回购）、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、标准化票据、非公开定向债务融资工具；</p> <p>(3) 权益类资产：包括在依法设立的交易场所交易的上市公司股票；</p>

	<p>(4) 期货和衍生品类资产：在证券/期货交易所等依法设立的交易场所集中交易清算的标准化期货和衍生品类资产，包括国债期货、股指期货、商品期货、商品期权、在交易所上市的股票期权（含 ETF 期权）和股指期货；</p> <p>(5) 资产管理产品：包括公开募集证券投资基金（含 ETF、LOF、QDII、对标公募基金完成整改并取得确认函的存量证券公司大集合产品）、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、银行理财产品、资金信托计划、基金公司及其子公司发行的资产管理计划、证券公司及其子公司发行的资产管理计划、期货公司及其子公司发行的资产管理计划、保险资产管理机构发行的保险资产管理产品；</p> <p>(6) 债券正回购（含质押式回购、质押式协议回购、买断式回购）。</p> <p>本计划投资范围包含私募资产管理产品，但是前述私募资产管理产品穿透后不包含非标准化资产，请投资者仔细阅读相关风险揭示。</p> <p>本计划投资范围包含债券回购，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险，请投资者注意。</p>
<p>2、投资比例</p> <p>(1) 穿透后投资于固定收益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%；</p> <p>(2) 穿透后投资于权益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%</p> <p>(3) 穿透后投资于商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值的比例不超过本计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%；</p> <p>(4) 本计划的总资产不得超过净资产的 200%；本计划投资于资产管理产品的，计算本计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。</p>	<p>2、投资比例</p> <p>(1) 穿透后投资于固定收益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%；</p> <p>(2) 穿透后投资于权益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%；</p> <p>(3) 穿透后投资于期货和衍生品类资产的持仓合约价值的比例不超过本计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%；</p> <p>(4) 本计划的总资产不得超过净资产的 200%；本计划投资于资产管理产品的，计算本计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产；</p> <p>(5) 本计划投资于私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合《管理办法》及中国证监会相关规定；</p> <p>(6) 若本计划投资于同一发行人及其</p>

	关联方发行的债券的比例超过本计划净资产 50%，本计划的总资产不得超过本计划净资产的 120%；本计划投资于国债、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。
--	---

8、对《资产管理合同》项下第十一章“资产管理计划的投资”第（四）款“投资限制”作如下变更：

变更前	变更后
<p>（四）投资限制</p> <p>1、本计划投资于同一资产的资金，不超过本集合计划资产净值的 25%，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>2、管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；</p> <p>3、法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。</p>	<p>（四）投资限制</p> <p>1、本计划投资于同一资产的资金，不超过本集合计划资产净值的 25%，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>2、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，不超过该资产的 25%，银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；</p> <p>3、本计划可投资债券正回购或债券逆回购，债券正回购资金余额或逆回购资金余额均不得超过其上一日净资产的 100%；</p> <p>4、本计划参与债券、可转债、可交债等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过计划的总资产，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；</p> <p>5、本计划不得投资资产支持证券（ABS）劣后级、资产支持票据（ABN）劣后级；本计划只投资于交易所挂牌交易的 ABS 品种，不得投资于底层资产包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权的 ABS 品种；</p> <p>6、本计划不投资任何资产管理产品劣后级；</p> <p>7、本计划及本计划投资的资产管理产品不得投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产；</p> <p>8、本计划须遵守《指导意见》第二十二条关于嵌套的规定：当投资者为本合同第三章第三条中约定的自有资金时，本计划可以投资除公募基金以外的其他资产管理产品，但所投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品；当投资者为本合同第三章第三条中约定的非自有资金</p>

	<p>时，本计划投资者向上穿透不得接受除公募基金以外的其他资产管理产品的投资，且本计划不得投资除公募基金以外的其他资产管理产品（公募基金包括已经对标公募基金完成整改并取得确认函的存量证券公司大集合产品）；</p> <p>9、法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。</p>
--	--

9、对《资产管理合同》项下第十一章“资产管理计划的投资”第（五）款“禁止行为”作如下变更：

变更前	变更后
<p>（五）禁止行为</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、违规将资产管理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、将资产管理计划资产用于可能承担无限责任的投资； 3、直接投资于商业银行信贷资产； 4、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； 5、直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域； 6、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； 7、挪用资产管理计划资产； 8、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营； 9、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额； 10、使用资产管理计划资产进行不必要的交易； 11、将资产管理计划资产投资于管理人管理的其他资产管理计划； 12、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； 13、直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于：（1）投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录；（2）投资项目违反国家环境保护政策要求；（3）通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目； 	<p>（五）禁止行为</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、违规将资产管理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、将资产管理计划资产用于可能承担无限责任的投资； 3、直接投资于商业银行信贷资产； 4、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； 5、直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域； 6、向投资者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； 7、挪用资产管理计划资产； 8、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营； 9、接受单一投资者参与资金低于中国证监会规定的最低限额； 10、使用资产管理计划资产进行不必要的交易； 11、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； 12、直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于：（1）投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录；（2）投资项目违反国家环境保护政策要求；（3）通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目； 13、为其他机构、个人或者资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求

<p>14、为其他机构、个人或者资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道服务；</p> <p>15、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>	<p>的通道服务；</p> <p>14、投资涉及直接或间接为房地产企业提供融资的非标准化资产；</p> <p>15、通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、托管人、投资顾问（如有）及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；</p> <p>16、为违规持有金融机构股权提供便利；</p> <p>17、通过投资其他资产管理产品变相扩大投资范围或者规避监管要求；</p> <p>18、从事或者变相从事信贷业务，或者直接投向信贷资产，中国证监会、协会另有规定的除外；</p> <p>19、通过委托贷款、信托贷款等方式从事经营性民间借贷活动；</p> <p>20、通过设置无条件刚性回购安排变相从事借贷活动，产品投资收益不与投资标的的经营业绩或者收益挂钩；</p> <p>21、投向保理资产、融资租赁资产、典当资产等与资产管理相冲突的资产及其收（受）益权，以及投向从事前述业务的公司的股权；</p> <p>22、投向国家禁止或者限制投资的项目，不符合国家产业政策、环境保护政策、土地管理政策的项目；</p> <p>23、通过地方金融资产交易所等平台，投资不符合要求的非标准化债权资产；</p> <p>24、开展借贷、担保、明股实债等投资活动，中国证监会、协会另有规定的除外；</p> <p>25、通过投资公司、合伙企业、资产管理产品等方式间接从事或者变相从事前述第 18 款至第 24 款规定的活动；</p> <p>26、法律、行政法规、中国证监会、协会禁止的其他行为或者活动。</p>
--	--

10、对《资产管理合同》项下第十一章“资产管理计划的投资”第（八）款“投资策略”第 3 条“投资管理的方法和标准”作如下变更：

变更前	变更后
<p>提前终止观察日为本计划投资起始运作日满 i 个月 ($i=3, 4, 5, \dots, 60$) 之对日的前一个交易日，对应称做第 i 个月提前终止观察日，具体日期由资产管理人于投资起</p>	<p>提前终止观察日为本计划投资起始运作日满 i 个月 ($i=3, 4, 5, \dots, 60$) 之对日的前一个为周五的交易日，对应称做第 i 个月提前终止观察日，具体日期由资产管理人</p>

始运作日后 2 个工作日内、开放期后 2 个工作日内在资产管理人网站公告下一开放日前的提前终止观察日，投资者应自行查阅。资产管理人在管理人网站上发布了相关信息，即视为资产管理人履行了本合同约定的信息披露义务。	于投资起始运作日后 2 个工作日内、开放期后 2 个工作日内在资产管理人网站公告下一开放日前的提前终止观察日，投资者应自行查阅。资产管理人在管理人网站上发布了相关信息，即视为资产管理人履行了本合同约定的信息披露义务。
--	--

11、对《资产管理合同》项下第十八章“越权交易的界定”第（三）款第 1 条第（1）点“投资范围”、第（2）点“投资比例”作如下变更：

变更前	变更后
<p>(1) 投资范围</p> <p>1) 现金类资产：包括现金、银行存款；</p> <p>2) 固定收益类资产：包括货币市场基金、同业存单、国内依法发行的国债、地方政府债、政策性金融债、中央银行票据、债券逆回购；</p> <p>3) 权益类资产：包括在国务院同意设立的交易场所交易的上市公司股票；</p> <p>4) 商品及金融衍生品类资产：在证券/期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的标准化商品及金融衍生品类资产，包括国债期货、股指期货、商品期货、商品期权、在交易所上市的股票期权（含 ETF 期权）和股指期权；</p> <p>5) 资产管理产品：公开募集证券投资基金（含 ETF、LOF、QDII）。</p>	<p>(1) 投资范围</p> <p>1) 现金类资产：包括现金、银行存款；</p> <p>2) 固定收益类资产：包括货币市场基金、同业存单、国内依法发行的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债（含次级债、混合资本债、政策性金融债、无固定期限资本债券、保险公司资本补充债券）、二级资本工具、国际开发机构债、外国主权政府人民币债券、永续债、公司债（含面向公众投资者的公开发行的公司债券、面向合格投资者的公开发行的公司债券、非公开发行的公司债券）、企业债（含非公开发行、项目收益债券）、资产支持证券（ABS）、资产支持票据（ABN）、可转债、可交换债、债券逆回购（含质押式回购、质押式协议回购、买断式回购）、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、标准化票据、非公开定向债务融资工具；</p> <p>3) 权益类资产：包括在依法设立的交易场所交易的上市公司股票；</p> <p>4) 期货和衍生品类资产：在证券/期货交易所等依法设立的交易场所集中交易清算的标准化期货和衍生品类资产，包括国债期货、股指期货、商品期货、商品期权、在交易所上市的股票期权（含 ETF 期权）和股指期权；</p> <p>5) 资产管理产品：包括公开募集证券投资基金（含 ETF、LOF、QDII、对标公募基金完成整改并取得确认函的存量证券公司大集合产品）、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、银行理财产品、资金信托计划、基金公司及其子公司发行的资产管理计划、证券公司及其子公司发行的资产管理计划、期</p>

