

合同编号：DFCFZQ-（2023）-ZZTL006-0001

东方财富证券周周添利 6 号 集合资产管理计划资产管理合同

管理人：东方财富证券股份有限公司

托管人：上海银行股份有限公司

2023 年 5 月



目 录

一、前言.....	3
二、释义.....	4
三、承诺与声明.....	7
四、当事人及权利义务.....	9
五、资产管理计划的基本情况.....	14
六、资产管理计划的募集.....	16
七、资产管理计划的成立与备案.....	18
八、资产管理计划的参与、退出与转让.....	18
九、份额持有人大会及日常机构.....	28
十、资产管理计划份额的登记.....	28
十一、资产管理计划的投资.....	28
十二、投资顾问.....	34
十三、分级安排.....	34
十四、利益冲突及关联交易.....	34
十五、投资经理的指定与变更.....	36
十六、资产管理计划的财产.....	36
十七、投资指令的发送、确认和执行.....	38
十八、越权交易的界定.....	41
十九、资产管理计划财产的估值和会计核算.....	44
二十、资产管理计划的费用与税收.....	49
二十一、资产管理计划的收益分配.....	53
二十二、信息披露与报告.....	54
二十三、风险揭示.....	56
二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算.....	65
二十五、违约责任.....	69
二十六、争议的处理.....	70
二十七、资产管理合同的效力.....	70
二十八、其他事项.....	71
附件一：风险揭示书.....	74

重要提示

《东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合资产管理合同”、“资产管理合同”或“本合同”）以电子签名方式签订的，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；投资者（东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，如以电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。托管人仅认可通过中国证券登记结算有限责任公司系统进行合同文本及电子数据相关传输保存。

投资者、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》的有关规定，投资者以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、《东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划说明书》（以下简称“说明书”）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、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。

一、前言

为规范东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”或“本集合计划”）运作，明确《东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划资产管理合同》当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国期货和衍生品法》、《中华人民共和国电子签名法》、《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）》、《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》，与前述《管理办法》合并简称《资管细则》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》等法律法规、中国人民银行、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定，投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。

本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照上述法律法规的相关规定、《东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划说明书》、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

投资者承诺以真实身份参与资产管理计划，保证参与资金的来源及用途合法，所披露或提供的全部信息和资料真实、准确、完整，并已认真阅读、充分理解、自愿接受本合同、说明书及其他合同附件，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。投资者承诺参与资金并非从他人处筹集所得，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。

投资者应当遵守国家有关反洗钱的法律法规，并向管理人提供法律法规规定的信息及身份证明文件，配合管理人履行反洗钱客户身份识别、大额交易和可疑交易报告等义务。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责、谨慎勤勉的原则管理和运用受托资产，但不保证本计划的最低收益，也不保证本金不受损失。管理人在任何报告或文件中向投资者介绍的业绩比较基准（如有）仅为管理人根据市场情况及本资产管理计划运作特征进行的预估，供投资者参考，不构成管理人保证受托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，保护投资者受托资产的安全，但不保证投资者受托资产本金不受损失或取得最低收益。

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。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。

二、释义

在本合同中，除上下文另有解释或特别说明，下列用语应当具有如下含义：

1、集合资产管理计划、集合计划、资产管理计划、本计划：指东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划。

2、集合资产管理合同、资产管理合同、资管合同、本合同：指投资者、管理人和托管人签署的《东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同及附件的任何有效补充及变更。

3、资产管理计划资产、资产管理计划财产、受托资产、受托财产：指投资者拥有合法处分权、并向管理人交付，由管理人以本计划名义按照《资产管理合同》投资运作管理的财产及其产生的损益、孳息等。

4、说明书：指《东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划说明书》及其的任何有效补充及变更。

5、风险揭示书：指《东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理风险揭示书》及其的任何有效补充及变更。

6、托管协议：指管理人与托管人签订的《东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划托管协议》以及对该协议的任何有效补充及变更。

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

8、《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》。

9、《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》。

10、《适当性管理办法》：指 2020 年 10 月 30 日中国证券监督管理委员会发布的《证券期货投资者适当性管理办法》。

11、《实施指引（试行）》：指 2017 年 6 月 28 日中国证券业协会发布的《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》。

12、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

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。

13、投资者：指依据本合同参与本计划的合格投资者。

14、管理人、资产管理人：指东方财富证券股份有限公司。

15、托管人、资产托管人：指上海银行股份有限公司。

16、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投资者、管理人和托管人。

17、销售机构：指东方财富证券股份有限公司以及其他具有公开募集证券投资基金销售资格并与管理人签订代销协议的销售机构。

18、登记结算业务：指本计划登记、存管、过户、清算和交收业务。具体内容包括投资者账户的建立和管理、资产管理计划份额登记结算、交易确认及清算、代理发放红利、建立并保管投资者名册等。

19、注册与过户登记人：指办理本计划注册登记业务的机构，即东方财富证券股份有限公司。

20、份额持有人：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投资者。

21、管理人网站：指东方财富证券股份有限公司官方网站（www.18.cn）。

22、初始募集期：指集合计划自开始初始募集之日起至初始募集期截止日，集合计划的初始募集期自集合计划份额发售之日起不得超过 60 天，具体时间见管理人网站公告。

23、计划成立日：指集合计划经过募集达到集合计划说明书和集合资产管理合同约定的成立条件后，管理人公告集合计划成立之日。

24、中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

25、基金业协会、证券投资基金业协会：指中国证券投资基金业协会。

26、中登公司：指中国证券登记结算有限责任公司。

27、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。

28、交易日、工作日：指境内证券交易所的正常交易日。

29、封闭期：指集合计划存续期间除开放期（含临时开放期）之外的其他时间，在此期间投资者不得参与、退出本计划。

30、开放期：指集合计划成立后，为投资者办理参与、退出等业务申请的日期。

31、开放日：指开放期内的每个工作日。

32、存续期：指集合计划成立并存续的时间。

33、认购：指本集合计划投资者在初始募集期内认购本集合计划份额的行为。

34、参与：指本集合计划投资者在初始募集期内认购本集合计划份额以及在存续期内申购本集合计划份额的行为。

35、首次参与：指投资者在参与之前未持有过本集合计划的情形。

36、追加参与：指除首次参与外的其他参与情形。

37、参与金额：指投资者参与集合计划时交付的受托金额或资金，参与金额包括参与费用和净参与金额。

38、净参与金额：指参与金额扣除参与费用后的余额。

39、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。

40、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。

41、退出、赎回：指集合资产管理计划投资者根据本合同约定，向管理人申请赎回集合计划份额的行为。

42、巨额退出、巨额赎回：在单个开放日，本计划净退出申请份额超过上一日本计划总份额的 10%时，即为巨额退出（巨额赎回）。

43、强制退出：指由管理人发起退出投资者持有份额的行为。

44、二次清算：指本计划终止时，集合计划中还有未能流通的证券处于合法冻结状态或其他无法变现的状态，当该证券达到可变现状态时，管理人将其变现并进行清算分配的过程。

45、T 日：指日常参与、退出或办理其他集合资产管理计划业务的工作日。

46、T+n 日：指 T 日的次日起 n 个工作日。

47、分红权益登记日（R 日）：指每次收益分配前，在收益分配方案中确定的分红权益登记日；只有在分红权益登记日（不包括本登记日）前购入的计划份额，并在权益登记日当天登记在册的份额才有资格参加分红。

48、计划收益：指本计划投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间公允价值变动、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息以及其他收益。

49、单位面值：人民币 1.00 元。

50、集合计划份额、计划份额、份额：指集合计划的最小单位。

51、资产总值：指集合资产管理计划通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行有价证券交易等投资所形成的各类资产的价值总和。

52、资产净值：指集合资产管理计划资产总值扣除负债后的净资产值。

53、单位净值：指集合资产管理计划资产净值除以计划总份额。

54、累计净值：指集合资产管理计划单位净值与单位份额历史累计分红之和。

55、法律法规：指中华人民共和国现行有效的法律、行政法规、司法解释、部门规章、及金融监督管理机构、行业自律组织、沪深交易所以及其他对《资产管理合同》当事人有监督或管理职能的机构出具的有约束力的决定、决议、通知等。

56、不可抗力：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，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、因本合同各方及/或其关联方各运营网站的系统维护、黑客攻击、电信部门技术调整或故障、网站升级等原因而造成的本合同各方及/或其关联方之服务、营业的中断或者延迟、注册与过户登记人非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易或发送数据存在延误、错漏、中国人民银行结算系统故障、开立受托财产专用银行账户的商业银行结算系统故障、计算机系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、计算机病毒攻击及其他非管理人、托管人故意造成的意外事故等。管理人或托管人因不可抗力不能履行本合同约定时，应及时通知其他各方并采取适当措施防止投资者损失的扩大。

57、关联方：指根据财政部《企业会计准则第 36 号——关联方披露》的规定，具有下列情形之一的企业或自然人：一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制或重大影响，构成关联方。

58、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。

三、承诺与声明

（一）管理人承诺

1、在签订本合同前充分向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险；

2、已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估；

3、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用受托财产，不保证受托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。

（二）托管人承诺

1、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管受托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务；

2、根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，

对管理人的投资或清算指令等进行监督；

3、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定召集份额持有人大会，维护投资者权益，份额持有人大会设立日常机构的除外。

(三) 投资者声明

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基本信息、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、投资者以自有资金参与本计划的，投资者承诺，参与资金均为本人/本机构自有资金，不以资产管理产品、合伙企业或契约等非法人形式投资者参与本计划，如投资者与其他第三方因受托财产发生纠纷的，投资者应自行解决，并不得以此对抗管理人及托管人；投资者以非自有资金参与本计划的，投资者承诺，当参与资金为资产管理产品募集的资金时，投资者应保证该资产管理产品的投资者中不包含其他资产管理产品，当参与资金来源于除公募资产管理产品外的合伙企业、契约等非法人形式时，最终投资者应满足法律法规、监管规则规定的合格投资者要求，并向管理人提供合法募集资金的证明文件、充分披露实际投资者和最终资金来源，保证所提供证明文件真实、准确、完整、合法；

3、投资者保证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；

4、投资者知晓，管理人如向投资者提供业绩报酬计提基准（如有）的，仅作为管理人计提业绩报酬的标准，不构成管理人保证受托财产本金不受损失或者取得最低投资收益的承诺；

5、投资者承诺遵守《中华人民共和国反洗钱法》等相关法律、法规，承诺参与资产管理业务的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益，承诺投资资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；投资者承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或控制权结构、受益所有人信息等资料，积极配合管理人及托管人履行反洗钱职责，不借助本计划进行洗钱等违法犯罪活动；

6、投资者签署和履行本合同系其真实意思表示，已经按照其章程或者其它内部管理文件的要求取得合法、有效的授权，且不会违反对其有约束力的任何合同和其他法律文件；投资者已经或将会取得签订和履行本合同所需的一切有关批准、许可、备案或者登记；

7、投资者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。

四、当事人及权利义务

(一) 投资者、管理人和托管人的基本情况

1、投资者

(自然人客户填写)

投资者名称:

身份证号码:

住所:

通讯地址:

联系电话:

(机构客户填写)

投资者名称:

法定代表人:

住所:

通讯地址:

联系人:

联系电话:

签订《东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划资产管理合同》的投资者即为本计划的投资者。

本合同项下投资者参与本计划资金金额为:

人民币(大写) 元整(小写: 人民币)。

投资者应于本合同签署之日将参与资金支付至以下集合计划归集总账户:

