

关于申港证券睿泽 1 号集合资产管理计划 资产管理合同变更投资者意见征询函（三）

尊敬的投资者：

申港证券股份有限公司（以下简称“我司”或“申港证券”）管理的“申港证券睿泽 1 号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）于 2021 年 6 月 4 日成立。根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理计划备案办法》等有关规定并结合本集合计划运作管理需要，经与托管人书面协商一致，拟变更部分合同条款。现根据《申港证券睿泽 1 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十五章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”之第（一）节“资产管理合同变更的条件和程序”之第 1、2、3 条约定：

“1、因法律法规或中国证监会、中国证券投资基金业协会等监管机构的相关规定、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，并由管理人按照资产管理合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。如投资者对变更的内容有异议，可以根据管理人的安排申请退出集合计划；若投资者未在管理人指定的期限内申请退出其持有的全部集合计划份额，则视为同意，管理人不再另行通知。

2、因其他原因需要变更资产管理合同的，管理人和托管人应以书面形式就资产管理合同变更内容达成一致，并由管理人通知投资者。投资者不同意变更的，应在管理人公告指定的期限内申请退出其持有的全部集合计划份额；投资者在上述指定期限内未申请退出其持有的全部集合计划份额的，视为投资者同意资产管理合同变更。投资者同意，无论其是否提出退出申请，按照上述约定进行的资产管理合同变更均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。投资者在上述指定期限内根据资产管理合同约定参与集合计划的，视为同意资产管理合同变更并接受变更后的资产管理合同。资产管理合同变更自上述指定期限届满

后次日或管理人公告中指定的资产管理合同变更生效日起生效。

3、集合计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意，并按上述规定履行资产管理合同变更程序。”

一、变更对照明细表

1、统一变更原合同中的相关表述：

原表述：	现表述：
本资产管理计划、本集合资产管理计划、本计划	本集合计划
《资产管理合同》	资产管理合同
《说明书》	说明书
产品合同	资产管理合同
委托财产	资产管理计划财产
委托资产	资产管理计划资产
委托资金	参与资金
托管专户	托管账户
资产管理人	管理人
托管行、资产托管人	托管人

2、对原合同第一章“前言”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
管理人应当对集合计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。	管理人应当按照规定向中国证券投资基金业协会办理集合计划的设立、变更备案，并及时报送集合计划的运行情况、风险情况及终止清算报告等信息（如报备相关监管规定有变更，将按最

中国证券投资基金业协会接受集合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，也不代表中国证券投资基金业协会对集合计划的合规性、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。	新规定执行）。 中国证券投资基金业协会办理集合计划备案不代表中国证券投资基金业协会对集合计划的合规性、投资价值及投资风险作出保证和判断，也不表明中国证券投资基金业协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。投资者应当充分了解集合计划的投资范围、投资策略和风险收益等信息，根据自身风险承受能力审慎选择集合计划，自主判断投资价值，自行承担投资风险。
若采用电子签名的方式，投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式签订资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函等形式对本集合计划资产管理合同的有效修订和补充）、风险揭示书或其他文书的，视为签署资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函等形式对本集合计划资产管理合同的有效修订和补充）、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	若采用电子签名的方式，投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式签订资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函等形式对本集合计划资产管理合同的有效修订和补充）、风险揭示书或其他文书的，视为签署资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函等形式对本集合计划资产管理合同的有效修订和补充）、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。	风险揭示书或其他文书。投资者可至管理人或销售机构提供或指定的电子平台（包括系统、网站或软件等）阅览和下载具体法律文书。
-------------	---

3、对原合同第二章“释义”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
《适当性管理办法》：指中国证监会于2016年12月12日发布，2017年7月1日起施行的《证券期货投资者适当性管理办法》（证监会令第130号） 《指导意见》：指中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于2018年4月27日联合发布并施行的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106号） 《管理办法》：指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令〔第151号〕） 《运作规定》：指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2018〕31号） 《合同指引》：指中国证券投资基金业协会于2019年3月29日发布，2019年5月1日起施行的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试	《适当性管理办法》：指《证券期货投资者适当性管理办法》及其颁布机关对其不时做出的修订 《指导意见》：指《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其颁布机关对其不时做出的修订 《管理办法》：指《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其颁布机关对其不时做出的修订 《运作规定》：指《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其颁布机关对其不时做出的修订 《合同指引》：指《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》及其颁布机关对其不时做出的修订 本合同或资产管理合同：指《申港证券睿泽1号集合资产管理计划资产管理合同》及其的任何有效修订和补充 托管协议：指《申港证券-宁波银行资产管理计划托管协议》及其的任何有效修订或补充