	<p>货公司及其子公司发行的资产管理计划、保险资产管理机构发行的保险资产管理产品；</p> <p>6) 债券正回购(含质押式回购、质押式协议回购、买断式回购)。</p>
<p>(2) 投资比例</p> <p>1) 穿透后投资于固定收益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%；</p> <p>2) 穿透后投资于权益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%；</p> <p>3) 穿透后投资于商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值的比例不超过本计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%；</p> <p>4) 本计划的总资产不得超过净资产的 200%；本计划投资于资产管理产品的，计算本计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。</p>	<p>(2) 投资比例</p> <p>1) 穿透后投资于固定收益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%；</p> <p>2) 穿透后投资于权益类资产的比例不超过本计划总资产的 80%；</p> <p>3) 穿透后投资于期货和衍生品类资产的持仓合约价值的比例不超过本计划总资产的 80%，或衍生品账户权益不超过本计划总资产的 20%；</p> <p>4) 本计划的总资产不得超过净资产的 200%；本计划投资于资产管理产品的，计算本计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产；</p> <p>5) 本计划投资于私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合《管理办法》及中国证监会相关规定；</p> <p>6) 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本计划净资产 50%，本计划的总资产不得超过本计划净资产的 120%；本计划投资于国债、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。</p>

12、对《资产管理合同》项下第十八章“越权交易的界定”第(三)款第2条“投资限制”作如下变更：

变更前	变更后
<p>2、投资限制</p> <p>(1)本计划投资于同一资产的资金，不超过本集合计划资产净值的 25%，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>(2) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。</p>	<p>2、投资限制</p> <p>(1)本计划投资于同一资产的资金，不超过本集合计划资产净值的 25%，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>(2) 本计划可投资债券正回购或债券逆回购，债券正回购资金余额或逆回购资金余额均不得超过其上一日净资产的 100%；</p> <p>(3) 本计划参与债券、可转债、可交债等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过计划的总资产，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；</p>

	<p>(4) 本计划及本计划投资的资产管理产品不得投资于《管理办法》第三十八条第(五)项规定的非标准化资产;</p> <p>(5) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。</p>
--	--

13、对《资产管理合同》项下第十八章“越权交易的界定”第(三)款第3条“禁止行为”作如下变更:

变更前	变更后
<p>3、禁止行为</p> <p>(1) 违规将资产管理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;</p> <p>(2) 将资产管理计划资产用于可能承担无限责任的投资;</p> <p>(3) 直接投资于商业银行信贷资产;</p> <p>(4) 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;</p> <p>(5) 直接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域;</p> <p>(6) 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;</p> <p>(7) 挪用资产管理计划资产;</p> <p>(8) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营;</p> <p>(9) 使用资产管理计划资产进行不必要的交易;</p> <p>(10) 将资产管理计划资产投资于管理人管理的其他资产管理计划;</p> <p>(11) 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;</p> <p>(12) 为其他机构、个人或者资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道服务;</p> <p>(13) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。</p> <p>投资范围或投资限制变更,管理人应以书面形式通知托管人,并应与托管人重新协商调整投资监督事项。</p>	<p>3、禁止行为</p> <p>(1) 违规将资产管理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;</p> <p>(2) 将资产管理计划资产用于可能承担无限责任的投资;</p> <p>(3) 直接投资于商业银行信贷资产;</p> <p>(4) 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;</p> <p>(5) 直接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域;</p> <p>(6) 向投资者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;</p> <p>(7) 挪用资产管理计划资产;</p> <p>(8) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营;</p> <p>(9) 接受单一投资者参与资金低于中国证监会规定的最低限额;</p> <p>(10) 使用资产管理计划资产进行不必要的交易;</p> <p>(11) 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;</p> <p>(12) 为其他机构、个人或者资产管理产品提供规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道服务;</p> <p>(13) 通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式,违规为管理人、托管人、投资顾问(如有)及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资;</p> <p>(14) 为违规持有金融机构股权提供便利;</p> <p>(15) 通过投资其他资产管理产品变相</p>

	<p>扩大投资范围或者规避监管要求；</p> <p>(16) 通过委托贷款、信托贷款等方式从事经营性民间借贷活动；</p> <p>(17) 投向国家禁止或者限制投资的项目，不符合国家产业政策、环境保护政策、土地管理政策的项目；</p> <p>(18) 法律、行政法规、中国证监会、协会禁止的其他行为或者活动。</p>
--	--

14、对《资产管理合同》项下第十九章“资产管理计划财产的估值和会计核算”第（四）款“估值方法”作如下变更：

变更前	变更后
<p>(四) 估值方法</p> <p>1、货币基金的估值方法 持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日的每万份收益计提红利。</p> <p>2、存款的估值方法 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。</p> <p>3、固定收益品种的估值方法</p> <p>(1) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p> <p>(2) 证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券等投资品种，但可转换债券除外），选取第三方估值机构（中证）提供的相应品种当日的估值净价进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，采用相应估值技术确认公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按历史成本估值。</p> <p>(3) 对在证券交易所市场上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价，减去其中所含当日的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，以最近交易日债券收盘价作为全价，减去其中所含截止最近交易日的债券应收利息得到的净价进行估值。</p> <p>(4) 首次发行未上市债券（可转换债券除外），采用第三方估值机构（中证）提供的数据确定公允价值并进行估值，在第三方估值机构未能提供价格数据的情况下，采用估值技术确定的公允价值进行估值。</p> <p>(5) 银行间市场的固定收益品种，采用</p>	<p>(四) 估值方法</p> <p>1、固定收益品种的估值方法</p> <p>(1) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p> <p>(2) 证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券除外），选取第三方估值机构（中证）提供的数据确定公允价值并进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，采用相应估值技术确认公允价值。</p> <p>(3) 对在证券交易所市场上市交易的可转换债券，根据每日收盘价进行估值；估值日没有交易的，根据最近交易日债券收盘价进行估值。</p> <p>(4) 首次发行未上市债券（可转换债券除外），采用第三方估值机构（中证）提供的数据确定公允价值并进行估值，在第三方估值机构未能提供数据的情况下，采用估值技术确定的公允价值进行估值。</p> <p>(5) 银行间市场的固定收益品种，采用第三方估值机构（中债）提供的数据确定公允价值并进行估值。</p> <p>(6) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）—（5）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）—（5）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</p>

第三方估值机构（中债）提供的价格数据确定公允价值并进行估值。

(6)在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）—（5）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）—（5）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。

4、股票的估值方法

(1)上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。

(2)上市流通股票估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值。

(3)首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值。

(4)送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值。

(5)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值。

(6)通过非公开发行等其他方式获取且有明确锁定期的股票，按以下方法估值：

1)估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价低于非公开发行股票初始取得成本时，可采用在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价作为估值日该非公开发行股票的价值；

2)估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价高于非公开发行股票初始取得成本时，可按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

其中：FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为该非公开发行股票的初始取得成本；P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价；D1为该非公开发行股票锁

价格估值。

2、货币市场基金的估值方法

持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日的每万份收益计提红利。

3、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

4、债券回购的估值方法

持有的债券回购以本金列示，按约定利率逐日确认利息收入。

5、股票的估值方法

(1)上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。

(2)上市流通股票估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(3)首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按发行价估值。

(4)送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

(5)有明确锁定期或在发行时有明确限售期的股票（不包括全国中小企业股份转让系统创新层与基础层的股票），包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、首次公开发行网下配售有限限售期的股票、大宗交易买入有限限售期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。对于基金业协会规定的流通受限股票估值取值中的“流通受限股票的流动性折扣”，当估值日第三方估值机构未提供该流动性折扣时，则优先采用距估值日最近交易日第三方估值机构提供的流动性折扣进行估值处理。若第三方估值机构从未提供该流通受限股票的流动性折扣，则按估值日该流通受限股票在证券交易所、全国中

定期所含的交易天数;Dr 为估值日剩余锁定期,即估值日至锁定期结束所含的交易天数(不含估值日当天)。

3) 股票的锁定期起始日及估值起始日为上市公司发布公告日。

(7) 在任何情况下,资产管理人如采用本项第(1)-(6)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)-(6)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股票估值,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。

5、公开募集证券投资基金的估值方法

(1) 持有的交易所上市基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)、创新型分级基金等),按估值日其所在证券交易日的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值;如果估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考监管机构或行业协会有关规定,或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。

(2) 持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF)),按估值日的基金份额净值估值;估值日基金份额净值无公布的,按此前最近交易日的基金份额净值估值。

(3) 场内持有的分级基金的母基金,按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的,按照第(1)条规定的方法估值;不能在交易所交易的,按照第(2)条规定的方法估值。

(4) 持有的基金处于封闭期的,按照最新公布的份额净值估值。

(5) 在任何情况下,资产管理人如采用本项第(1)-(4)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第(1)-(4)项规定的方法对委托财产进行估值不

小企业股份转让系统上市或挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值。运营中心应当及时通知托管人上述股票的锁定/限售情况。