户名: 东方财富证券股份有限公司

账号: 3100 1502 5000 5007 0477

开户银行: 建设银行上海第二支行

2、管理人

管理人名称: 东方财富证券股份有限公司

法定代表人: 戴彦

住所: 西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

通讯地址: 上海市徐汇区宛平南路 88 号金座

邮政编码: 200030

联系人: 朱冰燕

联系电话: 021-23586409

3、托管人

托管人名称: 上海银行股份有限公司

法定代表人：金煜

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

通讯地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号

邮政编码：200120

联系人：施晨杰

联系电话：021-68476402

（二）本集合计划设定为均等份额，每份份额具有同等的合法权益。

（三）投资者的权利和义务

1、投资者的权利

- （1）分享资产管理计划财产收益；
- （2）取得分配清算后的剩余资产管理计划资产；
- （3）按照资产管理合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- （4）根据资产管理合同的规定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会，行使相关职权；
- （5）按照法律法规及资产管理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）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。

2、投资者的义务

- （1）认真阅读资产管理合同及说明书，保证以真实身份参与资产管理计划，保证投资资金的来源及用途合法，向管理人或销售机构如实提供财务状况及投资意愿等基本情况；不得使用贷款、发行债券等筹集的资金参与资产管理计划；
- （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受能力问卷，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) 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。

(四) 管理人的权利和义务

1、管理人的权利

(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、业绩报酬（如有）及其它费用（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) 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。

2、管理人的义务

(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、谨慎勤勉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；

聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；

(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、投资意向等信息，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) 召集资产管理计划份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；

(15) 按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；

(16) 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；

(17) 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；

(18) 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；

(19) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；

(20) 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；

(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) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(23) 建立并保存投资者名单；

(24) 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；

(25) 保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户；

(26) 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；

(27) 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；

(28) 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。

（五）托管人的权利与义务

1、托管人的权利

- （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）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。

2、托管人的义务

- （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中的财务数据，并出具书面意见；
- （9）编制托管年度报告，并报送中国证监会相关派出机构；
- （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）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；
- （12）保守商业秘密，除法律法规、资产管理合同及其他有关规定或有权机构另有要求外，不得向他人泄露；
- （13）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；
- （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；
- （16）应管理人要求，托管人可配合提供关联方名单；

(17) 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。

五、资产管理计划的基本情况

(一) 资产管理计划的名称

东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划。

(二) 资产管理计划的类别

固定收益类集合资产管理计划。

(三) 资产管理计划的运作方式

开放式。本计划自成立之日起每周开放一次，开放日为周一，接受投资者的参与、退出申请。如拟开放日为非交易日的，管理人有权决定顺延至下一交易日或调整当周开放日安排，具体开放事宜以管理人公告为准，**资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。**

(四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

1、投资目标

在有效控制投资风险的前提下，力争实现资产管理计划资产的持续稳健增值。

2、主要投资方向

(1) 固定收益类资产：包括现金、银行存款、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（包括但不限于次级债、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、国际开发机构人民币债、外国主权政府人民币债券、永续债、公司债（包括但不限于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（包括但不限于非公开发行、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（包括但不限于质押式回购、质押式协议回购、买断式回购等）、中期票据、短期融资券（包括但不限于超短期融资券）、标准化票据、非公开定向债务融资工具以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等；

(2) 权益类资产：因可转换债转股或可交债换股形成的权益类资产；

(3) 资产管理产品：包括公开募集证券投资基金（包括但不限于公募 reits、同业存单基金、债券型基金等）、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；本计划投资于资产管理产品可能涉及间接投资于标准化固定收益类资产、权益类资产、期货和衍生品类资产；

(4) 期货和衍生品类资产：国债期货（仅限套期保值）；

(5) 债券正回购（包括但不限于质押式回购、质押式协议回购、买断式回购等）。

如本合同存续期内市场出现新的投资品种，在法律法规、监管机构允许的前提下，经全

体投资者、资产托管人、资产管理人一致同意，可纳入投资范围。

3、投资比例

(1) 穿透后投资于固定收益类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%；穿透后投资于期货和衍生品类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 20%，且衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%；

(2) 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；

(3) 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；

(4) 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。

本计划所有投资者签署即表示同意，在本计划存续期间，为规避特定风险，管理人投资于固定收益类资产的比例可以低于资产管理计划资产总值的 80%，但不得持续 6 个月低于资产管理计划资产总值的 80%。“特定风险”主要指因市场剧烈波动、市场或本计划发生重大流动性风险事件或重大信用风险事件、本计划所投资资产之风险收益特征发生重大变化等因素对本计划产生不利影响的风险。

4、产品风险等级

本计划属于 R2 风险等级的产品，适合风险承受能力为 C2 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。

(五) 资产管理计划的存续期限

本计划存续期限为自本计划成立之日起 10 年。自本计划成立之日起算，可展期。

(六) 资产管理计划份额的初始募集面值

本计划份额的初始募集面值为人民币 1.00 元。

(七) 资产管理计划的最低初始募集规模

本计划的最低初始募集规模不低于 1000 万元。

(八) 资产管理计划的分级安排

本计划不设置分级。

(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

东方财富证券股份有限公司

(十) 封闭期、开放期及流动性安排

1、封闭期：本计划除开放期（包括临时开放期）外均为封闭期，原则上封闭期内不办理参与、退出业务。

2、开放期：本计划自成立之日起每周开放一次，开放日为周一，接受投资者的参与、

退出申请。如拟开放日为非交易日的，管理人有权决定顺延至下一交易日或调整当周开放日安排，具体开放事宜以管理人公告为准，**资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。**

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本计划管理人自有资金参与比例超标时，设置临时开放期供管理人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。**

4、为保障客户资金的流动性，管理人在开放期内确保本集合计划资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。本计划每季度多次开放，全部资产投资于标准化资产，且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计划资产净值的 20%。

六、资产管理计划的募集

（一）募集对象

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为 C2 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推介。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划的要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

合格投资者指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额（金额按照《指导意见》等现行相关法律法规要求确定）且符合下列条件的自然人、法人或其他组织：

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。

属于上述第 4 条的投资者应当保证投资本计划不存在违犯监管要求的多层嵌套，不存

在以投资本计划从事规避投资范围、杠杆约束等监管要求的行为。如管理人有合理理由认为其投资本计划不符合监管要求的，管理人有权拒绝其参与申请，已经参与的，管理人有权强制退出其持有的份额。

投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划。如未来法律法规或监管机构对合格投资者有新规定的，本集合计划将按新规执行。本集合计划面向特定的投资者募集，对于未经管理人认可的投资者，管理人有权拒绝其参与申请，已经参与的，管理人有权强制退出其持有的份额。

投资者如为管理人的董事、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的，应在参与本集合计划时特别告知管理人，并且在此同意并授权管理人可以按照有关规定对此次投资行为进行披露、监控以及向有权机构报告。

（二）募集方式

本集合计划通过销售机构面向合格投资者以非公开方式进行募集。

（三）募集期限

本集合计划初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 天，具体时间见有关公告。管理人可以根据实际情况提前结束初始募集期。

（四）销售机构

本集合计划的销售机构是东方财富证券股份有限公司以及其他具有公开募集证券投资基金销售资格并与管理人签订代销协议的销售机构。

（五）认购事项

1、认购费用

本计划不设认购费。

2、认购申请的确认

投资者在初始募集期 T 日申请认购，管理人在 T+1 日内对该申请的有效性进行确认，投资者可在集合计划正式成立后到销售网点查询成交确认结果、打印成交确认单。

3、认购份额的计算方式

认购份额=认购参与款项（不含认购费用）/集合计划份额面值+认购参与款项在初始募集期内产生的利息/集合计划份额面值。

4、初始认购资金的管理及利息处理方式

投资者的认购参与款项（不含认购费用）加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有。

（六）本计划的最低认购金额及支付方式

单个投资者首次参与的最低金额为人民币 30 万元（不含认购费/申购费）。对于已经是本集合计划的持有人，其新增参与资金的最低金额为人民币 1 万元（不含认购费/申购费）；将红利再投资本计划的份额不受上述限制。

在初始募集期内或开放期内，投资者可多次参与，参与一经受理不得撤销。投资者参与本计划采取全额缴款的方式。

（七）募集结算专用账户和销售机构委托募集账户（如有）的披露渠道和查询方式

管理人在集合计划募集公告中披露募集结算专用账户、直销募集账户的相关情况，投资者随时可以通过管理人网站进行查询。管理人可以根据存续期间实际管理需要，新增或者变更本集合计划销售机构时，将提前在管理人指定网站上公告，并对销售机构与委托募集账户的情况进行说明。

七、资产管理计划的成立与备案

（一）资产管理计划成立的条件

1、初始募集规模不低于 1000 万元，投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

2、资产管理计划在取得资金到账通知书后，公告资产管理计划成立。

（二）资产管理计划成立的时间

资产管理计划在募集金额缴足之日起 10 个工作日内，并在取得资金到账通知书后公告集合计划成立。资产管理计划成立的时间为公告所记载的成立日。如法律法规或监管文件另有规定，从其规定。

（三）资产管理计划的备案

管理人应在资产管理计划成立起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案。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。

资产管理计划在成立后备案完成前，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。如法律法规或监管文件另有规定，从其规定。

（四）募集失败的处理方式

集合计划初始募集期结束，集合计划未达到上述集合计划成立条件的，或发生使集合计划无法设立的不可抗力事件，集合计划募集失败。

募集期限届满，资产管理计划未达到成立条件的，管理人应当承担下列责任：

- 1、以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- 2、在募集期届满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。

计息期间及利息金额以本计划注册与过户登记人的记录为准。

八、资产管理计划的参与、退出与转让

（一）资产管理计划的参与

1、参与的场所及办理时间

(1) 参与的场所

本集合计划的销售机构是东方财富证券股份有限公司以及其他具有公开募集证券投资基金销售资格并与管理人签订代销协议的销售机构。

本集合计划的参与和退出将通过销售机构进行。投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的参与和退出。

(2) 初始募集期参与的开放日及时间

在初始募集期内，投资者在工作日内可以参与本计划。本计划的初始募集期最长不超过 60 天。如本集合计划在初始募集期内参与金额达到 1000 万元且投资者不少于 2 人时，管理人可提前终止初始募集期。

(3) 存续期参与的开放日及时间

本集合计划存续期间，投资者可在参与开放期办理参与事宜。

本计划自成立之日起每周开放一次，开放日为周一，接受投资者的参与申请。如拟开放日为非交易日的，管理人有权决定顺延至下一交易日或调整当周开放日安排，具体开放事宜以管理人公告为准，**资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。**

2、参与的价格及方式

(1) “未知价”原则，即存续期参与的价格，以受理申请当日集合计划每份额净值为基准进行计算；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；

(2) 采用金额参与的方式，即以参与金额申请。

3、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，持有效身份证件，在规定的交易时间段内提交参与申请；

(2) 本计划的参与申请可以采用电子签名的方式提交。投资者应当根据销售机构的要求签署电子签名约定书或如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，销售机构应当按照有关规定对投资者提供的信息和资料进行审查并如实记录。投资者保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。投资者根据销售机构的程序，到销售机构指定网点或管理人直销柜台申请参与集合计划，或登录销售机构指定网络系统以自主下单方式申请参与集合计划。

(3) 投资者作为本合同一方，以纸质签名方式或电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款；管理人、托管人作为本合同签署方，已经接受本合同全部条款。投资者签署本合同的同时，本合同成立。