行)》(中基协发[2019]3号) 资产管理合同:指《申港证券睿泽1号集合资产管理计划资产管理合同》及其的任何有效修订和补充 托管协议:指《申港证券睿泽1号集合资产管理计划托管协议》及其的任何有效修订或补充 销售机构:指申港证券股份有限公司及其他具有基金销售资格的、符合相应资格条件的、接受管理人委托销售本集合计划的机构 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计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织: (1)具有2年以上投资经历,且	销售机构:指申港证券股份有限公司及其他管理人委托的具有公开募集证券投资基金销售资格的机构 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计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织: (1)具有2年以上投资经历,且满足下列三项条件之一的自然人:家庭金融资产不低于300万元,家庭金融资产不低于500万元,或者近3年本人年均收入不低于40万元; (2)最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位; (3)依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构,包括证券公
满足下列三项条件之一的自然人:家庭金融资产不低于300万元,家庭金融资产不低于500万元,或者近3年本人年均收入不低于40万元; (2)最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位; (3)依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构,包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会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;	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)基本养老保险、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

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 工作日、交易日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日 参与：指在存续期内购买本集合计划份额的行为 最低认购金额、最低参与金额：指投资者的最低投资金额，本合同中指人民币 30 万 家庭金融总资产：指全体家庭成员共同共有的全部金融资产，包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债。 七个工作日可变现资产：指可在交易所、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，七个工作日内	（RQFII）； (6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形 工作日、交易日：指上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所的正常交易日 申购、申购参与：指在存续期内购买本集合计划份额的行为 最低认购金额、最低参与金额：指投资者的最低投资金额，本合同中指人民币 300 万元 家庭金融总资产：指全体家庭成员共有的全部金融资产，包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货和衍生品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债 7 个工作日可变现资产：指可在交易所、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 关联方：按照《企业会计准则》及证券公司相关规定确定 不可抗力：指遭受不可抗力事件一方不能预见、不能避免、不能克服的客
---	--

到期或者可支取的逆回购、银行存款，七个工作日内能够确认收到的各类应收款项等 关联方关系：指《企业会计准则第36号——关联方披露》中的关联方关系 不可抗力：指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观事件	观情况，包括但不限于自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律变化、系统故障、突发停电或其他突发事件、证券交易所或证券登记结算机构非正常暂停或停止交易或发送数据存在延误、错漏等
--	--

4、对原合同第二章“释义”中新增以下表述，后续项目编号顺延：

新增表述： 终止日：指集合计划终止运作的日期，即集合计划的到期日，若运作自然到期，终止日为到期年成立日的对应日；提前到期，终止日为管理人公告的终止日期。终止日遇节假日顺延 估值日：指集合计划存续期内每个交易日和月末最后一个自然日 最低持有金额：指投资者的最低保有金额，本合同中指人民币 30 万元 锁定期：指投资者参与本集合计划的份额自集合计划成立日/参与确认日（存续期参与的为参与确认日）起 80 个自然日
--

5、对原合同第三章“承诺与声明”之“（三）投资者声明”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
投资者承诺其知悉《中华人民共和国	投资者承诺其知悉《中华人民共和国

国反洗钱法》、《金融机构报告涉嫌恐怖融资的可疑交易管理办法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；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者控制权结构、受益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。投资者承诺其不属于中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁名单内的企业或个人，不位于被中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁的国家和地区。	国反洗钱法》、《金融机构反洗钱规定》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《涉及恐怖活动资产冻结管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；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者控制权结构、受益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。投资者承诺其不属于中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁名单内的企业或个人，不位于被中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁的国家和地区。
--	--

6、对原合同第三章“承诺与声明”中新增以下表述，后续项目编号顺延：

新增表述：
（四）廉洁从业条款 本合同各方在业务往来活动中，应严格遵守法律法规、职业道德和行为规范，遵循自愿、公平、诚实信用原则，保证在本合同签署、履行过程中不会为谋取不正当利益而损害国家、集体和本合同其他方的利益，遵守以下规定： 1、不得向本合同其他方工作人员提供礼金、房产、汽车、有价证券、股权、