特别地,流通受限股票估值取值中的“流通受限股票的流动性折扣”优先采用中央国债登记结算有限责任公司(简称“中债”)提供的数据。若需调整为中证指数有限公司(简称“中证”)提供的数据,则应自行采购中证数据并由运营中心提前2个工作日书面通知托管人。

(6) 如资产管理人认为按本项第(1)-(5)小项规定的方法对集合资产管理计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的,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股票估值,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。

6、公开募集证券投资基金的估值方法

(1) 持有的交易所上市基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)、创新型分级基金等),按估值日其所在证券交易日的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值;如果估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考监管机构或行业协会有关规定,或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。

(2) 持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF)),按估值日的基金份额净值估值;估值日基金份额净值无公布的,按此前最近交易日的基金份额净值估值。

(3) 场内持有的分级基金的母基金,按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的,按照第(1)条规定的方法估值;不能在交易所交易的,按照第(2)条规定的方法估值。

(4) 持有的基金处于封闭期的,按照最新公布的份额净值估值。

(5) 在任何情况下,资产管理人如采用

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。

6、标准化商品及金融衍生品类资产的估值方法

(1) 期货合约按估值日其所在交易所的结算价估值；估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的，从其规定；

(2) 衍生工具等其他有价证券，上市交易的按估值日的结算价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的结算价估值；未上市交易的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的有价证券，采用估值技术确定公允价值。

7、其他资产的估值方法

其他资产按照国家有关规定进行估值。

8、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映本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，按最能反映本计划资产公允价值的方法估值。

9、如有新增事项或变更事项，按国家有关最新规定估值。

10、当市场发生极端的流动性不足或者证券被停牌，合同终止无法变现的资产处理由合同各方根据相关法律法规，视具体情况就资产变现、估值等事宜协商解决。

估值应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》、企业会计准则及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。如管理人或托管人发现本计划估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护份额投资者利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

本项第(1)–(4)项规定的方法对受托财产进行估值，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第(1)–(4)项规定的方法对受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。

7、私募证券投资基金、银行理财产品、资金信托计划、基金公司及其子公司发行的资产管理计划、证券公司及其子公司发行的资产管理计划、期货公司及其子公司发行的资产管理计划、保险资产管理机构发行的保险资产管理产品的估值方法

(1) 如在标的产品权益确认日当天收到了标的产品权益确认原始凭证的，则在标的产品权益确认日当天以权益确认原始凭证为依据入账；如无法在权益确认日当天提供收到标的产品的权益确认原始凭证的，则以收到标的产品权益确认原始凭证的提供日当天进行入账，且不对历史账务进行追溯调整。

(2) 按份额净值计价的投资标的，按照标的产品的最新份额净值估值，未提供最新份额净值的，以最近一次得到的标的产品份额净值进行估值。

(3) 如标的产品披露“虚拟份额净值”（即份额净值扣除预估业绩报酬（如有）后得到的份额净值），本计划管理人可选择使用标的产品的“虚拟份额净值”对本计划进行估值，选择使用“虚拟份额净值”进行本计划估值，则后续不能再进行更改。

(4) 按面值及每万份收益计价的投资标的，以成本列示，按标的产品公布的最新每万份收益计提收益。

(5) 如不属于上述情况的，则管理人可与托管人协商一致，按最能反映该投资标的公允价值的方法估值。

8、标准化期货和衍生品类资产的估值方法

(1) 期货合约按估值日其所在交易所的结算价估值；估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的，从其规定；

	<p>(2) 衍生工具等其他有价证券, 上市交易的按估值日的结算价估值; 估值日没有交易的, 按最近交易日的结算价估值; 未上市交易的, 采用估值技术确定公允价值, 在估值技术难以可靠计量的情况下, 按成本估值; 停止交易、但未行权的有价证券, 采用估值技术确定公允价值。</p> <p>9、其他资产的估值方法 其他资产按照国家有关规定进行估值。</p> <p>10、如存在上述估值约定未覆盖的投资品种, 管理人可根据具体情况, 在与托管人商议后, 按最能反映该投资品种公允价值的方法估值。</p> <p>11、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。</p> <p>12、如有新增事项或变更事项, 按国家有关最新规定估值。</p> <p>13、当市场发生极端的流动性不足或者证券被停牌, 合同终止无法变现的资产处理由合同各方根据相关法律法规, 视具体情况就资产变现、估值等事宜协商解决。</p> <p>估值应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》、企业会计准则及其他法律、法规的规定, 如法律法规未做明确规定的, 参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。如管理人或托管人发现集合计划估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护份额投资者利益时, 应立即通知对方, 共同查明原因, 双方协商解决。</p> <p>本计划投资场外基金的, 如资产管理人无法及时提供权益确认资料等相关账务处理凭证, 则相关账务处理方式由资产管理人和资产托管人双方协商一致决定, 由此产生的风险由资产管理人承担。</p>
--	---

15、对《资产管理合同》项下第十九章“资产管理计划财产的估值和会计核算”第(五)款“估值程序”作如下变更:

变更前	变更后
-----	-----

T+1 日管理人对 T 日委托资产进行估值，托管人负责进行复核。	T+2 日管理人对 T 日受托资产进行估值，托管人负责进行复核。
----------------------------------	----------------------------------

16、对《资产管理合同》项下第二十三章“风险揭示”第（二）款第 11 条第（2）点“固定收益类投资标的风险”作如下修改，并增加“资产管理产品投资标的风险”：

变更前	变更后
<p>(2) 固定收益类投资标的风险</p> <p>1) 银行存款、同业存单：存款银行因经营不善导致无法提款或流动性危机造成的暂时无法提款的风险，造成投资损失；</p> <p>2) 债券(包括在国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动机制的债券)：债券预期收益变动的可能性及变动幅度，债券交易产生的债券价差损失，以及债券发行主体因经营不善造成的债务违约，造成的投资损失；</p> <p>3) 债券回购：由于市场或本计划流动性原因无法回购债券导致的违约风险，以及市场利率变动的风险；</p> <p>4) 货币市场基金：根据金融产品的投资特点不同而呈现不同风险，由于不同的金融产品的管理人管理水平以及金融产品本身的风险水平，由此会产生影响本计划收益的特殊风险。</p>	<p>(2) 固定收益类投资标的风险</p> <p>1) 银行存款、同业存单：存款银行因经营不善导致无法提款或流动性危机造成的暂时无法提款的风险，造成投资损失；</p> <p>2) 债券（包括在依法设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动机制的债券）：本计划投资债券等固定收益率资产可能面临利率、汇率变化等市场风险、债券价格波动风险、债券预期收益变动的可能性及变动幅度与债券交易产生的债券价差损失、债券发行主体因经营不善造成债务违约导致的投资损失等；</p> <p>3) 资产支持证券：资产证券化过程中的基础资产信用风险主要来自于基础资产质量上。主要体现为原始权益人不能按时或不能对基础资产进行清偿，使得投资者可能无法获得约定的投资收益；由于基础资产债务人有提前偿还债务的权利，一旦提前还款，也会对投资者的收益产生较大的影响。此外，由于资产证券化的本身具有复杂性和创新性，同时资产证券化的各类资产的特性、信用增级方式、市场利率变化等因素，可能造成兑付、逾期等投资风险；</p> <p>4) 可转债、可交债：可转债、可交债的投资存在波动性风险，具体表现为可转债、可交债的价格受到其相对应股票价格波动的影响，同时可转债、可交债还有信用风险和转股风险。转股风险指相对应股票价格跌破转股价，不能获得转股收益，从而无法弥补当初付出的转股期权价值；</p> <p>5) 债券回购：由于市场或本计划流动性原因无法回购债券导致的违约风险，以及市场利率变动的风险；</p> <p>6) 货币市场基金：根据金融产品的投资特点不同而呈现不同风险，由于不同的金融产品的管理人管理水平以及金融产品本身的风险水平，由此会产生影响本计划收益的特殊风险。</p>

(3) 资产管理产品投资标的风险

本计划部分资产将配置于金融监督管理部门批准或备案发行的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(包括券商集合资产管理计划、基金公司及基金子公司发行的资产管理计划、期货公司发行的资产管理计划、保险资产管理计划等),投资上述资产管理产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响,请投资者知悉。

1) 资产管理产品管理人风险

资产管理产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险是指因管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内控管理等因素导致公司经营不善,极端情况下甚至破产倒闭,可能对其管理人的产品业绩造成不利影响。另外,对于约定了止损条款的资产管理产品,可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。

2) 资产管理产品投资风险

本计划所投资的资产管理产品可能由于其管理人对市场判断失误、买入标的市场表现不佳、风险控制失效等原因造成产品净值的下降,从而造成资产管理计划净值下降,最终导致资产管理计划投资者资产损失。

3) 策略模型风险

在实际运作中,因资产管理产品的投资经理变更导致模型无法有效运作,开发的策略或模型不再有效或者在运作过程中与产品期初投资策略和投资风格发生偏离,进而影响产品投资业绩。

4) 产品的关联交易风险

本计划所投资的底层私募权益类标的可能会涉及ETF基金、LOF基金、分级基金等。实际底层私募投资过程中,不排除涉及关联关系公司的关联交易。

5) 赎回资产管理产品面临的流动性风险

因本计划投资者赎回或资产配置调整需要,管理人赎回资产管理产品时,可能触发资产管理产品大额赎回或巨额赎回条款,导致赎回资金延迟到账的风险。

6) 投资资产管理产品可能面临双层收费的风险

本计划投资者需要承担双层费用,即本计划

费用以及本计划所投资的资产管理产品自身需要承担费用。本计划所投资的资产管理产品自身需要承担费用包括资产管理产品的管理费、托管费、业绩报酬（如有）、认购费（如有）、赎回费（如有）等，以上费用在计提时将会扣减资产管理产品的资产净值，从而造成资产管理计划净值下降。