(4) 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。

(5) 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有效后，构成本合同的有效组成部分；

(6) 投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销；

(7) 投资者在初始募集期及/或存续期间可多次参与，投资者在认购申请时一旦完成资金交付，则认购申请不能撤销；

(8) 投资者应当以真实身份参与本计划，任何人不得非法汇集他人资金参与本计划；

(9) 投资者参与本计划，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。如果投资者资金在规定时间内未全额到账，则仅以其到账金额确定其有效申请份额；若到账金额低于本计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回投资者账户；

(10) 投资者在初始募集期 T 日参与的申请，管理人在 T+1 日内对该申请的有效性进行确认，投资者可在集合计划正式成立后到原销售网点查询成交确认结果、打印成交确认单；

(11) 投资者在存续期 T 日参与的申请，管理人在 T+1 日内对该申请的有效性进行确认，投资者在 T+2 日后（含当日）可向集合计划销售机构查询参与情况。

4、参与的金额限制

投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应满足资产管理计划最低参与金额限制（不含参与费用），已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。

5、参与的费用及参与份额的计算方式

(1) 参与费率

认购费：初始募集期参与集合计划的参与费率为 0%；

申购费：开放期参与集合计划的参与费率为 0%。

本计划的参与费采取前端收取模式。参与费由投资者承担，不列入资产管理计划资产。参与费用归销售机构所有，销售机构在法律法规、销售协议许可的前提下，有权减免投资者参与费用，以各销售机构的具体规定为准。

(2) 参与份额的计算方法

参与本计划的参与费用价外收取，收费模式为前端收费模式（即参与集合计划时缴纳）。投资者的参与金额包括参与费用和净参与金额。参与金额在初始募集期间形成的利息归投资者所有，具体份额以注册与过户登记人的记录为准。参与份额的计算方式如下：

$$\text{净参与金额} = \text{参与金额} \div (1 + \text{参与费率})$$

$$\text{参与费用} = \text{参与金额} - \text{净参与金额}$$

1) 初始募集期参与份额的计算：

$$\text{参与份额} = (\text{净参与金额} + \text{参与金额在初始募集期内产生的利息}) / \text{集合计划份额面值。}$$

2) 存续期参与份额的计算：

$$\text{参与份额} = \text{净参与金额} / \text{参与申请日份额单位净值。}$$

参与费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；参与金

额在初始募集期内产生的利息按银行活期存款利率计算；参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的误差计入本集合计划资产损益。

投资者多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。

6、参与资金的利息处理方式

投资者的参与资金在初始募集期产生的利息将折算为计划份额归投资者所有。

7、提前结束初始募集期的情形

(1) 在本计划的初始募集期内，若管理人决定提前结束，应提前一个工作日通知销售机构和注册与过户登记人。

(2) 在本计划的初始募集期内，管理人有权在集合计划的投资者数量接近或达到 200 人的当日，对于已提交的当日合格参与申请按“金额优先+金额相同情况下时间优先”原则予以确认，并于第二日停止接受除管理人本人之外的其他投资者的参与。

8、拒绝或暂停参与的情形及处理方式

管理人和销售机构有权根据投资者的投资经验、风险承受能力、资金来源及用途性质等决定是否拒绝投资者参与本计划。

本计划出现以下情况之一时，管理人可暂停或拒绝接受投资者的参与：

- (1) 本计划投资者的数量接近或达到 200 人；
- (2) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；
- (3) 证券交易所在交易时间非正常停市；
- (4) 管理人、托管人或注册与过户登记人的技术保障或人员支持等不充分；
- (5) 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投资者的利益；
- (6) 集合计划管理人认为会有损于现有集合计划投资者利益的；
- (7) 销售机构对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；
- (8) 其他管理人认为有必要拒绝或暂停参与申请的情形；
- (9) 法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果投资者的参与被拒绝，被拒绝的参与款项将无息退还给投资者，资产管理合同自始无效。

发生《集合资产管理合同》、《说明书》中未予载明的事项，但管理人有正当理由认为需要暂停或拒绝接受集合计划参与申请的，报经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批准后可以暂停或拒绝接受投资者的参与申请。

(二) 资产管理计划的退出

1、退出的场所及办理时间

(1) 退出的场所

本集合计划的退出将通过销售机构进行。投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务

的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的参与和退出。

(2) 退出的开放日和时间

本计划投资者参与的份额，可按本合同约定在退出开放期申请办理退出。

本计划自成立之日起每周开放一次，开放日为周一，接受投资者的退出申请。如拟开放日为非交易日的，管理人有权决定顺延至下一交易日或调整当周开放日安排，具体开放事宜以管理人公告为准，**资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。**

(3) 临时开放期的触发条件、程序及披露等安排

当发生如下情形时，管理人有权设置临时开放期：①本计划管理人自有资金参与比例超标时，设置临时开放期供管理人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。**

2、退出的价格、方式

(1) “未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出申请日（T 日）集合计划每份额净值为基准进行计算；

(2) “先进先出”原则：投资者退出集合计划份额采用先进先出的方式处理，参与确认日期在前的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出；

(3) 采用份额退出的方式，即退出以份额申请。

3、退出的程序及确认

(1) 退出申请的提出

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

(2) 退出申请的确认

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+1 日内对该申请的有效性进行确认。投资者在 T+2 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。

本计划存续期内，如任一开放日（T 日）的退出申请确认后，将导致本计划剩余投资者人数少于 2 人（不含 2 人）的，管理人有权拒绝该开放日的全部退出申请，本计划进入清算程序。对 T 日提出退出申请的投资者暂不支付退出款项，该等退出申请涉及的受托财产与本计划其他资产一并按照本合同约定的清算程序进行处理和分配。

(3) 退出款项划付

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。

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+3 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。

4、退出的金额限制

投资者每次退出份额与退出次数无限制，部分退出资产管理计划的，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。

资产管理人可根据市场情况，调整对退出份额的数量限制，资产管理人进行前述调整应提前 1 个工作日告知投资者。资产管理人在其官方网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

5、退出的费用及退出金额的计算方式

(1) 退出费用

本集合计划不收取退出费用，即退出费率为 0%。

(2) 退出金额的计算方式

可退出金额 = 退出份额 × T 日集合计划份额净值 - 管理人业绩报酬（如有）

退出费用 = 可退出金额 × 退出费率

退出净额 = 退出金额 - 退出费用

退出费用以人民币元为单位，计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位；退出净额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此产生的误差计入本集合计划资产损益。

投资者多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。

6、巨额退出的认定和处理方式

(1) 巨额退出的认定标准

本计划单个开放日(T日)，集合计划净退出申请份额超过上一日集合计划总份额的 10% 时，即认为发生了巨额退出。

(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

当出现巨额退出的情况时，集合计划管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出或部分顺延退出。

1) 全额退出：当集合计划管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序执行。

2) 部分顺延退出：当集合计划管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为支付投资者的退出申请可能会对集合计划的资产净值造成较大波动时，集合计划管理人在当日接受退出比例不低于集合计划总份额的 10% 的前提下，对其余退出申请延期予以办理。对于当日的退出申请，应当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；投资者未能退出部分，除投资者在提交退出申请时明确做出不参加顺延下一个工作日退出的表示外，自动转为下一个工作日退出处理，并以此类推，直到全部退出为止。

投资者被顺延退出的部分，退出价格以实际退出日集合计划单位净值为准；投资者被顺延退出的部分在顺延退出日不享有退出优先权。

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+3 日内将退出款项从集合计划托管专户划出。

(3) 告知客户的方式

当发生巨额退出并采用部分顺延退出或暂停退出时，集合计划管理人应在 5 个工作日内在管理人网站上以公告形式报告投资者，并说明有关处理方法。发生巨额退出时，管理人暂停或暂缓办理退出业务的期限不得超过 20 个工作日。

7、连续巨额退出的认定和处理方式

(1) 连续巨额退出的认定标准

如果计划连续两个开放日以上（含两日）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

当出现连续巨额退出的情况时，集合计划管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出或暂停退出。

1) 全额退出：当集合计划管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序执行。

2) 部分顺延退出：当集合计划管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为支付投资者的退出申请可能会对集合计划的资产净值造成较大波动时，集合计划管理人在当日接受退出比例不低于集合计划总份额的 10% 的前提下，对其余退出申请延期予以办理。对于当日的退出申请，应当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；投资者未能退出部分，除投资者在提交退出申请时明确做出不参加顺延下一个工作日退出的表示外，自动转为下一个工作日退出处理，并以此类推，直到全部退出为止。

投资者被顺延退出的部分，退出价格以实际退出日集合计划单位净值为准；投资者被顺延退出的部分在顺延退出日不享有退出优先权。

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+3 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。

3) 暂停退出：本计划连续 2 个开放日发生巨额退出，如管理人认为有必要，可暂停接受退出申请，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，并应在管理人网站上以公告形式报告投资者。

8、单个投资者大额退出的预约申请

(1) 单个投资者大额退出的认定标准

对单个投资者单日退出份额超过集合计划总份额 10%，即视为单个投资者大额退出。

(2) 单个投资者大额退出的申请和处理方式

投资者必须提前 15 个工作日直接或通过销售机构向管理人预约申请，否则管理人有权拒绝接受其退出申请。

9、延期支付及延期退出的情形和处理方式

发生下列情形时，管理人可延期支付退出款项或延期办理投资者退出申请：

- (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基金资产估值情况。
- (3) 证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值。
- (4) 同一开放期内连续两个或两个以上交易日发生巨额退出。
- (5) 发生继续接受退出申请将损害现有份额持有人利益的情形时。
- (6) 当前一估值日计划资产净值 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，管理人应当延期支付退出款项或延期办理退出申请。
- (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延期支付或延期退出时，已确认的退出申请，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退出申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第（4）款所述情形，按本合同的相关条款处理。在延期退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知投资者。

10、拒绝或暂停退出的情形及处理方式

- (1) 发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理投资者的退出申请：
- (2) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；
- (3) 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；
- (4) 因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额退出，导致本计划的现金支付出现困难；
- (5) 法律法规规定或中国证监会等有权机关认定的其它情形。

发生上述情形之一的，已接受的退出申请，集合计划管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分由集合计划管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付，但最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并报告给投资者。

暂停集合计划退出，集合计划管理人应及时报告投资者，并制定相应的补救措施。

发生本合同、说明书中未予载明的事项，但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停或拒绝接受集合计划退出申请的，集合计划管理人应当在管理人网站上以公告形式及时报告投资者，并在经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批准后可以暂停或拒绝接受投资者的退出申请。

11、重新开放退出的公告

如果发生暂停开放日退出的情况，管理人应在导致暂停退出事项消失后的 20 个工作日内设定新的开放日，并提前 2 个工作日在管理人网站上以公告形式报告投资者集合计划重新开放退出，且以后的开放日不应受当次延迟开放日的影响。

（三）资产管理计划的份额转让

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本计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。转让后，持有本计划份额的合格投资者合计不得超过 200 人，转让后投资者仍然持有计划份额的，其所持本计划资产净值应不低于 30 万元。

管理人应当在本计划份额转让前，对受让人的合格投资者身份和本计划的投资者人数进行合规性审查。受让方首次参与本计划的，应当先与管理人、托管人签订资产管理合同。

（四）资产管理计划的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等集合计划交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定规则从某一投资者集合计划账户转移到另一投资者集合计划账户的行为。