佣金返还、费用报销或其他财物，或者为上述行为提供代持等便利；

2、不得向本合同其他方工作人员提供旅游、宴请、娱乐健身、工作安排等利益；

3、不得向本合同其他方工作人员行贿、变相行贿或者报销本应由其个人承担的相关费用；不得为本合同其他方工作人员及其配偶、亲戚朋友介绍经营业务、提供经营业务便利条件，开展经营业务合作等；

4、不得以任何其他手段向本合同其他方工作人员提供任何其他不正当利益。合同一方及其工作人员违反廉洁规定，将构成重大违约，合同其他方有权单方终止合同，并要求其赔偿所造成的全部损失。若涉嫌构成犯罪的，应向司法机关报案，追究其相应的刑事责任。

7、对原合同第四章“当事人及权利义务”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
托管人 名称：宁波银行股份有限公司 负责人：陆华裕	托管人 名称：宁波银行股份有限公司 负责人：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 联系人：徐银央 联系电话： 0574-83895886	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 联系人：胡银杰 联系电话： 0574-83895886

8、对原合同第四章“当事人及权利义务”之“（二）管理人的权利和义务”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（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、对集合计划财产及其他当事人的利益造成	（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、对集合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中国证券投资基金业协会；	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中国证券投资基金业协会（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）；
--	--

9、对原合同第四章“当事人及权利义务”之“（二）管理人的权利和义务”中新增以下表述，后续项目编号顺延：

新增表述：
2、管理人的义务包括但不限于： （26）保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与集合计划时使用的结算账户或其同名账户；

10、对原合同第四章“当事人及权利义务”之“（三）托管人的权利和义务”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
2、托管人的义务包括但不限于： （14）投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管集合计划财产、监督管理人投资运作等职责，通过复核季报、年报的方式，并向投资者充分揭示；	2、托管人的义务包括但不限于： （14）投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管集合计划财产，监督管理人投资运作等职责；

11、对原合同第五章“集合计划的基本情况”之“（四）投资目标、主要投资方向及投资范围、投资比例、产品风险等级”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
2、主要投资方向及投资范围 本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求，主要投资以下资产：	2、主要投资方向及投资范围 本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求，主要投资以下资产：

(1) 投资的固定收益类资产包括 1) 债券类固定收益品种：包括在交易所市场、银行间市场依法上市交易的国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（包括金融机构次级债、混合资本债、政策性金融债）、企业债、公司债（含非公开发行债券）、中期票据（含长期限含权中期票据）、一般短期融资券及超短期融资券、非公开定向债务融资工具、资产证券化产品（如资产支持证券、资产支持票据）优先级； 2) 货币市场工具：包括现金、银行存款、同业存单、债券逆回购； 3) 公开募集证券投资基金：包括货币市场基金、债券型基金；	(1) 固定收益类资产：包括在交易所市场、银行间市场依法上市交易的国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（包括金融机构次级债、混合资本债、政策性金融债）、企业债、公司债（含非公开发行债券）、中期票据（含长期限含权中期票据）、短期融资券及超短期融资券、非公开定向债务融资工具、资产证券化产品（包括资产支持证券、资产支持票据）优先级、现金、银行存款、同业存单、债券逆回购、货币市场基金、债券型基金； (2) 债券正回购。 法律法规或监管机构允许投资的品种，并且得到投资者书面确认的，经管理人及托管人书面一致同意后，可以
(2) 债券正回购； 法律法规或监管机构允许投资品种，并且得到资产投资者书面确认的，经管理人及托管人一致同意后，可以将其纳入投资范围。 特别提示：本计划投资范围包括债券正回购和逆回购。	将其纳入投资范围。 特别提示：本集合计划投资范围包括债券回购。
4、产品风险等级 经管理人审慎评估，本集合计划的风险等级为 R2，属于中低风险，适合合格投资者中专业投资者及风险承受能力为谨慎型（C2）、稳健型（C3）、积极型（C4）、激进型（C5）的普通投资	4、产品风险等级 经管理人审慎评估，本集合计划的风险等级为 R2，属于中低风险，适合合格投资者中专业投资者及风险承受能力为谨慎型（C2）、稳健型（C3）、积极型（C4）、激进型（C5）的普通投资

者。	者。 若产品风险等级发生变化，管理人将及时在管理人网站以公告的形式向投资者披露风险等级变更情况，若发生投资者所持有产品风险等级与其风险承受能力不匹配的，管理人将主动调整对其的适当性匹配意见，具体的调整方案以公告为准。
----	--