7) 投资资产管理产品的估值风险

①本计划投资多个底层资产管理产品，每个资产管理产品的估值时间可能不一致，且披露时间可能不一致，本计划按照底层资产管理产品估值日最近的单位净值进行估值。在存续期间，本计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。

②如计划投资标的采用“虚拟净值”作为公允价值估值，可能引发客户损失的风险。由于本计划在开放日但投资的基金产品未开放的，对于下层投资标的如采用“虚拟净值”（对下层投资标的未扣除业绩报酬的净值，本计划管理人（或下层投资标的管理人）按下层投资标的合同约定计算并扣除业绩报酬金额后的净值）作为公允价值进行估值，因与下层投资标的的业绩报酬实际提取存在时间差，可能与下层投资标的实际提取业绩报酬金额后的净值存在差异，可能导致本计划净值存在误差，从而可能引发客户损失。

8) 底层资产管理产品提取业绩报酬对产品净值造成下跌的风险

由于本计划投资多个资产管理产品，每个资产管理产品在业绩报酬计提方式、业绩报酬计提时间以及产品估值时间与本计划层面可能不一致，当底层资产管理产品提取业绩报酬后可能造成本计划净值下降、投资者持有本计划份额期间收益下降的风险。

9) 本计划会因巨额赎回而造成部分退出的风险，如果顺延退出后，本计划的单位净值继续下降，投资者可能会因此导致亏损。

在集合计划存续期间可能发生投资者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。对于投资者而言，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。
--	----------------------

17、对《资产管理合同》项下第二十五章“违约责任”第二段“发生下列情况的，当事人可以免责”增加第8条：

变更前	变更后
<p>1、不可抗力：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或突发事件影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划资产损失扩大；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或突发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；</p> <p>2、管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国人民银行、中国证监会、中国证券投资基金业协会规定作为或不作为而造成的损失等；</p> <p>3、管理人对按照本合同约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>4、在计划运作过程中，管理人和/或托管人按照法律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；</p> <p>5、管理人和/或托管人按照法律法规的规定配合国家有权机关对投资者持有的计划份额采取冻结、非交易过户措施的；</p> <p>6、托管人未能事前就其关联方名单及相关证券明确告知管理人致使本计划发生违规投资行为的，管理人不承担任何责任；</p> <p>7、出现法律法规、中国证监会及自律组织规定或通知（包括口头指导意见）停止此类集合业务而造成的损失。</p>	<p>1、不可抗力：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或突发事件影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划资产损失扩大；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或突发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；</p> <p>2、管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国人民银行、中国证监会、中国证券投资基金业协会规定作为或不作为而造成的损失等；</p> <p>3、管理人对按照本合同约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>4、在计划运作过程中，管理人和/或托管人按照法律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；</p> <p>5、管理人和/或托管人按照法律法规的规定配合国家有权机关对投资者持有的计划份额采取冻结、非交易过户措施的；</p> <p>6、托管人未能事前就其关联方名单及相关证券明确告知管理人致使本计划发生违规投资行为的，管理人不承担任何责任；</p> <p>7、出现法律法规、中国证监会及自律组织规定或通知（包括口头指导意见）停止此类集合业务而造成的损失；</p> <p>8、托管人对于存放在托管人之外的委托财产的任何损失，及基于从第三方机构（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导致委托财产的任何损失等都应是免责的。</p>

根据中国证监会2023年1月13日修订并于2023年3月1日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（简称“管理办法”）及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（简称“运作规定”）等相关法律法规及有关规定的变化，对资产管理合同

的相关条款进行如下变更：

18、对《资产管理合同》全文相关表述作如下调整：

变更前	变更后
委托财产/委托资产/委托资金	受托财产/受托资产/参与资金
委托人	投资者
基金销售资格	公开募集证券投资基金销售资格
商品及金融衍生品	期货和衍生品
具有证券相关业务资格的会计师事务所	符合《证券法》规定的会计师事务所
国务院同意设立的交易场所	依法设立的交易场所

19、对《资产管理合同》项下第一章“前言”第七段作如下变更：

变更前	变更后
管理人对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为按要求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。	管理人对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为按要求向证券投资基金业协会进行备案。

20、对《资产管理合同》项下第二章“释义”的“《管理办法》”、“《运作规定》”、“合格投资者”、“证券交易所”、“交易日、工作日”、“7个工作日可变现资产”、“流动性受限资产”作如下变更：

变更前	变更后
《管理办法》：指2018年10月22日中国证监会公布实施的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会第151号令）。	《管理办法》：指2018年10月22日证监会令第151号公布、2023年1月12日证监会令第203号修订的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》。
《运作规定》：指2018年10月22日中国证监会公布实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2018〕第31号）。	《运作规定》：指2018年10月22日中国证监会公告〔2018〕第31号公布、2023年1月12日证监会公告〔2023〕2号修订的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》。
合格投资者：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、基金公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国	合格投资者：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；(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。	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。
证券交易所：指上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所。	证券交易所：指上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、香港联合交易所以及其他依法设立的证券交易所。
交易日、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所的正常交易日。	交易日、工作日：指境内证券交易所的正常交易日。
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、期货及期权合约以及同业存单，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。	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。
流动性受限资产：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)、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。	流动性受限资产：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。

21、对《资产管理合同》项下第四章“当事人及权利义务”第(四)款第2条“管理人的义务”第(21)点作如下变更：

变更前	变更后
(21) 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，向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；	(21) 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；

22、对《资产管理合同》项下第四章“当事人及权利义务”第(五)款第2条“托管人的义务”第(9)、(14)、(15)点作如下变更：

变更前	变更后

(9)编制托管年度报告,并向证券投资基金业协会备案,抄报中国证监会相关派出机构;	(9)编制托管年度报告,并报送中国证监会相关派出机构;
(14)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)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;
(15)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,通过季报、年报方式向投资者充分揭示;	(15)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,并通过季报、年报的方式向投资者充分揭示;

23、对《资产管理合同》项下第五章“资产管理计划的基本情况”第(十)款第(3)条“临时开放期”作如下变更:

变更前	变更后
3、临时开放期:本计划管理人自有资金参与比例超标或本合同发生变更(或展期)时,管理人有权设置临时开放期,退出管理人自有资金使其参与比例符合本合同约定,保障合同变更异议投资者退出的权利,临时开放期的设置以届时管理人发布的公告为准。	3、临时开放期:当发生如下情形时,管理人有权设置临时开放期:①证券期货经营机构自有资金参与比例超标时,设置临时开放期供证券期货经营机构自有资金退出使其参与比例符合本合同约定;②本合同发生变更(或展期)时,设置临时开放期保障合同变更异议投资者退出的权利;③发生符合本合同约定的其它情形时,设置临时开放期保障投资者退出的权利。临时开放期的具体设置以届时管理人发布的公告为准,管理人在管理人网站发布公告即视为履行了告知义务。

24、对《资产管理合同》项下第六章“资产管理计划的募集”第(一)款第3条作如下变更:

变更前	变更后
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;	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;

25、对《资产管理合同》项下第六章“资产管理计划的募集”第(一)款第5条作如下变更:

变更前	变更后
5、基本养老金、社会保障基金、企业年金等	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）；	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）；
---	---

26、对《资产管理合同》项下第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”第（一）款“资产管理计划的参与”第1条第（4）点“临时开放期的触发条件、程序及披露等安排”作如下变更：

变更前	变更后
<p>（4）临时开放期的触发条件、程序及披露等安排</p> <p>当本计划管理人自有资金参与比例超标或本合同发生变更（或展期）时，管理人有权设置临时开放期，退出管理人自有资金使其参与比例符合本合同约定，保障合同变更异议投资者退出的权利，临时开放期的设置以届时管理人发布的公告为准。</p>	<p>（4）临时开放期的触发条件、程序及披露等安排</p> <p>当发生如下情形时，管理人有权设置临时开放期：①证券期货经营机构自有资金参与比例超标时，设置临时开放期供证券期货经营机构自有资金退出使其参与比例符合本合同约定；②本合同发生变更（或展期）时，设置临时开放期保障合同变更异议投资者退出的权利；③发生符合本合同约定的其它情形时，设置临时开放期保障投资者退出的权利。临时开放期的具体设置以届时管理人发布的公告为准，管理人在管理人网站发布公告即视为履行了告知义务。如管理人设置或调整临时开放期，管理人应提前以邮件的方式通知托管人（托管人的邮箱为：custody-audit@nbcab.cn）。</p>

27、对《资产管理合同》项下第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”第（二）款“资产管理计划的退出”第1条第（2）点“退出的开放日和时点”作如下变更：

变更前	变更后
<p>投资者因不同意合同变更（或展期）或管理人因自有资金参与比例超标在临时开放期退出集合计划的，不受该限制，临时开放期的具体安排以资产管理人公告为准，届时通过资产管理人网站发布公告即视为资产管理人履行了告知义务。</p>	<p>当发生如下情形时，管理人有权设置临时开放期：①证券期货经营机构自有资金参与比例超标时，设置临时开放期供证券期货经营机构自有资金退出使其参与比例符合本合同约定；②本合同发生变更（或展期）时，设置临时开放期保障合同变更异议投资者退出的权利；③发生符合本合同约定的其它情形时，设置临时开放期保障投资者退出的权利。临时开放期的具体设置以届时管理人发布的公告为准，管理人在管理人网站发布公告即视为履行了告知义务。如管理人设置或调整临时开放期，管理人应提前以邮件的方式通知托管人（托管人的邮箱为：custody-audit@nbcab.cn）。</p>