集合计划注册与过户登记人只受理继承、捐赠、司法执行以及其他形式合法财产分割或转移等情况引起的集合计划份额的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本集合计划的投资人。

继承是指集合计划份额持有人死亡，其持有的集合计划份额由其合法的继承人继承；捐赠指集合计划份额持有人将其合法持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；司法强制执行是指司法机构依据生效司法文书将份额持有人的集合计划份额强制划转给其他自然人、法人或其他组织。

办理非交易过户必须提供登记结算机构要求的相关资料，通过管理人向登记结算机构申请，对于符合条件的非交易过户申请按法律、行政法规、规范性文件的相关规定及登记结算机构的业务规则的有关规定办理。

（五）资产管理计划的份额冻结、解冻

份额冻结、解冻业务，由注册与过户登记人办理。

集合计划注册与过户登记人只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻事项。“国家有权机关”是指依照法律、行政法规的明确规定，有权查询、冻结、扣划单位或个人在金融机构存款的司法机关、行政机关、军事机关及行使行政职能的事业单位。

当集合计划份额处于冻结状态时，集合计划注册与过户登记人或其他相关机构有权拒绝集合计划份额的退出、交易或者非交易过户申请。

（六）管理人自有资金参与、退出

1、管理人自有资金参与、退出的条件、程序

（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，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：

①管理人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；

②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。

(2) 管理人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管理人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管理人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。如在公告日起至管理人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，均视为同意管理人自有资金的参与和退出安排。**投资者明确表示不同意管理人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，则视为同意管理人以自有资金参与和退出本计划的安排。**

(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，管理人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、管理人自有资金参与的方式、金额与比例

管理人及其子公司以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本计划总份额（含管理人自有资金参与份额）的 50%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因集合计划规模变动等客观因素导致管理人及其子公司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、管理人自有资金参与部分的收益分配

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。

4、风险提示

(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。

（七）投资者变更情况报送

管理人应定期将本计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

九、份额持有人大会及日常机构

所有当事人一致同意，本集合计划不设置份额持有人大会及日常机构。

十、资产管理计划份额的登记

东方财富证券股份有限公司为本集合计划办理份额登记业务，配备安全、完善的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为集合计划投资者办理集合计划账户、集合计划份额的登记、管理、托管与转托管，持有人名册的管理，权益分配时红利的登记、权益分配时红利的派发，集合计划交易份额的清算过户和集合计划交易资金的交收等服务。

本计划全体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。

十一、资产管理计划的投资

（一）投资目标

在有效控制投资风险的前提下，力争实现资产管理计划资产的持续稳健增值。

（二）投资范围及比例

1、投资范围

（1）固定收益类资产：包括现金、银行存款、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（包括但不限于次级债、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、国际开发机构人民币债、外国主权政府人民币债券、永续债、公司债（包括但不限于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（包括但不限于非公开发行、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（包括但不限于质押式回购、质押式协议回购、买断式回购等）、中期票据、短期融资券（包括但不限于超短期融资券）、标准化票据、非公开定向债务融资工具以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等；

（2）权益类资产：因可转换债转股或可交债换股形成的权益类资产；

（3）资产管理产品：包括公开募集证券投资基金（包括但不限于公募 reits、同业存单基金、债券型基金等）、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；本计划投资于资产管理产品可能涉及间接投资于标准化固定收益类资产、权益类资产、期货和衍生品类资产）；

(4) 期货和衍生品类资产：国债期货（仅限套期保值）；

(5) 债券正回购（包括但不限于质押式回购、质押式协议回购、买断式回购等）。

如本合同存续期内市场出现新的投资品种，在法律法规、监管机构允许的前提下，经全体投资者、资产托管人、资产管理人一致同意，可纳入投资范围。

2、投资比例

(1) 穿透后投资于固定收益类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%；穿透后投资于期货和衍生品类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 20%，且衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%；

(2) 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；

(3) 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；

(4) 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。

本计划所有投资者签署即表示同意，在本计划存续期间，为规避特定风险，管理人投资于固定收益类资产的比例可以低于资产管理计划资产总值的 80%，但不得持续 6 个月低于资产管理计划资产总值的 80%。“特定风险”主要指因市场剧烈波动、市场或本计划发生重大流动性风险事件或重大信用风险事件、本计划所投资资产之风险收益特征发生重大变化等因素对本计划产生不利影响的风险。

(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 个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

(四) 投资限制

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；

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；

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%；

4、本计划在开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值不低于计划资产净值的 10%；主动投资于流动受限资产的市值在开放退出期内合计不超过计划资产净值的 20%；

5、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；

6、本计划所投资信用债（含资产支持证券和资产支持票据）的债项评级在 AA（含）及以上，如无债项评级，则主体或担保方评级在 AA（含）及以上；

7、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；

8、本计划不投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产；

9、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；

10、法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。

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。

（五）禁止行为

- 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、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；
- 14、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；
- 15、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；
- 16、为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；
- 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；
- 18、开展明股实债投资；
- 19、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

（六）风险收益特征

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】，仅适合风险承受能力为【C2】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。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本集合资产管理计划的要求，自愿承担参与本集合资产管理计划投资所产生的全部风险。

（七）业绩比较基准及确定依据

本计划无业绩比较基准。

（八）投资策略

1、决策依据

本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，并以维护集合计划投资者利益作为最高准则，具体决策依据包括：

（1）国家有关法律法规、《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、本合同和说明书等有关法律性文件；

（2）宏观经济走势、财政政策和货币政策的调整及汇率、利率变化趋势；

（3）投资对象预期收益和预期风险的匹配关系。

2、决策程序

严格、明确的投资流程是本集合计划控制投资风险，进行组合投资的制度保障。本计划的管理人采取资产管理总部投资决策小组领导下的投资经理负责制，具体为在资产管理总部投资决策小组对集合计划投资组合做出战略性资产配置等重大决策；投资经理在投资决策小

组对投资组合和具体投资品种提出投资建议的前提下进行战术性的投资操作和组合构建,最后,资产管理总部设有风控专员,风控专员对集合计划投资组合进行风险评估。具体如下:

(1) 资产管理总部投资决策小组总体上指导投资管理工作

资产管理总部投资决策小组负责对本计划的投资决策进行审核,确保本集合计划不存在重大法律和政策障碍,确保本集合计划可行、有效,并根据市场行情对可能出现风险进行评估,确保本集合计划的安全、合规。

(2) 资产管理总部投资决策小组制定战略性资产配置等重大决策

资产管理总部投资决策小组通过定期和不定期的会议,对宏观经济形势、利率走势、微观经济运行环境和证券市场走势等进行综合分析,确定集合计划的下一阶段的资产配置比例;根据产品的风险收益特征,对投资经理提出的投资策略和投资方案进行审核、批复;制定其他重大投资决策。

(3) 投资经理进行战术性组合配置及优化

投资经理在遵守战略性配置原则的前提下,确定战术性的投资策略,包括通过研究当时的市场、利率政策、利率环境、行业和股票情况、具体债券的动态变化情况,通过对投资池内的证券进行检验,考虑其的流动性、相关市场信息等,根据资产配置原则和市场风险分析,构建投资组合。制定证券投资的具体操作方案,并运用现代的组合管理技术,提高投资组合的风险回报率。

(4) 资产管理总部风控专员进行风险监控

资产管理总部设有风控专员,风控专员对集合计划的日常运作进行风险监控。具体内容包包括:一方面,对集合计划运作过程中各风险指标进行日常监控与管理,跟踪投资组合风险和流动性风险等指标,提出风险控制意见。另一方面,对集合计划的市场风险和流动性风险等因素做好定期的压力测试。集合计划管理人在确保投资者利益的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理流程做出调整。

(5) 管理人在符合法律法规和监管文件的前提下,有权根据业务发展情况和内部制度规范进行决策程序的调整或更新。

3、投资管理的方法和标准

(1) 资产配置策略

本计划在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采取积极主动地投资管理策略,通过定性与定量分析,对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向等影响债券价格的因素进行评估,对不同投资品种运用不同的投资策略,并充分利用市场的非有效性,把握各类套利的机会。在风险可控的前提下,寻求组合流动性与收益的最佳配比,力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。

(2) 利率预期策略

对国债、国开债等利率品种的投资,是在对国内外经济趋势进行分析和预测基础上,运

用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债券组合的平均久期。

（3）期限结构配置策略

在确定组合平均久期后，通过数量化方法对利率进行建模，在各种情形、各种假设下对未来利率期限结构变动进行模拟分析，并在运作中根据期限结构不同变动情形在子弹式组合、梯式组合和杠铃式组合当中进行选择适当的配置策略。

（4）属类配置策略

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上存在差异，债券资产有必要配置于不同类型的债券品种以及在不同市场上进行配置，以寻求收益性、流动性和信用风险补偿间的最佳平衡点。本计划将综合流动性分析、税收、市场结构、信用分析等因素分析的结果来决定投资组合的利率债、商业银行债、存单等各个类别资产配置策略。

（5）债券品种选择策略

在上述债券投资策略的基础上，本计划对个券进行定价，充分评估其到期收益率、流动性溢价、信用风险补偿、税收等因素，选择那些定价合理或价值被低估的债券进行投资。

（6）债券回购策略

即杠杆策略，赚取套息收益；本计划基于对资金面走势的判断，选择回购品种和期限；在判断资金面趋于宽松的情况下，优先进行相对较长期限逆回购配置；反之，则进行相对较短期限回购操作。基于对资金利率水平趋于稳定的预测判断下可在保证流动性的基础上进行杠杆放大。

4、投资风险管理制度

（1）风险偏好和管理目标的设定。设定风险管理政策、目标，设置相应的组织机构，设定风险管理的范围。

（2）风险识别。公司资产管理总部和有关部门均有责任识别各自业务或职能领域中的风险和机遇，风险管理部对资产管理业务的风险识别进行确认，并对整体风险进行识别。

（3）风险评估。通过分析风险发生的驱动因素，估计所识别风险发生的概率或者可能性；以定量或定性的方法，评估在不采取风险防范措施的情况下，风险发生时可能造成的损失；分析防范特定风险所可以采取的措施和手段，将风险防范措施的成本与潜在的风险损失进行比较；评估可能的风险损失对经营目标产生影响的程度。

（4）风险响应。按照风险收益平衡原则，决定是否需要采取措施来避免、减少、转移、承担这些风险。

（5）风险监控及控制活动。公司管理层对整体风险状况的定期或不定期回顾和评价；风险管理部就风险事件和状况的定期或不定期的监控。

（6）风险报告与分析。风险管理部对风险事件进行分析，制作定期或不定期风险管理报告，及时报送公司经营管理层、各相关业务部门。

（九）建仓期

本计划的建仓期为自本计划成立之日起 6 个月。除以现金管理为目的，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外，建仓期内的投资活动，应当符合资产管理合同约定的投向。建仓期结束，本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。

（十）投资资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配

本计划投资资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配，进行以下流动性管理安排：

1、为保障客户资金的流动性，管理人在开放期内确保本集合计划资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。

2、本计划每季度多次开放，全部资产投资于标准化资产，且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计划资产净值的 20%。

3、本计划将在确定总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、银行存款的期限来确定现金类资产的配置，定期对现金类资产组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整，以保证集合计划在开放期内资产的流动性。

（十一）预警与止损

本计划不设预警止损。

十二、投资顾问

本计划不聘请投资顾问。

十三、分级安排

本计划不设置分级。

十四、利益冲突及关联交易

（一）本计划存在或可能存在的利益冲突情形

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。

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：

（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；

（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）。

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）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）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、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、披露方式、披露内容及披露频率