12、对原合同第五章“集合计划的基本情况”之“（十）预警止损安排”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
本集合计划不设预警止损安排。	根据本集合计划投资策略、潜在的收益波动水平、可能出现的最大回撤幅度等，本集合计划以集合计划单位净值为基础设置预警线及止损线。 1、本集合计划的预警安排 本集合计划的预警线为【0.9500元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T日）日终，本集合计划单位净值等于或低于预警线的，管理人应在计算出该净值并与托管人核对一致后的一个工作日内进行信息披露。 2、本集合计划的止损安排 本集合计划的止损线为【0.9200元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T日）日终，本集合计划单位净值等于或低于止损线的，本集合计划终止，按照资产管理合同的约定组织清

	算集合计划资产。 托管人根据与管理人的估值核对结果对预警、止损事项进行事后监督，托管人如若发现经核对的单位净值等于或低于预警线或止损线的，应当及时向管理人予以提示。 风险提示：本集合计划预警线和止损线的设置并不是管理人对投资者所能获得的集合计划最低单位净值的保证。
--	---

13、对原合同第六章“集合计划的募集”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（一）销售机构 1、申港证券股份有限公司 法定代表人：邵亚良 住所：上海市浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦16/22/23楼 管理人可根据集合计划运作情况，聘请具有基金销售资格、符合相应资格条件、且与管理人签订相关协议、接受管理人委托的机构作为本集合计划的销售机构。	（一）销售机构 1、申港证券股份有限公司 法定代表人：邵亚良 住所：上海市浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦16/22/23楼 2、管理人可根据有关法律法规要求、集合计划运作情况，聘请具有公开募集证券投资基金销售资格的机构作为本集合计划的销售机构。若管理人新增或变更本集合计划的销售机构，将提前在管理人指定网站上进行公告。管理人指定网站公告后即生效，管理人无需就增加或变更销售机构事宜征求投资者意见或与投资者另行签订协议。
（二）募集对象、募集方式、募集期限	（二）募集对象、募集方式、募集期限

1、募集对象 本集合计划的募集对象为合格投资者中专业投资者及风险承受能力为谨慎型（C2）、稳健型（C3）、积极型（C4）、激进型（C5）的普通投资者。 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计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织： （1）具有 2 年以上投资经历，且满足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	1、募集对象 本集合计划的募集对象为合格投资者中的专业投资者及风险识别、评估、承受能力为谨慎型（C2）、稳健型（C3）、积极型（C4）、激进型（C5）的普通投资者。 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计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织： （1）具有 2 年以上投资经历，且满足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、
---	---

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。	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。
（三）认购事项 5、最低认购金额及支付方式 本集合计划的首次最低认购金额为人民币 30 万元（不包括认购费），若认购金额超过上述最低认购金额，则超出部分金额不设级差；追加认购的最低金额为人民币 1 万元（不包括认购费），超出部分金额不设级差。	（三）认购事项 5、最低认购金额及支付方式 本集合计划的首次最低认购金额为人民币 300 万元（不包括认购费），若认购金额超过上述最低认购金额，则超出部分金额不设级差；追加认购的最低金额为人民币 1 万元（不包括认购费），超出部分金额不设级差。
（三）募集结算专用账户	（四）募集结算专用账户

14、对原合同第七章“集合计划的成立与备案”之“（二）集合计划的备案”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
集合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。	集合计划完成备案前，可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。 若集合计划未在中国证券投资基金业协会完成备案或不予备案，管理人可以采取以下处理方式：

	1、根据本合同约定进行合同变更，并根据变更生效且经备案通过后的合同进行后续管理； 2、集合计划无法完成备案作终止处理的，管理人将通过于指定网站公告的形式告知投资者，并按照本合同约定履行终止清算程序。
--	---