28、对《资产管理合同》项下第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”第（六）款“管

理人自有资金参与、退出”作如下变更：

变更前	变更后
<p>(六) 管理人自有资金参与、退出</p> <p>1、管理人自有资金参与、退出的条件</p> <p>在满足《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》和本合同以及其他有关规定对自有资金参与的规定的前提下，管理人可自主决定以自有资金参与集合计划。在同时满足以下条件时，管理人自有资金可以参与、退出本集合计划：</p> <p>(1) 管理人以自有资金参与集合计划的份额持有期限不得少于6个月；</p> <p>(2) 管理人以自有资金参与和退出时，应当提前5个工作日在管理人网站公告，向投资者及托管人披露。</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，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出本计划可不受上述限制，但应及时告知投资者和托管人，并向管理人所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。</p> <p>2、管理人自有资金参与的方式、金额与比例</p> <p>管理人可以自有资金参与本集合计划，参与比例不得超过集合计划总份额（含管理人自有资金参与份额）的16%；管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本计划总份额的50%。因集合计划规模变动等客观因素导致管理人以自有资金参与本集合计划的总份额被动超过集合计划总份额的16%，或管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计被动超过本计划总份额的50%，管理人或管理人及其附属机构应及时退出部分或全部参与份额直至符合中国证监会规定及本合同约定。</p> <p>3、管理人自有资金参与部分的收益分配</p> <p>管理人自有资金参与份额与投资者持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也有承担与计划份额相对应损失的责任。</p> <p>4、风险揭示</p>	<p>(六) 证券期货经营机构自有资金参与、退出</p> <p>1、证券期货经营机构自有资金参与、退出的条件、程序</p> <p>(1) 在满足《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》和本合同以及其他有关规定对自有资金参与的规定的前提下，证券期货经营机构可自主决定以自有资金参与集合计划。在同时满足以下条件时，证券期货经营机构自有资金可以参与、退出本集合计划：</p> <p>① 证券期货经营机构以自有资金参与和退出本集合计划时，应当提前5个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与比例被动超标，自有资金选择退出的情形除外，但事后应当及时告知；</p> <p>② 证券期货经营机构以自有资金参与集合计划的份额持有期限不得少于6个月。</p> <p>(2) 证券期货经营机构以自有资金参与和退出本集合计划时，需提前5个工作日以邮件方式征询托管人，并通过管理人网站向投资者发出征询公告。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，应视为投资者和托管人同意证券期货经营机构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，管理人保障其退出本集合计划的权利。不同意的投资者可在公告日起至证券期货经营机构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。如在公告日起至证券期货经营机构自有资金参与和退出本集合计划日（含）之间无退出开放日，则管理人将设置临时开放期，临时开放期设置以管理人届时公告为准。未在前述时间回复意见，以及未在开放期内退出的投资者，均视为同意证券期货经营机构自有资金的参与和退出安排。投资者明确表示不同意证券期货经营机构以自有资金参与和退出本集合计划的，有权在管理人发出征询公告时规定的开放期内提出退出申请。投资者承诺，若其未提出退出申请，则视为同意证券期货经营机构以自有资金参与和退出本计划的安</p>

(1) 管理人以自有资金参与本集合计划的份额，与其他投资者持有的同类份额享有同等权益、承担相同风险，且不对集合计划投资者承担任何补偿责任，也不对其他投资者的本金和收益构成承诺或担保。请投资者注意投资风险。

(2) 管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响集合计划收益。管理人将认真履行管理人职责，关注集合计划规模变动情况，控制流动性风险。

排。管理人应当披露自有资金的参与、退出情况及持有期限等信息。

(3) 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参与及其后续退出本计划可不受上述限制，但应及时告知投资者和托管人，并向管理人所在地中国证监会派出机构报告。

2、证券期货经营机构自有资金参与的方式、金额与比例

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与其自身或其子公司管理的单个集合资产管理计划的份额合计不得超过该资产管理计划总份额的 50%（含证券期货经营机构自有资金参与份额）。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因集合计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，证券期货经营机构应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时调整达标。

3、证券期货经营机构自有资金参与部分的收益分配

证券期货经营机构自有资金参与份额与投资者持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也有承担与计划份额相对应损失的责任。

4、风险揭示

(1) 证券期货经营机构以自有资金参与本集合计划的份额，与其他投资者持有的同类份额享有同等权益、承担相同风险，且不对集合计划投资者承担任何补偿责任，也不对其他投资者的本金和收益构成承诺或担保。请投资者注意投资风险。

(2) 证券期货经营机构自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响集合计划收益。管理人将认真履行其职责，关注集合计划规模变动情况，控制流动性风险。

29、对《资产管理合同》项下第十一章“资产管理计划的投资”第（三）款“投资比例超限的处理方式及流程”作如下变更：

变更前	变更后
(三) 投资比例超限的处理方式及流程 因证券期货市场波动、证券发行人合	(三) 投资比例超限的处理方式及流程 因证券期货市场波动、证券发行人合

<p>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 15 个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，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。</p>	<p>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 20 个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p>
--	--

30、对《资产管理合同》项下第十四章“利益冲突及关联交易”作如下变更：

变更前	变更后
<p>(一)本计划存在或可能存在的利益冲突情形</p> <p>本计划存在或可能存在利益冲突情形包括但不限于：</p> <p>1、管理人运用本计划资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易；</p> <p>2、管理人及其附属机构有权以自有资金参与本计划；</p> <p>3、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或其他关联方均有权参与本计划；</p> <p>4、其他可能产生利益冲突的情形。</p> <p>(二)利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容及披露频率</p> <p>管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，采取有效措施，做好充分的信息披露和利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范和管控可能的利益冲突。公平对待全体投资者，实现在公司、股东和员工个人的利益与投资者利益发生冲突时，优先保障投资者的利益，不同投资者之间的利益发生冲突时，公平对待不同投资者。</p> <p>如发生利益冲突，管理人将按照内部规定处理，确保公平对待投资者，不损害投资者权益并及时向投资者披露。管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。</p> <p>投资者在此同意管理人可以将本计划</p>	<p>(一)本计划存在或可能存在的利益冲突情形</p> <p>1、本计划的关联方包括管理人、托管人及前述机构控股股东、实际控制人或者其他关联方。前述关联方按照《企业会计准则》的规定确定。投资者可于交易所最新公开披露的年报查询管理人和托管人具体关联方名单。</p> <p>2、以资产管理计划资产从事关联交易的情形，包括但不限于：</p> <p>(1) 管理人可以在符合本计划投资范围的前提下，以资产管理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；</p> <p>(2) 管理人可以在符合本计划投资范围的前提下，以资产管理计划资产投资于本计划关联方所设立的资产管理产品（管理人发行设立的除外）；</p> <p>(3) 与关联方开展证券等交易，包括与本计划关联方为交易对手进行银行间或交易所市场的交易、接受发行主体为本计划关联方的质押券。</p> <p>以资产管理计划资产从事重大关联交易的情形为：①运用资产管理计划资产从事前款第(1)项所述的关联交易；②运用资产管理计划资产从事前款(2)-(3)项所述的关联交易，交易金额在 3000 万元以上且单笔关联交易超过本计划资产净值 20%(含)；③运用资产管理计划资产从事前款(2)-(3)项所述的关联交易，交易金额在 3000 万元以上且占管理人公司最近一期经审计净资产绝对值 5%以上。以资产管理计划资产从</p>

资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。管理人应于交易完成后5个工作日内通过管理人网站以公告方式向投资者和托管人披露，并及时将关联交易结果向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。但因托管人未按本合同约定向管理人提供其关联方名单以及相关的证券名单而导致管理人未向投资者履行告知和披露义务的，管理人不承担任何责任。管理人应事前将其关联方名单明确告知托管人，并在关联方名单更新时及时通知托管人。因管理人未及时提供关联方名单导致托管人监控不及时的，托管人不承担责任。

事一般关联交易的情形为：运用资产管理计划资产从事关联交易，但未达到前述①-③项条件的其它关联交易情形。管理人在遵守法律法规的前提下制定以上重大关联交易与一般关联交易的范围及划分标准，除法律法规明确规定的标准以外系管理人公司制度的规定，如该等制度发生修改或变更导致上述范围及划分标准调整的，管理人将根据本合同约定通过管理人网站发布公告向投资者充分披露。

3、本计划禁止发生以下关联交易情形：

(1) 接受发行主体为本计划管理人、托管人及前述机构关联方的质押券；

(2) 与管理人及管理人关联方作为债券交易对手进行交易；

(3) 与管理人所管理的其它资产管理计划、管理人公司自营账户、管理人公司作为投资顾问所管理的产品作为债券交易对手进行交易。

4、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或其他关联方均有权参与本计划。

(二) 利益冲突的处理方式

管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，采取有效措施，做好充分利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范和管控可能的利益冲突。具体包括：

1、对价确定机制：定价机制方面，原则上关联标的应当按照市场公允价值进行定价，因市场交易不活跃等原因无法确定市场公允价值的，管理人应当披露该关联交易价格的确定原则及其方法，并对该定价的公允性作出说明。

2、决策审批程序：管理人以资产管理计划资产从事关联交易应当符合本计划合同约定的投资目标及策略，并遵照公司制度要求进行决策和审批程序，遵守维护投资者权益、公平和诚信、披露和报备以及合法性原则，投资经理对关联交易承担第一责任，公司按照内部制度规范指定相关决策机构或相关部门对关联交易的合法合规性以及公允性进行审核。