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。具体安排包括：

1、事前管理人应履行内部适当审批程序，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。

2、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，采取逐笔公告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。管理人应于重大关联交易完成后 5 日内通过管理人网站以公告方式向投资者和托管人披露，并向中国证监会相关派出机构报告。

3、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 个工作日内通过管理人网站以公告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。

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。

5、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的，由违约方承担相

关责任。

（三）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、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。

（四）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。

十五、投资经理的指定与变更

本计划的投资经理由管理人负责指定。本计划的投资经理为陶照、王海涛。

陶照，北京大学光华管理学院金融学硕士，CFA 三级，具备 8 年金融行业从业经验。曾在中国金融期货交易所从事衍生品产品设计与宏观研究工作。2015 年入职证券公司后从事交易与投资研究相关工作，参与交易量上千亿，具备丰富的债券组合管理经验。

王海涛，上海交通大学金融学硕士，7 年债券投研经验。曾任寰富投资咨询（上海）有限公司交易员、中证鹏元资信评估有限公司证券评级分析师、圆信永丰基金管理有限公司信用研究员、可转债研究员、专户投资经理等职。

本计划投资经理无外部兼职、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。资产管理计划的投资经理不得同时办理证券自营业务。

若因投资经理人事变动、被监管机构采取重大行政监管措施及行政处罚等原因，管理人可以根据投资及管理需求变更本计划的投资经理。投资经理变更后，管理人应在五日内在管理人网站进行公告，并及时报送中国证监会相关派出机构、中国证券投资基金业协会。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者和托管人通知的义务。

十六、资产管理计划的财产

（一）资产管理计划财产的保管与处分

1、资产管理计划财产为信托财产，其债务由资产管理计划财产本身承担，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、资产管理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、托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。

3、管理人、托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入资产管理计划财产。

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，其债权人不得对资产管理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，资产管理计划财产不属于其清算财产。

5、资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理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资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性，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

管理人、托管人对本计划的资产单独设置账户，托管人按照规定开立资产管理计划的托管专户及其他投资所需账户，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。

1、银行托管账户

托管人根据有关规定为受托资产开立专门用于保管货币形式存在的受托资金及清算交收的银行账户，该账户应遵循托管人的《单位银行结算账户管理协议》规定。托管账户应当按照证券投资基金业协会有关规定命名。托管账户不得用于提取现金。托管账户的开立和使用，仅限于满足开展资产管理业务的需要。适用托管人公布的人民币活期存款利率。在本计划存续期内，若托管行调整利率，则本计划托管账户中的存款利率将依据资产托管人的业务规则作相应调整。托管账户是指托管人在集中清算模式下，代表所托管的本计划资产与登记结算机构进行结算的专用账户，以办理相关的资金汇划业务，本计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款，均需通过该账户进行。管理人应当在托管人按照规定开立资产管理计划财产的托管账户及其他投资所需账户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。

2、证券账户（如有）、期货账户（如有）

管理人根据有关规定为本计划开立证券账户、期货账户，证券账户、期货账户应当按照证券投资基金业协会有关规定命名。

3、基金账户（如有）

管理人负责为资产管理计划开立所需的基金账户。管理人在开立基金账户时应将资产管理计划的银行托管专户作为赎回款、分红款指定收款账户。

4、银行间账户（如有）

管理人负责以本计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格，并代表本计划进行交易；管理人授权托管人负责以本计划的名义在中央国债登记结算有限责任公司、上海清算所开设银行间债券市场债券托管账户，并代表本计划进行债券交割和资金结算。

本合同当事人应当在开户过程中给予开立账户方必要的配合，并提供所需资料。

5、其他账户

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。管理人、托管人依据相关法律法规及集合资产管理合同、托管协议的约定对集合计划的各类账户进行管理。

受托资产投资定期存款，管理人应与存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件，该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书不得以任何方式被质押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。存款机构开立的银行账户，其预留印鉴必须有一枚托管人监管印章。定期存款（包括协议存款）账户开立的存款证实书或存单原件由托管人保管，存款行或管理人应当于存单开立之日起 5 个工作日内将存款证实书原件交托管人保管，存单交接原则上采用存款行或管理人上门服务的方式，存款行和管理人对所交接存单的真实性负责。对于跨行存款，管理人应先行确认授权送、取存单人员的身份信息，并提前 3 个工作日与托管人就存单的交接进行沟通。在存款行或管理人将存款证实书原件交托管人保管之前，存款证实书发生丢失、毁损、被恶意挂失等情形的，托管人不承担任何责任，托管人仅在取得存款证实书原件后履行保管职责。托管人取得存款证实书原件后，仅负责对存款证实书原件进行保管，不负责存款证实书真伪的辨别，不承担存款证实书对应存款的本金及收益的安全。

（三）集合计划财产的构成

本计划的财产包括集合计划资金购买的各类有价证券、银行存款及其应计利息，清算备付金及其应计利息，根据有关规定缴纳的保证金，应收参与款，基金投资及其分红，其他资产等。

十七、投资指令的发送、确认和执行

（一）交易清算授权

管理人应事先书面通知托管人有权发送指令的人员（下称“指令发送人员”）名单，授权通知应注明相应的权限、授权生效时间、预留印鉴和授权人签字样本。授权通知书（以下简称“授权通知”）应由管理人加盖公章并由法定代表人或其授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书。授权通知应以原件形式送达托管人，管理人发出授权通知后向托管人电话确认。授权通知的生效以托管人收到授权通知原件为前提条件，若托管人收到授权通知的日期晚于通知中注明的生效日期，则授权通知自托管人收到之日起生效。如管理人已经出具统一的授权通知书给托管人，则以统一的授权通知书为准。管理人、托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

（二）指令的内容

投资指令（以下简称“指令”）是管理人在运用受托财产时，向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应写明款项事由、支付时间、大小写划款金额、收款账户信息等，加盖预留印鉴并由被授权人签章。

（三）指令的发送、确认和执行时间与程序

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字或盖章后，代表管理人以传真/电子邮件发送指令扫描件或其他双方认可的方式向托管人发送。管理人未按照以上约定方式发送的指令，托管人有权拒绝执行。管理人有义务在发送指令后及时与托管人进行电话确认，托管人根据授权通知，对指令的预留印鉴、签字样本等审核无误后，方可执行指令。

对于管理人依照本合同及“授权通知”发出的指令，管理人不得否认其效力。管理人应按照有关法律法规和本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送指令，指令发送人员应按照其授权权限发送指令。管理人在发送指令时，应为托管人留出执行指令所必需的时间。需在发送指令日完成划款的指令，管理人应给托管人预留出距划款截至时点 2 个工作日（托管人的工作时间为 8:30-11:30; 13:30-17:00）的指令执行时间。对于银转证指令，管理人应在 T 日 12:00 之前向托管人发出划款指令；对于证转银指令，管理人应在 T 日 14:00 之前向托管人发出划款指令。晚于 T 日 12:00 接收的银转证指令和晚于 T 日 14:00 接收的证转银指令，托管人不保证划款成功。管理人在每个交易日的 14:30 以后发送的其他指令，托管人尽力配合执行，但不保证划款成功。因此导致指令未能及时执行的，托管人应及时以双方认可的方式通知管理人。由管理人原因造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由管理人承担。

资产托管人收到资产管理人发送的指令后，应对划款指令进行形式审查，验证指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签章是否和预留印鉴和签章样本相符，复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。资产托管人可以要求资产管理人邮件或传真提供必要的投资合同、专用发票等划款证明文件。托管人对于管理人提供的相关合同、交易凭证或其他证明材料的投资方向、金额、入账账户等要素是否与划款指令记载字面表述相符进行审查。资产管理人应保证上述文件资料合法、真实、完整和有效。

管理人向托管人下达指令时，应确保托管账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人。

管理人若修改或要求停止执行已经发送的指令，应先与托管人电话联系，若托管人还未执行，管理人应重新发送修改指令或在原指令上注明“停止执行”字样并由指令发送人员签字，托管人收到修改或停止执行的指令后，将按新指令执行或停止执行原指令；若托管人已执行原指令，则应与管理人电话说明，如因执行该笔指令产生的相关责任及损失由管理人承担责任。

（四）托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

资产托管人发现资产管理人发送的指令有可能违反本合同第十八章节“越权交易的界定”第（三）条“托管人对管理人投资运作的监督”的规定时，应暂缓执行指令，并及时通知资产管理人，资产管理人收到通知后应及时核对并纠正；如相关交易已生效，则应通知资产管理人在10个工作日内纠正。

（五）管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误、指令中重要信息模糊不清或不全，未按照本合同约定的传真号码、邮箱地址或双方认可的其他形式发送划款指令等。托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。

（六）更换投资指令被授权人的程序

管理人若变更授权通知（包括但不限于变更指令被授权人/发送人员、联系方式、预留印鉴、签字样本等），应当至少提前1个工作日通知托管人，向托管人送达由管理人加盖公章并由其法定代表人或其授权代表签署的被授权人变更通知原件，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书，同时电话通知托管人确认。授权变更通知的生效以托管人收到授权变更通知原件为前提条件，若托管人收到授权变更通知的日期晚于变更通知中注明的生效日期，则授权变更通知自托管人收到之日起生效。管理人对授权通知内容的变更自托管人收到原件后开始生效，在托管人收到授权通知原件前，原指令发送人员及其签字继续有效；在授权变更通知生效后，对于已被撤换的人员无权发送的指令，或被改变授权人员超权限发送的指令，管理人不承担责任。

（七）投资指令的保管

划款指令若以传真或扫描形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或扫描件。当两者不一致时，托管人以收到的划款指令传真件或扫描件为准进行操作。

（八）其他相关责任

资产托管人正确执行资产管理人发送的合法合规符合本合同和托管协议约定的有效指令，受托财产发生损失的，资产托管人不承担任何形式的责任。在遵循本合同约定的业务受理渠道及在指令预留处理的时间内，因资产托管人未能及时或正确执行合法合规符合本合同和托管协议约定的划款指令而导致受托财产受损的，托管人应承担相应的责任，但托管资金账户及其他账户余额不足或托管人遇到不可抗力的情况除外。

资产托管人根据本合同相关约定履行形式审核职责，如果资产管理人的指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能及时提供授权通知等情形，全部责任由资产管理人承担，但资产托管人未按合同约定尽形式审核义务执行指令而造成损失的情形除外。

十八、越权交易的界定

(一) 越权交易的界定

越权交易是指管理人在投资过程中发生的如下行为：

- 1、违反有关法律法规和本合同投资范围的规定进行的投资交易行为。
- 2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

(二) 越权交易的处理程序

1、管理人应向投资者和托管人主动报告越权交易，在限期内，投资者和托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对投资者和托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会。

2、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本受托财产所有。

(三) 托管人对管理人投资运作的监督

自本计划成立之日起，托管人本着勤勉尽职的原则对管理人的投资行为包括投资范围、投资比例、投资限制、投资禁止等行为进行监督，具体监督职责和监督内容以如下约定为准。托管人仅按照本第十八章节第（三）条“托管人对管理人投资运作的监督”的内容履行投资监督义务，若本第十八章节第（三）条“托管人对管理人投资运作的监督”与本合同其他章节约定不一致的，以本第十八章节第（三）条“托管人对管理人投资运作的监督”约定为准。管理人应定期提供投资监督所需的所有信息，并对所提供的信息的准确性、完整性和及时性负责，托管人按照管理人提供的信息履行了相应义务即完成了本合同项下的监督义务。