(三) 利益冲突的披露方式、披露内容及披露频率

1、管理人以资产管理计划资产从事重大关联交易，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，采取逐笔确认的方式事先取得投资者同意，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。管理人应以公告或邮件等任一方式事先取得投资者确认，并于重大关联交易完成后 5 日内通过公告或邮件等方式向投资者和托管人披露，并向中国证监会相关派出机构报告。

2、投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人以资产管理计划资产从事一般关联交易，资产管理人无需就此分别取得投资者的个别授权，但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待受托财产，并依据相关要求履行信息披露和监管报告义务。管理人应于一般关联交易完成后 5 个工作日内通过公告或邮件等方式向投资者和托管人披露，并向中国证监会相关派出机构报告。

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资产管理计划，应向投资者充分披露，对本计划账户进行监控，并及时向中国证监会相关派出机构报告。

4、管理人、托管人均应事前将其关联方名单明确告知相对方，并在关联方名单更新时及时通知相对方。因一方未及时提供关联方名单导致另一方监控不及时，由违约方承担相关责任。

(四) 特别风险提示

1、关于以资产管理计划资产从事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，逐笔通过公告或邮件等方式征询投资者，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、关于以资产管理计划资产从事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

	<p>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。</p> <p>(五)关于关联交易划分标准及披露要求等约定,如遇有关法律、法规、监管文件作出调整且与本合同约定不一致时,由管理人依据新的规定执行并向投资者充分披露。</p>
--	--

31、对《资产管理合同》项下第二十二章“信息披露与报告”第(一)款第2条“集合计划季度报告”作如下变更:

变更前	变更后
集合计划季度报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站公告,并由管理人报送中国证券投资基金业协会及管理人注册地中国证监会派出机构。	集合计划季度报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站公告。

32、对《资产管理合同》项下第二十二章“信息披露与报告”第(一)款第3条“集合计划年度报告和年度审计报告”作如下变更:

变更前	变更后
集合计划年度报告应于每年度结束之日起四个月内通过管理人网站公告,并由管理人报送中国证券投资基金业协会及管理人注册地中国证监会派出机构。	集合计划年度报告应于每年度结束之日起四个月内通过管理人网站公告。

33、对《资产管理合同》项下第二十二章“信息披露与报告”第(二)款“临时报告”作如下变更:

变更前	变更后
<p>(二) 临时报告</p> <p>1、本计划在运作过程中发生下列法律法规规定或者本合同约定可能影响投资者利益的重大事项时,管理人应当在事项发生之日起五日内通过管理人网站向投资者披露,并向管理人注册地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。临时报告的情形包括但不限于:</p> <p>(1)集合计划运作过程中,负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资经理发生变更,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;</p> <p>(2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请;</p> <p>(3) 发生巨额退出并延期支付;</p>	<p>(二) 临时报告</p> <p>1、本计划在运作过程中发生下列法律法规规定或者本合同约定可能影响投资者利益的重大事项时,管理人应当在事项发生之日起五日内向投资者披露,披露方式可采用管理人网站或其他电子/书面形式的披露,并向管理人注册地中国证监会派出机构报告。重大事项的情形包括但不限于:</p> <p>(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;</p> <p>(2) 与资产管理计划有关的重大诉讼、仲裁、财产纠纷,以及出现延期兑付、投资标的的重大违约等风险事件;</p> <p>(3) 资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延期清算;</p>

<p>(4) 集合计划资产的估值错误导致错误偏差达到计划资产净值的 0.5%;</p> <p>(5) 管理人以自有资金参与和退出;</p> <p>(6) 合同的补充、修改与变更;</p> <p>(7) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项;</p> <p>(8) 负责本计划的代理销售机构发生变更;</p> <p>(9) 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;</p> <p>(10) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责;</p> <p>(11) 其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。</p> <p>2、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。</p>	<p>(4) 管理人、托管人因重大违法违规,被监管机构取消或认定不符合相关业务资格;</p> <p>(5) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责;</p> <p>(6) 发生其他对持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件;</p> <p>(7) 其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。</p> <p>2、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,对本计划账户进行监控,并及时向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>3、根据法律法规、本合同约定应当向投资者披露的其他临时报告。</p>
--	---

34、对《资产管理合同》项下第二十二章“信息披露与报告”第(三)款“清算报告”作如下变更:

变更前	变更后
<p>(三) 清算报告</p> <p>资产管理计划终止的,管理人应当在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划财产。管理人在资产管理计划清算结束后的五个工作日内,将清算结果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。若本计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的,管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p>	<p>(三) 清算报告</p> <p>资产管理计划终止的,管理人应当在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划财产。管理人在资产管理计划清算结束后的五个工作日内,将清算报告报中国证券投资基金业协会备案。若本计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的,管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p>

35、对《资产管理合同》项下第二十四章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”第(一)款第6条作如下修改:

变更前	变更后
<p>6、资产管理合同发生变更的,管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案,并抄报管理人注册地中国证监会派出机构。</p>	<p>6、资产管理合同发生变更的,管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案。</p>

36、对《资产管理合同》项下第二十四章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”第(二)款第3条作如下修改:

变更前	变更后
<p>3、展期情况备案</p> <p>本集合计划展期后5个工作日内,管理人将</p>	<p>3、展期情况备案</p> <p>本集合计划展期后5个工作日内,管理人将</p>

展期情况公告并报送中国证券投资基金业协会及管理人注册地中国证监会派出机构。	展期情况公告并报送中国证券投资基金业协会。
---------------------------------------	-----------------------

37、对《资产管理合同》项下第二十四章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”第（四）款第2条第（3）点作如下修改：

变更前	变更后
（3）清算报告由管理人在清算结束后5个工作日内报告中国证券投资基金业协会备案，同时抄报管理人注册地中国证监会派出机构，并在管理人网站公布清算报告。	（3）清算报告由管理人在清算结束后5个工作日内报告中国证券投资基金业协会备案，并在管理人网站公布清算报告。

38、对《资产管理合同》项下第二十四章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”第（四）款第5条作如下修改：

变更前	变更后
5、资产管理计划延期清算处理方式 若本计划在终止之日有未能流通变现的证券，清算小组可对此制定二次清算方案，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投资者拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给投资者。本计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。	5、资产管理计划延期清算处理方式 若本计划在终止之日有未能流通变现的证券，清算小组可对此制定二次清算方案，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投资者拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给投资者。本计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

39、对《资产管理合同》项下第二十四章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”第（四）款第6条“资产管理计划财产清算报告的告知安排”作如下修改：

变更前	变更后
6、资产管理计划财产清算报告的告知安排 清算报告由管理人在清算结束后5个工作日内报告中国证券投资基金业协会备案，同时抄报管理人注册地中国证监会派出机构，并在管理人网站公布清算报告；	6、资产管理计划财产清算报告的告知安排 清算报告由管理人在清算结束后5个工作日内将清算报告报中国证券投资基金业协会备案，并在管理人网站公布清算报告。

40、根据本次《资产管理合同》的变更内容，对《东方财富证券致盈1号集合资产管理计划风险揭示书》做相应修改，并将其纳入《资产管理合同》，作为合同附件一：

<p>东方财富证券致盈1号集合资产管理计划 风险揭示书</p> <p>尊敬的投资者：</p> <p>投资有风险。当您/贵机构认购或申购资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在做出投资决策之前，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，理性判断并谨慎做出投资决策。</p>

根据有关法律法规，资产管理人东方财富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、资产管理人声明与承诺

(一) 资产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资产管理人投资能力、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) 资产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) 资产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

投资者应了解参与本计划面临的风险包括但不限于以下风险：

(一) 特定风险揭示

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

本合同是基于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）》而制定的，管理人根据自身实际情况对合同指引相关内容做出了合理的调整，可能导致本合同被证券投资基金业协会认定为与合同指引不完全一致，从而要求管理人重新修订完善的风险。管理人将及时根据证券投资基金业协会的要求提交说明材料，如涉及投资者相关权利义务的，管理人及时在指定网站进行信息披露，相关内容以披露的信息为准。

2、本集合计划有托管，不存在未托管所涉风险

3、本集合计划委托募集所涉风险

管理人可以委托在中国证监会注册取得公开募集证券投资基金销售业务资格并成为证券投资基金业协会会员的机构代销本集合计划，代销机构可能存在违法违规地公开宣传、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作等行为导致基金投资者合法权益受损的风险。

4、本集合计划无外包事项，不存在外包事项所涉风险

5、本集合计划不聘请投资顾问，不存在聘请投资顾问所涉风险

6、本集合计划份额转让所涉风险

本集合计划不接受份额转让，若开通份额转让功能，将以公告为准。如若开通份额转让功能，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，并按规定办理份额变更登记手续。所涉及的风险包括但不限于：

(1) 操作系统风险。办理转让操作的系统可能因为认为或客观原因出现故障，影响转让业务办理。

(2) 折溢价风险。办理份额转让时，份额的交易价格可能与份额单位净值发生偏离的风险。

7、本集合计划不设置份额持有人大会，不存在设置份额持有人大会所涉风险

8、本集合计划存在募集完成后未在证券投资基金业协会完成备案或证券投资基金业协会不予备案的情形，本计划在前述情形下存在需修改合同、不能投资运作或提前终止的风险。请投资者注意。

9、其他特殊风险

集合计划可能存在其他上述未列举的风险。

(二) 一般风险揭示

1、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资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本计划的产品风险等级为R4，仅适合风险承受能力为C4及以上的合格投资者和所有符合中国证监会规定的专业投资者。