1、投资范围及比例

(1) 投资范围

1) 固定收益类资产：包括现金、银行存款、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（包括但不限于次级债、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、国际开发机构人民币债、外国主权政府人民币债券、永续债、公司债（包括但不限于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（包括但不限于非公开发行、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（包括但不限于质押式回购、质押式协议回购、买断式回购等）、中期票据、短期融资券（包括但不限于超短期融资券）、标准化票据、非公开定向债务融资工具以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等；

2) 权益类资产：因可转换债转股或可交债换股形成的权益类资产；

3) 资产管理产品：包括公开募集证券投资基金（包括但不限于公募 reits、同业存单基金、债券型基金等）、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；本计划投资于资产管理产品可能涉及间接投资于标准化固定收益类资产、权益类资产、期货和衍生品类资产；

- 4) 期货和衍生品类资产：国债期货（仅限套期保值）；
- 5) 债券正回购（包括但不限于质押式回购、质押式协议回购、买断式回购等）。

（2）投资比例

1) 穿透后投资于固定收益类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%；穿透后投资于期货和衍生品类资产的比例不超过资产管理计划总资产的 20%，且衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产的 20%；

2) 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；

3) 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；

4) 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。

上述 1) 至 3) 由管理人自行进行投资比例管控，托管人不做穿透监督。

2、投资限制

（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；

（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%；

（3）本计划在开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值不低于计划资产净值的 10%；主动投资于流动受限资产的市值在开放退出期内合计不超过计划资产净值的 20%；

（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；

（5）本计划所投资信用债（含资产支持证券和资产支持票据）的债项评级在 AA（含）及以上，如无债项评级，则主体或担保方评级在 AA（含）及以上；

（6）本计划不投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产；

（7）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；

(8) 法律法规及中国证监会规定的其他比例限制。

3、禁止行为

(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) 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；

(14) 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；

(15) 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；

(16) 为违规持有金融机构股权提供便利；

(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；

(18) 开展明股实债投资；

(19) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

投资范围、投资比例或投资限制变更，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，并应为托管人调整监督运作留出必要时间。

十九、资产管理计划财产的估值和会计核算

（一）估值目的

本计划资产估值的目的是客观、准确地反映本计划资产的价值，并为本计划份额的参与和退出提供计价依据。经本计划资产估值后确定的本计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出本计划的基础。

（二）估值时间

本计划成立后，每个交易日对资产进行估值。

（三）估值对象

运用本计划资产所购买的全部有价证券、银行存款及其他资产。

（四）估值方法

1、固定收益品种的估值方法

（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。

（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。

（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。

（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。

（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。

（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。

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前一交易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；在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值。

(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另一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，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的有明确限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

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所的收盘价估值；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）），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易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；

(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。

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。

10、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。

11、如有新增事项或变更事项，按国家有关最新规定估值。

12、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集合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。

（五）估值程序

T 日管理人对 T 日受托资产进行估值，托管人负责进行复核。估值原则应符合本合同、《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。管理人应于

估值日将净值计算结果以邮件等双方认可的方式发送给托管人。托管人于当日对净值计算结果复核后，以邮件等双方认可的方式传送给管理人，由管理人每周披露。

资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。因此，就与受托资产有关的会计问题，本受托资产的会计责任方是管理人。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，以管理人对资产净值的计算结果为准，但托管人有权向监管部门报告。

本计划份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。

（六）估值错误的处理

管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性和及时性。当份额计价出现错误时，管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

如经管理人和托管人在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见，以管理人的估值结果为准，因份额净值错误给投资人造成损失的，管理人应当承担赔偿责任，托管人不承担由此导致的损失。管理人在赔偿投资人后，有权向有关责任方追偿。

前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

1、估值错误的类型

本计划运作过程中，如果由于管理人、托管人、注册与过户登记人、或销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿并承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、估值错误的处理原则

（1）差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

（2）差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

（3）因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得

不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因管理人过错造成集合资产管理计划财产损失时，托管人应为集合资产管理计划的利益向管理人追偿，如果因托管人过错造成集合资产管理计划财产损失时，管理人应为集合资产管理计划的利益向托管人追偿。除管理人和托管人之外的第三方造成集合资产管理计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由管理人负责向差错方追偿；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、本合同或其他规定，管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、估值错误的处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改注册与过户登记人的交易数据的，由注册与过户登记人进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行说明。

(七) 估值调整的情形与处理

当发生需要估值调整的情形，例如估值日证券无交易，但最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件等管理人认为目前估值无法反映证券真实的价格时，管理人可以与托管人协商进行估值调整。如遇估值调整，管理人将在估值调整后五个工作日内进行公告。

(八) 暂停估值的情形

1、与本计划投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因停市时；

2、证券/期货经纪服务机构等外部机构未能提供估值所需资料，导致管理人（或其委托的运营服务机构）、托管人无法对计划资产进行正常估值时；

3、因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估本计划资产价值时；

4、占本计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值的情形；

5、中国证监会认定的其他情形。

（九）资产管理计划份额净值的确认

集合计划资产总值是指通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行基金、债券交易等投资所形成的各类资产的价值总和。

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。

集合计划份额净值或单位净值是指集合计划资产净值除以计划总份额。

管理人负责计算本集合计划的单位净值并经托管人复核后确认该净值。

（十）特殊情形的处理

由于本计划所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，有关会计制度变化、管理人或托管人托管业务系统出现重大故障，或由于其他不可抗力等原因，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的而造成的资产管理计划份额净值计算错误，管理人和托管人免于承担赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

由于注册与过户登记人发送的数据有误，处理方法等同于交易数据错误的处理方法。

（十一）资产管理计划的会计政策

- 1、本计划的会计政策比照现行政策或按照资产管理合同约定执行；
- 2、本计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；本计划首次募集的会计年度按如下原则：如果本计划成立少于 3 个月，可以并入下一个会计年度披露；
- 3、本计划核算以人民币为记账本位币，以人民币为记账单位；
- 4、本计划会计核算制度执行国家有关会计制度；
- 5、本计划独立建账、独立核算；管理人应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；托管人应定期与管理人就本计划的会计核算、报表编制等进行核对。

二十、资产管理计划的费用与税收

（一）费用的种类、费率、计提标准、计提方式与支付方式

1、托管人的托管费

本计划应给付托管人托管费，托管人的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.01% 的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.01\% \div 365$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日集合计划资产净值

托管人的托管费每日计提，按季支付。经资产管理人和资产托管人核对后，由资产托管人根据管理人的划款指令于每个自然季度的次月首日起五个工作日内从受托资产中一次性支付给资产托管人。若因法定节假日、休息日，或战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则顺延至情形消除后的首个工作日支付。

托管人收款账户：

户名：资产托管费

账号：PL52613

开户银行：上海银行市南分行

2、管理人的管理费

(1) 固定管理费

本计划应给付管理人固定管理费，管理人的固定管理费按前一日集合计划资产净值的 0.4% 的年费率计提，具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div 365$$

H 为每日应计提的固定管理费

E 为前一日集合计划资产净值

管理人的固定管理费每日计提，按季支付。经资产管理人和资产托管人核对后，由资产托管人根据管理人的划款指令于每个自然季度的次月首日起五个工作日之内从受托资产中一次性支付给资产管理人。若因法定节假日、休息日，或战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则顺延至情形消除后的首个工作日支付。

管理人收款账户：

户名：东方财富证券股份有限公司

账号：033212 087820 00158

开户银行：农行上海大柏树支行

大额支付号：103290015043

(2) 业绩报酬

在管理人业绩报酬计提日，管理人有权根据投资者持有的每笔受托份额期间年化收益率

(R) 情况收取业绩报酬。

1) 业绩报酬的计提原则

①业绩报酬应当从分红资金、退出资金或清算资金中提取，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。

②本计划业绩报酬计提日为本计划收益分配登记日、投资者份额退出日或本计划终止清算分配日。在收益分配登记日和本计划终止清算分配日，对本计划符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬；在投资者份额退出日，按照先进先出原则对退出份额中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬。

③本计划收益分配登记日和本计划终止清算分配日符合业绩报酬计提条件的，管理人先计提业绩报酬，再分配收益或剩余资金。在投资者份额退出日符合业绩报酬计提条件的，管理人应先将投资者申请退出的份额所对应的业绩报酬从退出金额中扣除后，再向投资者分配退出款。

④业绩报酬提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的 60%。

2) 业绩报酬的计提基准与提取比例

管理人于业绩报酬计提日，按份额认(申)购时间的不同，针对投资者每笔份额分别核算其业绩报酬核算期。业绩报酬核算期是指针对投资者所持有的每笔份额，自上一个业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日期间。

本计划的业绩报酬计提基准为 B。管理人根据当个业绩报酬核算期的受托人每笔份额期间年化收益率 (R) 对期间年化收益率 (R) 超过 B 的部分按照 S 的比例收取本计划业绩报酬。

业绩报酬计提基准是基于本计划投资范围、配置策略及相应投资品种的投资研究做出的综合评估，仅供投资者参考，业绩报酬计提基准限用于计算管理人业绩报酬，不代表管理人对本计划产品业绩做出的承诺和保证，也不构成管理人对投资者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。

3) 业绩报酬的计算方法

业绩报酬的具体计算及支付如下：

$$R = \frac{P_1^* - P_0^*}{P_0 \times D} \times 365 \times 100\%$$

其中：R 为期间年化收益率；

P_1^* 为本计划业绩报酬计提日的单位累计净值；

P_0^* 为本计划上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的单位累计净值；

P_0 为本计划上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的单位净值。

若不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，投资者初始募集期参与的，以本计划成立日为上一业绩报酬计提日；投资者存续期参与的，以投资者参与确认当日为上一业绩报酬计提日。如本集合计划存续期由于变更合同条款且涉及业绩报酬计提日调整的，以管理人届时的调整公告为准。

$$\text{管理人业绩报酬 } Y = \begin{cases} 0, & \text{当 } R \leq B \text{ 时} \\ (R - B) \times S \times G \times D / 365, & \text{当 } R > B \text{ 时} \end{cases}$$

其中：

Y 为管理人应计提的业绩报酬；

G 为投资者该笔份额的成本 = P_0 * 当个业绩报酬计提日的投资者每笔份额数量；

D 为本计划上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数；

B=3.00%，为业绩报酬计提基准；

S=50%，为业绩报酬提取比例。

业绩报酬的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入计划资产。

4) 业绩报酬的支付方式

由于业绩报酬计算涉及注册登记数据, 管理人业绩报酬的计算及复核工作由管理人完成。业绩报酬在业绩报酬计提日计提并支付, 由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额, 托管人据此计提应付管理人业绩报酬。由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令, 托管人应在收到指令的五个工作日内从本计划资产中一次性支付给管理人, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。管理人收取业绩报酬的账户同上述管理人收款账户。

3、集合计划注册登记费用

集合计划注册登记费用按有关规定列支。

4、与本计划相关的审计费

在存续期间发生的集合计划审计费用, 在合理期间内摊销计入集合计划。

本计划的年度审计费, 按与会计师事务所签订协议所规定的金额, 在被审计的会计期间, 按直线法在每个自然日内平均摊销。

5、其他费用

与本计划相关的银行结算费用、银行账户维护费、银行间市场账户维护费、开户费用及交易费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等)、基金及资产管理产品(包括但不限于公募基金、证券投资私募基金、资产管理计划等)的申购赎回费用等本计划运营或投资运作过程中发生并且按照国家有关规定可以列入的其他费用, 根据其他有关法规及相应协议的规定按费用支出金额支付, 列入或摊入当期资产管理计划财产运作费用。

6、上述费用若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。

(二) 不列入资产管理计划费用的项目

资产管理计划成立前发生的费用, 以及存续期间发生的与募集有关的费用, 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, 以及处理与本计划运作无关的事项发生的费用等不列入本计划费用。

(三) 管理费率、托管费率、费用支付时间及方式的调整

管理人和托管人与投资者履行合同变更程序后, 可根据市场发展情况调整管理费率、托管费率、费用支付时间及方式。若根据本合同约定本合同提前终止的, 则按资产管理、托管实际天数计算管理费和托管费, 并于本计划的期限届满之日支付管理人及托管人应收未收的管理费和托管费。

(四) 税收

受托资产运作过程中涉及各纳税主体, 其纳税义务按国家税收法律、法规执行。针对法律法规的变化, 管理人将按照相关法律法规要求执行。受托资产运作过程中涉及各纳税主体, 其纳税义务按税收法律法规执行。在受托资产管理、运用及处分过程中依法发生的税

费，如法律法规规定由资产管理人代扣代缴的，资产管理人有权代扣代缴。如法律法规规定本计划运营过程中发生的增值税应税行为等应税行为，以本计划管理人为增值税纳税人，除本计划已列明的资产管理业务费用产生的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，且无需事先征得投资者的同意，投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。

二十一、资产管理计划的收益分配

（一）可供分配利润的构成

本计划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。本计划净收益为本计划收益扣除按照有关规定及本合同约定可以在收益中扣除的费用后的余额。本计划存在日净收益为负值的可能。

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。

（二）收益分配原则

- 1、每份集合计划份额享有同等分配权；
- 2、当集合计划单位净值大于 1 且有可分配利润时，管理人可以进行收益分配；集合计划在收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；
- 3、集合计划每年收益分配的次数最多为 12 次，管理人可根据投资运作情况决定是否向投资者分配收益；
- 4、集合计划每次收益分配的比例不低于集合计划在收益分配基准日的可供分配利润的 10%；集合计划的分红权益登记日及收益分配基准日由管理人确定，具体分配方案、分配时间以管理人届时公告为准；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（三）收益分配的对象

分红权益登记日（在管理人公布的分配方案中确定）所有参与本集合计划的投资者。只有在分红权益登记日（不包括本分红权益登记日）前购入的计划份额，并在权益登记日当天登记在册的份额才有资格参加分红。

（四）收益分配的时间

在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，管理人可自行决定收益分配的时间。

- 1、分红权益登记日：每次收益分配前，管理人在管理人网站上发布收益分配方案，在方案中确定分红权益登记日（R 日）；
- 2、除息日：每次收益分配前，管理人在管理人网站上发布收益分配方案，在方案中确定除息日；
- 3、如投资者选择现金分红，现金红利于 R+7 日内划入投资者指定账户；

4、如投资者选择红利再投资，现金红利折算的集合计划份额按除息日当天净值转成相应的集合计划份额。红利再投资份额于 R+3 日内确认。

(五) 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，收益分配方案须载明收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容，经托管人核实收益分配总额后由管理人报告投资者。管理人至少在 R-5 工作日之前将收益分配方案向投资者公告。最终收益分配方案以管理人在管理人网站上披露的分红公告为准。

(六) 收益分配的执行方式

1、投资者可以选择收益分配方式为两种：现金分红和红利再投资；

2、投资者获得的现金分红或红利再投资份额保留到小数点后两位，第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益；

3、投资者未作选择的，按现金分红方式分配。如果选择红利再投资方式的，分红资金将按红利登记日的份额净值转成相应的份额。同一投资人持有的集合计划份额只能选择一种分红方式，如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，则注册登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准；

4、除分红权益登记日外，投资者可在计划存续期内选择变更收益分配的方式；

5、T 日申购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 日赎回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。

(七) 收益分配中发生的费用

收益分配选择红利再投资的，红利再投资的份额免收参与费；收益分配时发生的银行转账等手续费用由投资者自行承担，与收益分配、退出计划的相关税收按照国家有关规定处理。

(八) 收益分配的程序

1、管理人计算集合计划的可分配收益。

2、管理人确定分配红利的金额、时间：管理人考虑集合计划的投资策略、现金流量和客户需求，在满足本部分规定的条件下确定收益分配的具体金额和具体时间。

3、管理人制定收益分配方案。

4、计算分配金额：管理人在除息日按当日可分配金额计算最终分红数额。

5、管理人通知投资者：管理人确定收益分配方案并经托管人确认收益分配总额后，将收益分配方案在管理人网站上公布。最终收益分配方案以管理人网站上公布的分红公告为准。

6、注册登记人实施分配方案。

二十二、信息披露与报告

(一) 定期报告

包括集合计划单位净值、集合计划季度报告、集合计划年度报告和年度审计报告。

1、集合计划单位净值

本计划实行净值化管理，净值的生成应当符合企业会计准则的规定，及时反映基础金融资产的收益和风险。本计划成立后，在存续期内管理人每周在管理人网站上向投资者披露经托管人复核的上周最后一个工作日的集合计划单位净值、累计单位净值。如遇节假日，则相应顺延。

2、集合计划季度报告

管理人、托管人在每季度向投资者提供一次准确、完整的季度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况，季度报告包括但不限于下列信息：管理人履职报告；托管人履职报告；资产管理计划投资表现；资产管理计划投资组合报告；资产管理计划运用杠杆情况（如有）；资产管理计划财务会计报告（如有）；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；资产管理计划投资收益分配情况；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；中国证监会规定的其他事项。

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。管理人应当在上述信息披露时限内将当期管理报告提供给托管人复核，并给托管人预留足够的复核时间，同时托管人应当办理与资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人和托管人可以不编制当期的季度报告。

3、集合计划年度报告和年度审计报告

管理人、托管人在每年度向投资者提供一次准确、完整的年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况，年度报告包括但不限于下列信息：管理人履职报告；托管人履职报告；资产管理计划投资表现；资产管理计划投资组合报告；资产管理计划运用杠杆情况（如有）；资产管理计划财务会计报告；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；资产管理计划投资收益分配情况；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；中国证监会规定的其他事项。

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。管理人应当在上述信息披露时限内将当期管理报告提供给托管人复核，并给托管人预留足够的复核时间，同时托管人应当办理与资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人和托管人可以不编制当期的年度报告。

集合资产管理计划年度财务会计报告应当经符合《证券法》规定的会计师事务所审计并出具审计报告，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。

（二）临时报告

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：

- (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) 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；
- (3) 资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延期清算；
- (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；
- (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；
- (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
- (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。

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。

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。

（三）清算报告

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。

（四）信息披露方式

管理人、托管人应按照《管理办法》、《运作规定》及其他相关法律法规进行信息披露。投资者可按照本合同约定的信息披露时间及方式查阅或者复制信息披露资料。

集合计划定期报告、临时报告等信息披露文件放置于管理人网站，供投资者查阅。集合计划说明书、集合资产管理合同文本和推介材料存放在各销售场所，投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，管理人和托管人保证与所公告的内容完全一致。

（五）其他

关于管理人、托管人向基金业协会、证监会及其相关派出机构等监管部门或自律组织的备案或报告工作，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、托管人依据新的规定执行。

二十三、风险揭示

投资者投资于本计划可能面临以下风险，有可能因下述风险导致投资者本金或收益损失。管理人承诺以诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运作集合计划资产，管理人制定并执行相应的内部控制制度和风险管理制度，以降低风险发生的概率。但这些制度和不能完全防止

风险出现的可能，管理人不保证本计划的最低收益，也不保证本金不受损失。

投资者在参与本计划前，必须了解管理人是否具有开展集合资产管理业务的资格。

投资者在参与本计划前，必须了解本计划的产品特点、投资方向、风险收益特征等内容，并认真听取管理人对相关业务规则、集合计划合同和说明书等的讲解。

本计划的产品类型为固定收益类产品，可能面临的风险，包括但不限于：

1、资产管理计划面临的一般风险，如本金损失风险、市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、募集失败风险、投资标的风险、关联交易风险、操作或技术风险、税收风险等；

2、资产管理计划面临的特定风险，如特定投资方法及资产管理计划所投资的特定投资对象可能引起的特定风险、资产管理计划外包事项（如有）所涉风险以及未在证券投资基金业协会完成备案的风险、聘请投资顾问（如有）的特定风险及其他未列举的风险。

投资者在参与本计划前，应综合考虑自身的资产与收入状况、投资经验、风险偏好，选择与自身风险承受能力相匹配的集合计划。

投资者应了解参与本计划面临的具体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【R2】，仅适合风险承受能力为【C2】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

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) 再投资风险。固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来收益率，从而对本计划产生再投资风险。

(7) 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。

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

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。在本计划存续期间，可能会发生个别偶然事件，如出现本计划到期时，证券资产无法变现的情况，从而产生流动性风险，甚至影响本计划单位净值。流动性风险按照其来源可以分为两类：

(1) 市场整体流动性相对不足。证券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，对本计划造成不利影响。

(2) 证券市场中流动性不均匀，存在个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使在市场流动性比较好的情况下，一些个券的流动性可能仍然比较差，从而使得本计划在进行个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对个券价格产生比较大的影响，增加个券的建仓成本或变现成本。

5、信用风险

本计划在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人倒闭、信用评级被降低、违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致集合计划财产损失。

(1) 交易品种的信用风险：投资于公司债券等标的，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，本计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

(2) 交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，将使本计划面临交易对手的信用风险。

6、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。

7、关联交易风险

本计划可以将受托资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、实际控制人或其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或进行其他关联交易等。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) 权益类投资标的风险

权益类金融资产，若出现股票停牌等特殊事件导致管理人无法将资产变现，投资者将面临退出业务延迟办理、退出价格不确定或计划资产进行二次清算等风险，具体以管理人公告为准。

(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）：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) 投资场内金融衍生品的风险

1) 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。

2) 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。

12、本计划不设置预警线、止损线, 不存在触发预警、止损机制的风险。

(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。

5、资金前端控制风险

本计划按交易所、中登公司的要求，将对资金前端控制的额度进行设置，买入申报金额不符合资金前端控制相关额度限制的，交易所可能拒绝接受买入申报，造成交易失败，从而导致本计划资产受损的风险；或因资金前端控制异常情况交易所、中登公司采取的相关措施也可能造成本计划资产损失。

二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算

（一）资产管理合同的变更

在集合计划存续期间，如果管理人对本合同做出修改的，合同变更内容应当及时通过管理人网站或书面形式通知投资者，征求投资者意见。

合同补充、修改与变更条件、程序如下：

1、本合同签署后，因法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，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。投资者特此授权管理人经与托管人协商，可以对本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上公告，并且次日生效。投资者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计划。

2、由于其他原因需要变更合同的，以及本计划改变投向和比例的，由管理人、投资者和托管人协商一致进行合同变更，变更程序包括：

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。

3、投资者明确表示不同意管理人对合同做出的补充或修改内容的，有权在管理人发出征询意见函时规定的临时开放日提出退出申请。管理人和托管人应当在扣除管理费、托管费等相关费用后，将退出款项划往退出投资者指定的银行账户。投资者承诺，若其未提出退出申请，则视为同意管理人对合同做出的补充或修改。