本计划的投资策略在测算、评估时存在误差（历史表现不保证未来表现），策略中的估计存在误差，或者市场条件突然发生改变等因素将对本集合的收益产生影响。同时，研究报告或其它材料的数据是否准确可靠，也将对本计划的业绩表现有所影响。本计划净值可能产生明显波动，甚至存在净值为负的可能，各份额均以其初始参与金额为限承担亏损，即投资者可能面临本金损失的风险。

2、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。经济运行具有周期性的特点，受其影响，集合资产管理计划的收益水平也会随之发生变化，从而产生风险。

（3）利率、汇率风险。利率、汇率风险是指由于利率、汇率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率、汇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，使本计划收益水平随之发生变化，从而产生风险。

（4）上市公司经营风险。上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如本计划所投资的上市公司经营不善，与其相关的证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使本计划投资收益下降。

（5）购买力风险。本计划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，从而使本计划的实际收益下降。

（6）基金公司或其他金融机构经营风险。由于基金公司或其他金融机构经营好坏受多种因素影响，有可能导致其管理的基金/产品净值下降，从而使本计划收益降低。

（7）衍生品投资风险。衍生品价格会根据其标的物价格变化而变化，因此衍生品标的物价格的变化会影响衍生品的价格。

3、管理风险

在本计划运作过程中，管理人的知识、经验、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。资产管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

4、流动性风险

资产管理计划的资产不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。资本市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本，对资产管理计划造成不利影响。

5、信用风险

信用风险是指交易对手是否能够实现承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手

未能按时履约的风险。

信用风险是交易对手的违约风险，主要体现在信用产品中。在资产管理计划财产投资运作中，对信用产品的判断不准确，可能使资产管理计划财产承受信用风险所带来的损失。

6、募集失败、提前终止及延期的风险

(1) 募集失败风险

本计划初始募集期规模下限为1000万元，投资者的人数不少于2人（含）且不超过200人。在集合计划初始募集期结束时，如果不满足未达到集合计划成立条件的，集合计划设立失败，因此投资者可能面临集合计划设立失败的风险。

管理人的责任承担方式：

- 1) 以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2) 在本集合计划募集期限届满（确认本集合计划无法成立）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。

(2) 提前终止风险

发生本合同约定的提前终止情形或其他法定情形（包括但不限于本计划未取得基金业协会出具的备案证明等情形）时，资产管理人将按照法律法规、本合同以及其他规定提前终止本计划，从而可能会影响本计划的投资表现。

(3) 延期风险

本计划存续期限届满时，如发生本合同约定情形，本计划期限将会延长，由此可能造成本计划投资者不能及时获得受托财产

7、关联交易风险

本计划可以将受托资产投资于管理人及管理人关联方所管理的公募基金、金融衍生品等。此种投资、交易行为构成关联交易，存在被监管层否定的政策风险和相应的关联交易风险。若本计划投资运作中发生此类关联交易，管理人将按照资产管理合同约定的方式向投资者进行披露。

8、操作或技术风险

(1) 技术或系统风险：在集合资产管理计划的日常交易中，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投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等等。

(2) 流程风险：管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或操作规程不完善而引起的风险。

(3) 外部事件风险：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，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

(4) 法律风险：公司被提起诉讼或业务活动违反法律或行政法规，可能承担行政责任或者赔偿责任，有可能导致受托资产损失的风险。

9、税收风险

本集合计划所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

10、合同变更风险

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。管理人应及时通过管理人网站向投资者发出合同变更及征询公告。如果投资者未在合同变更及征询公告后的3个工作日内提出异议的，应视为其同意进行合同变更。若投资者不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利。不同意合同变更的投资者可在公告日起至合同变更生效日内的开放期退出本集合计划；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一工作日设置为临时开放期，不同意合同变更的投资者可在管理人设置的临时开放期内退出本集合计划，合同变更生效日以管理人公告为准。未在前述时间回复意见，以及未在开放期或临时开放期内退出的投资者，均视为同意本合同变更。存在投资者不同意变更而退出本集合计划的风险，从而影响投资者的资金安排和收益；存在投资者未在意见征询期间回复或未能按时退出本计划将被视为同意合同变更的风险。

11、投资标的风险

(1) 投资场内金融衍生品的风险

1) 基差风险

在使用场内衍生品合约对冲市场风险的过程中，资产管理计划财产可能因为场内衍生品合约与标的物价格波动不一致而遭受基差风险。形成基差风险的潜在原因包括：

①需要对冲的风险资产与场内衍生品标的物风险收益特征存在明显差异；

②因未知因素导致场内衍生品到期时基差严重偏离正常水平；

③因存在基差风险，在进行场内衍生品展期的过程中，受托财产可能会承受场内衍生品之间的价差向不利方向变动而导致的展期风险。

2) 杠杆风险

因场内衍生品采用保证金交易而存在杠杆，受托财产可能因此产生更大的收益波动。

3) 到期日风险

场内衍生品到期时，资产管理计划财产如持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将受托财产持有的合约进行现金或实物交割，受托财产将无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

4) 对手方风险

资产管理人运用受托财产投资于场内衍生品时，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的期货或证券公司作为经纪商，但不能杜绝所选择的期货或证券公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致受托财产遭受损失。

5) 盯市结算风险

场内衍生品采取保证金交易，保证金账户实行当日无负债结算制度，对资金管理要求较高。假如市场走势对受托财产不利，期货经纪公司或证券公司会按照合同约定的时间和方式通知资产管理人追加保证金，以使受托财产能继续持有未平仓合约。如出现极端行情，市场持续向不利方向波动导致保证金不足，又未能在规定时间内补足，按规定保证金账户将被强制平仓，甚至已缴付的所有保证金都不能弥补损失，从而导致超出预期的损失。

6) 平仓风险

在某些市场情况下，受托财产可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓，例如，这种情况可能是在市场达到涨跌停板时出现。出现这类情况，受托财产缴付的所有保证金有可能无法弥补全部损失，投资者还必须承担由此导致的全部损失。

期货经纪公司或证券公司或其客户保证金不足，又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致交易所对期货经纪公司或证券公司的经纪账户强行平仓，受托财产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

本计划参与场内衍生品交易，因市场变化导致保证金不足时，期货经纪场内衍生品将按合同约定的时间、方式通知管理人以计划资产追加保证金。当市场价格发生巨大波动时，管理人将可能被通知以计划资产大量追加保证金。若计划资产中的现金不足，无法在规定时间内、按规定方式存入所需的追加保证金，本计划所持有的未平仓合约将可能被强行平仓，导致本计划资产损失；若因场内衍生品市场流动性差造成未平仓合约平仓困难或无法平仓，可能导致本计划资产损失，甚至可能出现计划权益为负（即“爆仓”或

“穿仓”)的情形。管理人将针对上述可能的情形及时做出专业判断并最大程度避免其发生,但并不能保证上述风险不发生。

7) 连带风险

为资产管理计划财产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足,或因其他原因导致交易所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时,受托财产的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

8) 其他风险

如期货经纪公司或证券公司违反法律法规或交易所交易、结算等规则,可能会导致本受托财产受到损失。

由于国家法律、法规、政策的变化、交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因,受托财产持有的未平仓合约可能无法继续持有,受托财产必须承担由此导致的损失。

(2) 固定收益类投资标的风险

1) 银行存款、同业存单:存款银行因经营不善导致无法提款或流动性危机造成的暂时无法提款的风险,造成投资损失;

2) 债券(包括在依法设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动机制的债券):本计划投资债券等固定收益率资产可能面临利率、汇率变化等市场风险、债券价格波动风险、债券预期收益变动的可能性及变动幅度与债券交易产生的债券价差损失、债券发行主体因经营不善造成债务违约导致的投资损失等;

3) 资产支持证券:资产证券化过程中的基础资产信用风险主要来自于基础资产质量上。主要体现为原始权益人不能按时或不能对基础资产进行清偿,使得投资者可能无法获得约定的投资收益;由于基础资产债务人有提前偿还债务的权利,一旦提前还款,也会对投资者的收益产生较大的影响。此外,由于资产证券化的本身具有复杂性和创新性,同时资产证券化的各类资产的特性、信用增级方式、市场利率变化等因素,可能造成兑付、逾期等投资风险;

4) 可转债、可交债:可转债、可交债的投资存在波动性风险,具体表现为可转债、可交债的价格受到其相对应股票价格波动的影响,同时可转债、可交债还有信用风险和转股风险。转股风险指相对应股票价格跌破转股价,不能获得转股收益,从而无法弥补当初付出的转股期权价值;

5) 债券回购:由于市场或本计划流动性原因无法回购债券导致的违约风险,以及市场利率变动的风险;

6) 货币市场基金:根据金融产品的投资特点不同而呈现不同风险,由于不同的金融产品的管理人管理水平以及金融产品本身的风险水平,由此会产生影响本计划收益的特殊风险。

(3) 资产管理产品投资标的风险

本计划部分资产将配置于金融监督管理部门批准或备案发行的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(包括券商集合资产管理计划、基金公司及基金子公司发行的资产管理计划、期货公司发行的资产管理计划、保险资产管理计划等),投资上述资产管理产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响,请投资者知悉。

1) 资产管理产品管理人风险

资产管理产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险是指因管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内控管理等因素导致公司经营不善,极端情况下甚至破产倒闭,可能对其管理人的产品业绩造成不利影响。另外,对于约定了止损条款的资产管理产品,可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。

2) 资产管理产品投资风险

本计划所投资的资产管理产品可能由于其管理人对市场判断失误、买入标的市场表现不佳、风险控制失效等原因造成产品净值的下降，从而造成资产管理计划净值下降，最终导致资产管理计划投资者资产损失。

3) 策略模型风险

在实际运作中，因资产管理产品的投资经理变更导致模型无法有效运作，开发的策略或模型不再有效或者在运作过程中与产品期初投资策略和投资风格发生偏离，进而影响产品投资业绩。

4) 产品的关联交易风险

本计划所投资的底层私募权益类标的可能会涉及ETF基金、LOF基金、分级基金等。实际底层私募投资过程中，不排除涉及关联关系公司的关联交易。

5) 赎回资产管理产品面临的流动性风险

因本计划投资者赎回或资产配置调整需要，管理人赎回资产管理产品时，可能触发资产管理产品大额赎回或巨额赎回条款，导致赎回资金延迟到账的风险。

6) 投资资产管理产品可能面临双层收费的风险

本计划投资者需要承担双层费用，即本计划费用以及本计划所投资的资产管理产品自身需要承担费用。本计划所投资的资产管理产品自身需要承担费用包括资产管理产品的管理费、托管费、业绩报酬（如有）、认购费（如有）、赎回费（如有）等，以上费用在计提时将会扣减资产管理产品的资产净值，从而造成资产管理计划净值下降。

7) 投资资产管理产品的估值风险

①本计划投资多个底层资产管理产品，每个资产管理产品的估值时间可能不一致，且披露时间可能不一致，本计划按照底层资产管理产品估值日最近的单位净值进行估值。在存续期间，本计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。

②如计划投资标的采用“虚拟净值”作为公允价值估值，可能引发客户损失的风险。由于本计划在开放日但投资的基金产品未开放的，对于下层投资标的如采用“虚拟净值”（对下层投资标的未扣除业绩报酬的净值，本计划管理人（或下层投资标的管理人）按下层投资标的合同约定计算并扣除业绩报酬金额后的净值）作为公允价值进行估值，因与下层投资标的的业绩报酬实际提取存在时间差，可能与下层投资标的实际提取业绩报酬金额后的净值存在差异，可能导致本计划净值存在误差，从而可能引发客户损失。

8) 底层资产管理产品提取业绩报酬对产品净值造成下跌的风险

由于本计划投资多个资产管理产品，每个资产管理产品在业绩报酬计提方式、业绩报酬计提时间以及产品估值时间与本计划层面可能不一致，当底层资产管理产品提取业绩报酬后可能造成本计划净值下降、投资者持有本计划份额期间收益下降的风险。

9) 本计划会因巨额赎回而造成部分退出的风险，如果顺延退出后，本计划的单位净值继续下降，投资者可能会因此导致亏损。

在集合计划存续期间可能发生投资者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。对于投资者而言，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。

(4) 投资股票面临的风险

1) 上市公司经营风险：上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如本计划所投资的上市公司经营不善，与其相关的证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使本计划投资的收益下降。

2) 流动性风险：证券市场受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，某些实际成

交活跃、流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本或出现变现困难，对本计划投资造成不利影响。

3) 退市风险：根据相关法律法规和交易规则，上市公司股票可能面临退市风险。启动退市程序后可能出现股票价值大幅度下跌、流动性大幅度降低等状况，从而造成计划投资出现亏损。

4) 股票价格波动的风险：股票的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，从而使本计划收益水平发生变化、产生风险。

(5) 所投资公募基金的特别风险

本集合计划可能投资于公募基金，管理人对发行公募基金公司的内控信息获取不全，控制力不强，并且所投资公募基金的管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如变更投资经理、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公募基金的收益水平，从而产生风险。

12、特定的投资方法可能引起的特定风险

(1) 当本计划根据投资策略发生本合同约定的提前终止事件时，管理人将提前终止本计划并进行清算。由于本计划提前终止观察日份额净值所反映的持仓价值至份额净值披露日之间、份额净值披露日与管理人对本计划投资仓位完全变现之间存在时滞，市场环境可能发生不利变化，以及管理人计算提前终止事件是否发生时使用的份额净值未考虑资产变现成本、清算费用及相关税费等，致使本计划实际清算收益可能低于本计划业绩表现及本合同约定的止盈目标，投资者可能无法实现预定投资目标。投资者应充分知晓本计划根据投资策略提前终止的相关风险，其风险应由投资者自担。

(2) 因资产净值规模较小而被动清盘的风险

资产管理计划净值低于1000万元时，若资产管理人本着勤勉尽责的原则下认为资产管理计划规模过小而不再适宜继续运作的，本计划可能提前终止。

(3) 投资标的集中度可能较高的风险

本计划主要投资股指期货合约、ETF基金、指数增强基金等投资标的，当本计划投资于该等投资标的的比例较高时，本计划的风险收益情况可能主要由该等投资标的的投资情况决定。当该等投资标的出现投资风险导致收益情况下降时，将影响本计划的风险收益情况。

(4) 策略失效风险

本计划通过精选股指期货合约、ETF基金、指数增强基金等投资标的，主要采用分批投资的运作方式以平滑组合波动，并在本计划触发提前终止事件后进行提前终止操作并进行资产变现清算。在实际运作中，由于本计划投资经理变更、法律法规或监管要求发生变化或因市场风险、操作风险、政策风险等原因可能导致本计划采用的策略无法实现、不再有效或在运作过程中与本计划期初投资策略发生偏离，进而影响本计划收益。

(5) 本计划投资者的投资收益和投资标的的所涉跟踪标的表现相关。本计划主要精选股指期货合约、ETF基金、指数增强基金等投资标的，上述投资标的主要跟踪中证500指数（代码：000905.SH），该指数并不能完全代表整个A股股票市场。中证500指数的平均回报率与整个A股股票市场的平均回报率可能存在偏离。中证500指数的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，直接影响指数标的表现。当该标的在本计划存续期内的下跌幅度过大时，本计划净值的跌幅可能会超过指数跌幅，本计划可能产生较大亏损，投资者将面临较大损失。

(三) 其他风险揭示

1、投资者无法参与或被暂停退出的风险

(1) 管理人认定不能接受新的参与申请时，投资者具有无法参与及投资者无法追加参与的风险。

(2) 本计划关于暂停退出的情况及处理方式的安排中，管理人可以暂停接受投资者的退出申请，因此，投资者可能面临份额暂时不能退出的风险。请投资者注意。

(3) 本计划存续期间，集合计划终止条件触发，或管理人根据本合同决定终止集合计划，投资者可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险，存续期内，符合资产管理合同规定情形，导致本计划提前终止。

2、使用电子签名合同的风险

本计划《集合资产管理合同》如采用电子签名方式签署，所以在集合计划的交易过程当中，可能存在以下风险：

(1) 由于互联网和移动通讯网络数据传输等原因，交易指令可能会出现中断、停顿、延迟、数据错误等情况；

(2) 投资者账号及密码信息泄露或客户身份可能被仿冒；

(3) 由于互联网和移动通讯网络上存在黑客恶意攻击的可能性，网络服务器可能会出现故障及其他不可预测的因素，交易信息可能会出现错误或延迟；

(4) 投资者的网络终端设备及软件系统可能会受到非法攻击或病毒感染，导致电子签名合同数据无法传输或传输失败。

3、突发事件风险

(1) 因业务竞争压力可能产生的风险；或者管理人、托管人因丧失业务资格、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，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

(2) 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投资者利益受损。

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) 发生可能导致集合计划短时间内发生巨额退出的情形；

2) 集合计划终止时，证券资产无法变现的情形；

3) 相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；

4) 交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行。

4、适当性相关风险

(1) 投资者有义务保证其提供的相关信息及材料真实、准确、完整。管理人及销售机构（如有）评定投资者的风险承受能力、作出适当性匹配意见系基于投资者提供的相关信息及证明材料真实、准确、完整的前提下作出；如投资者提供的信息及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，可能会导致投资者的风险承受能力评定、适当性匹配意见存在偏差、与实际不符的风险，管理人及销售机构（如有）有权拒绝为投资者提供服务或拒绝接受投资者的交易申请、业务申请，相关风险、责任、损失由投资者自行承担。

管理人及销售机构（如有）禁止其工作人员为影响评估结果在投资者填写基本信息表、风险承受能力评估问卷时进行提示、暗示、诱导。投资者知晓管理人及销售机构（如有）工作人员存在前述行为，仍遵照配合致使所提供的信息及材料不真实、不准确、不完整，或存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏等情形的，视为投资者违反其应履行的适当性义务，投资者应承担由此产生的后果、损失、责任。

(2) 投资者在其信息发生重要变化、可能影响管理人及销售机构（如有）对其作出的投资者类别划分、风险承受能力认定时，应主动告知管理人及销售机构（如有），以便管理人及销售机构（如有）作出调整。若投资者未能及时有效告知管理人及销售机构（如有），则存在适当性匹配意见与实际不符的风险，进而可能产生应由投资者自行承担的相应风险、责任、损失。

(3) 投资者或产品的信息发生变化时，管理人及销售机构（如有）有权主动调整投资者的投资者分类、产品的风险等级以及适当性匹配意见。管理人及销售机构（如有）作出主动调整的，投资者的交易或者购买产品的资格可能受到影响，进而产生相应的风险。

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/机构做出以下陈述和声明，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，资产管理人、销售机构、资产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》等相关法律法规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真实、准确、完整地提供相关证明文件。【_____】

4、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同及附件的所有内容，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“四、当事人及权利义务”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“十一、资产管理计划的投资”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“二十、资产管理计划的费用与税收”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“二十六、争议的处理”中的所有内容。【_____】

9、本人/机构已经配合资产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资产管理人投资能力、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。【_____】

(注：自然人投资者请签字；机构投资者请加盖机构公章并由法定代表人或授权代表签章)

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）：

日期：