4、如果相关变更内容对投资者利益无实质影响，则管理人可以单方面变更，资产管理合同另有约定的除外，变更的内容由管理人以公告的形式告知投资者、托管人。

5、合同变更后，投资者、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。投资者、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。

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。

7、投资者在此同意，发生以下事项，管理人或托管人应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜，将本计划交由其他管理人或托管人承接，承接者继续享有本计划项下相关的权利并承担相应的义务，并无须就此项变更和投资者另行签订协议。但在转让前管理人或托管人应以信息披露的形式告知投资者。管理人和托管人保障投资者退出本计划的权利，并在届时的通告中对相关事项做出合理安排。

(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。

8、本合同未尽事宜，当事人依据有关法律、法规、规章和说明书的规定办理。

(二) 资产管理计划的展期

1、展期的条件

(1) 资产管理计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定以及本合同的约定；

(2) 资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；

(3) 中国证监会规定的其他条件。

集合资产管理计划展期的，应当符合集合资产管理计划的成立条件。

2、展期的程序

(1) 展期的公告

集合计划符合展期条件拟展期时，管理人不晚于集合计划到期前 1 个月在管理人指定网站上公告，管理人将同时公告集合计划的具体展期方案。

(2) 投资者答复

管理人应在上述公告后 15 个工作日内通过管理人指定网站或以书面或电子邮件等方式将展期相关事宜通知投资者，征求投资者意见，投资者应根据管理人指定网站公告要求在规定的期限内明确意见。若投资者同意本集合计划展期，则投资者应根据管理人指定网站公告要求在规定的期限内重新签订资产管理合同。截至存续期届满日，投资者未给出明确答复的，视为不同意展期。

(3) 不同意展期的投资者所持有份额的处理办法

展期经管理人指定网站公告和书面通知投资者后，不同意展期的投资者，管理人保障投

资者到期合法终止合同的权利,管理人将在本集合计划原存续期届满之日将该部分投资者份额全部退出,并分配收益。

(4) 展期的成立

存续期满,集合计划符合展期条件,并且同意本集合计划展期的投资者不少于 2 人,管理人将在存续期满后 10 个工作日之内公告本集合计划展期成立。

(5) 展期的失败

若集合计划展期失败,本集合计划将进入清算终止程序。

3、展期情况备案

本集合计划展期后 5 个工作日内,管理人将展期情况公告并报送中国证券投资基金业协会。

(三) 资产管理计划的终止

集合计划的终止是指由于法定或者约定情形的出现,管理人终止运营并清算集合计划资产后,将集合计划剩余资产按一定标准返还给投资者,最终注销该集合计划的行为。

本计划终止时,管理人和托管人应该遵照中国证监会相关规定或指示,采取必要和适当的措施,在扣除管理费、业绩报酬(如有)、托管费等费用后,将清算后的剩余资产,按照投资者持有集合计划份额占集合计划总份额的比例,以货币的形式分配给投资者。

如果因任何原因托管人退出本计划或不能履行有关义务,管理人应立即寻找其他有资格的托管人进行替代,管理人应在尽可能短的时间内与新的托管人签署托管协议,并完成有关法律手续以确保新的托管人承担本计划项下的有关托管义务。投资者和管理人在此期间应继续履行本合同项下的有关义务。

资产管理计划终止的情形,包括但不限于:

- 1、资产管理计划存续期届满且不展期的;
- 2、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的;
- 3、持有人大会决议提前终止资产管理合同;
- 4、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;
- 5、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;
- 6、持续五个工作日投资者少于 2 人的;
- 7、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形;
- 8、不可抗力的发生导致本计划不能存续;
- 9、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。

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,前述第 7 项约定的情形除外。

(四) 资产管理计划的清算

资产管理计划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资产。

1、资产管理计划财产清算小组

(1) 资产管理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) 资产管理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。

2、资产管理计划财产清算的程序

(1) 资产管理计划符合终止清算条件时，管理人应当按照本计划合同的约定组织成立财产清算小组，并按照监管机构的规定进行履职。

(2) 清算过程中发生可能影响投资者合同权益的重大事项的，清算小组应当在重大事项发生或应当知道重大事项发生之日起 5 日内将相关情况在管理人网站上公布。

(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。

(4) 清算结束后 30 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（如有）及托管费等费用后，将集合计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例或本合同的约定以货币资金的形式全部分派给投资者。

(5) 若本计划在终止之日有未能流通变现的证券，按照延期清算处理方式处置。

3、清算费用

清算费用是指清算小组在进行资产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用优先从清算资产中支付。

4、资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

资产管理计划财产按照以下顺序清偿：

(1) 支付清算费用；

(2) 缴纳所欠税款；

(3) 清偿计划债务；

(4) 按照合同约定支付管理费、业绩报酬及托管费等费用；

(5) 将本计划资产按照投资者拥有集合计划份额的比例或本合同的约定以货币资金的形式全部分派给投资者。

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。

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。

7、资产管理计划财产清算完毕后当事人在相关账户注销中的职责及办理程序

本计划清算完毕后，托管人应按照规定注销集合计划的托管账户、专用证券账户和资金账户等投资账户，管理人应给与必要的配合。

8、资产管理计划财产清算账册及文件的保存

资产管理计划清算账册及有关文件由管理人按相关法律法规规定年限妥善保管，保存期不少于二十年。

二十五、违约责任

管理人、托管人在履行各自职责的过程中，因单独或共同行为，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者投资者造成损失的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，但互不承担连带赔偿责任。

发生下列情况的，当事人可以免责：

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财产损失扩大；任何一方当事人迟延履行合同义务后，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；

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；

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；

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；

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；

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；

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。

本合同当事人违反合同规定，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。合同能继续履行的，应当继续履行。

本合同一方当事人违约后，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，受损方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。

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投资者损失，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。

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。

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。

在集合计划资产被司法机关或其他政府机构扣押和查封的情况下，管理人和托管人没有义务代表投资者就针对集合计划资产所提起的司法或行政程序进行答辩，但是可以提供必要的协助。

二十六、争议的处理

本合同适用于中华人民共和国法律并依据其解释。

对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，任何一方均有权采取第 1 种方式解决：

- 1、提交上海仲裁委员会并按其仲裁规则进行仲裁，仲裁地点在上海；
- 2、向被告所在地有管辖权的人民法院提起诉讼。

争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责的履行本合同约定的义务，维护投资者的合法权益。

二十七、资产管理合同的效力

（一）合同的签署方式

本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，投资者为法人的，本合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，本合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立。

本合同以电子签名方式签署的，与纸质合同的签署具有同等效力。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；投资者作为本合同一方，以纸质方式签署或电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款。本合同经管

理人、托管人和投资者签署后成立。

托管人仅认可通过中国证券登记结算有限责任公司系统进行合同文本及电子数据相关传输保存。

（二）合同的生效条件

本合同签署后，满足以下条件时生效：

- 1、投资者参与资金实际交付并确认；
- 2、本计划成立。

本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。

（三）合同的组成

《东方财富证券周周添利6号集合资产管理计划说明书》、《东方财富证券周周添利6号集合资产管理计划风险揭示书》、经管理人确认有效的投资者参与、退出本计划的申请材料或数据电文以及各销售机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证、投资者通过电子签名方式产生的数据电文等本合同的附件，是本合同不可分割的部分，与合同具有同等法律效力。如与本合同相关内容有冲突的，以本合同的表述为准。

投资者采用纸质签约的资产管理合同一式叁份，投资者、管理人、托管人各执壹份，每份均具有同等法律效力。

（四）合同的有效期限

除本合同另有约定，本合同到期日为自本计划成立之日起10年，可展期。

投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在资产管理计划存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，该投资者不再是资产管理合同的当事人。

二十八、其他事项

（一）或有事件

本合同所称的或有事件是指，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投资者另行签订专项协议。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专项计划的权利，并在届时的通告中对相关事项做出合理安排。

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。

（二）通知和送达

各方应当按照本计划资产管理合同约定的各方联系人的通讯方式，以专人送达、快递、传真、电子邮件等有效方式进行通知和送达。

通知在下列日期视为送达被通知方：

- 1、专人送达：通知方取得的被通知方签收单所示日；
- 2、快递：被通知方在签收单上签收所示日；
- 3、传真：被通知方收到成功发送的传真并电话确认之日；
- 4、电子邮件：被通知方收到成功发送的电子邮件并回复确认之日。

通讯地址或者联络方式发生变化的一方（简称“变动方”），应提前 5 个工作日以书面形式通知其他方。如果变动方，未将有关变化及时通知其他各方，变动方应对由此造成的影响和损失承担责任。

（三）其他事项

本合同如有未尽事宜，由各方按照有关法律法规和规定协商解决。

（以下无正文）

(本页无正文, 为《东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划资产管理合同》签署页)

管理人确认, 已向投资者明确说明资产管理计划的风险, 不以任何方式对投资者资产本金不受损失或者取得最低收益作出承诺; 投资者确认, 已充分理解本合同的内容, 自行承担风险和损失。

投资者为法人的, 本合同由投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章及各方法定代表人或授权代表签字或盖章; 投资者为自然人的, 本合同由投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章。

投资者(签字):

(盖章):

签订日期:

管理人: 东方财富证券股份有限公司(盖章)

法定代表人或授权代表:

签订日期: 2023.5.17



托管人: 上海银行股份有限公司(盖章)

法定代表人或授权代表:

签订日期: 2023 年 5 月 18 日



附件一：风险揭示书

东方财富证券周周添利 6 号集合资产管理计划

风险揭示书

尊敬的投资者：

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。

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【R2】，仅适合风险承受能力为【C2】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) 再投资风险。固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来收益率，从而对本计划产生再投资风险。

(7) 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。

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

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。在本计划存续期间，可能会发生个别偶然事件，如出现本计划到期时，证券资产无法变现的情况，从而产生流动性风险，甚至影响本计划单位净值。流动性风险按照其来源可以分为两类：

(1) 市场整体流动性相对不足。证券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，对本计划造成不利影响。

(2) 证券市场中流动性不均匀，存在个券流动性风险。由于流动性存在差异，即使市场流动性比较好的情况下，一些个券的流动性可能仍然比较差，从而使得本计划在进行个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对个券价格产生比较大的影响，增加个券的建仓成本或变现成本。

5、信用风险

本计划在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人倒闭、信用评级被降低、违约、拒绝支付到期本息的情况，从而导致集合计划财产损失。

(1) 交易品种的信用风险：投资于公司债券等标的，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，本计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。

(2) 交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，将使本计划面临交易对手的信用风险。

6、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。

7、关联交易风险

本计划可以将受托资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、实际控制人或其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或进行其他关联交易等。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、投资标的的风险

(1) 权益类投资标的的风险

权益类金融资产，若出现股票停牌等特殊事件导致管理人无法将资产变现，投资者将面临退出业务延迟办理、退出价格不确定或计划资产进行二次清算等风险，具体以管理人公告为准。

(2) 固定收益类投资标的的风险

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）：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) 投资场内金融衍生品的风险

1) 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。

2) 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。

12、本计划不设置预警线、止损线，不存在触发预警、止损机制的风险。

(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。

5、资金前端控制风险

本计划按交易所、中登公司的要求，将对资金前端控制的额度进行设置，买入申报金额不符合资金前端控制相关额度限制的，交易所可能拒绝接受买入申报，造成交易失败，从而导致本计划资产受损的风险；或因资金前端控制异常情况交易所、中登公司采取的相关措施也可能造成本计划资产损失。

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：2023.5.17



销售机构经办人（签字）：

日期：