15、对原合同第八章“集合计划的参与、退出与转让”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认 2、参与和退出的程序和确认 （4）当集合计划规模接近或达到约定的规模上限（如有）、投资者数量达到上限（200人），或管理人认为有必要时，管理人有权暂停接受参与申请。如果T日参与申请的份额加上已有的参与份额已经超过规模上限（如有），则T+1日对T日参与申请的份额按照“时间优先，金额优先”原则进行确认，根据时间先后顺序对参与资金进行确认，若出现参与时间相同的参与申请，则根据金额由大到小的顺序进行确认，以保证不超过规模上限（如有）。 （5）投资者参与本集合计划后，每一持有份额需满足锁定期要求，即委托份额自参与确认之日起80个自然日	（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认 2、参与和退出的程序和确认 （4）当集合计划规模接近或达到约定的规模上限（如有）、投资者数量达到上限（200人），或管理人认为有必要时，管理人有权暂停接受参与申请。如果T日参与申请的份额加上已有的参与份额已经超过规模上限（如有）或导致本集合计划投资者数量超过上限（200人），则T+1日对T日参与申请的份额按照“时间优先，金额优先”原则进行确认，根据时间先后顺序对参与资金进行确认，若出现参与时间相同的参与申请，则根据金额由大到小的顺序进行确认，以保证不超过规模上限（如有）和投资者数量上限（200人）。 （5）投资者参与本集合计划后，

内投资者不得申请退出。委托份额自参与确认之日主要分为两种情况：①募集期内参与本集合计划的锁定期起始日为产品成立日；②本集合计划成立后参与的锁定期起始日为每个申购确认日。因不满足最低投资金额要求引起强制赎回的情况除外。 （6）投资者在提交退出申请时，其在销售机构必须有足够可用的集合计划份额余额，否则超出余额部分的退出申请将不予成交。销售机构对退出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退出申请。销售机构在T日规定时间受理的投资者退出申请，投资者在T+2日后可向销售机构查询退出的成交情况。	每一持有份额需满足锁定期要求，即投资者所持份额自产品成立日/参与确认日起80个自然日内不得申请退出。 投资者仅可申请满足锁定期要求的份额退出，对于不满足锁定期要求的份额管理人有权拒绝退出。但符合下列情形之一的，可不受锁定期限制： ①投资者在合同变更时根据本合同约定及管理人的安排申请退出； ②投资者不接受调整后的业绩报酬计提基准时申请退出； ③投资者根据合同约定申请违约退出； ④投资者选择分红转投资的，分红资金转为集合计划的份额申请退出； ⑤投资者不同意本集合计划自有
	资金主动参与或退出申请退出； ⑥投资者不同意管理人从事重大关联交易； ⑦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。 （6）投资者在提交退出申请时，其在销售机构必须有足够可用的集合计划份额余额，超出余额部分的退出申请将不予成交，仅受理账户实际持有份额的退出申请。销售机构对退出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退出申请。销售机构在T日规定时间受理的投资者退出

	申请，投资者在 T+2 日后可向销售机构查询退出的成交情况。
(五) 参与和退出的金额限制 3、投资者部分退出集合计划的，其退出后持有的集合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（人民币 30 万元）。投资者持有的集合计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出集合计划的，应当一次性全部退出。若某笔退出导致该投资者持有的资产净值低于人民币 30 万元时，则该投资者接受管理人将其持有的全部资管计划份额强制一次性退出（包括投资者持有的仍在锁定期的份额）。 本集合计划最低参与金额可在法律法规和本合同规定范围内进行调整，具体调整方案详见管理人公告或开放期公告。管理人公告调整最低参与金额的，最低保有金额不变。	(五) 参与和退出的金额限制 3、投资者部分退出集合计划的，其退出后持有的集合计划份额净值应当不低于合格投资者最低持有金额（30 万元）。 (1) 若投资者某笔退出申请后导致该投资者持有的剩余部分资产净值低于最低持有金额要求，且剩余部分不包含处于锁定期内不得退出的份额的，投资者应当申请一次性退出全部集合计划份额；投资者在此同意，若上述部分退出申请触及上述限制且投资者未一次性全部退出的，接受管理人按照最低持有金额强制保留其持有本集合计划的份额。 (2) 若投资者申请部分退出后剩余部分不满足最低持有金额要求，且剩余部分包含处于锁定期内不得申请退出的份额的，管理人有权按照最低持有金额强制保留其持有本集合计划的份额。 4、本集合计划最低参与金额可在法律法规和本合同规定范围内进行调整，具体调整方案详见管理人公告或开放期公告。管理人公告调整最低参与金额的，合格投资者的最低持有金额（人

	民币 30 万元) 不变。
(六) 参与和退出的费用 1、参与费率：0%，本集合计划不收取参与费用。 2、退出费率：0%，本集合计划不收取退出费用。 参与费率、退出费率以及收费方式可在法律法规和本合同规定范围内进行调整，具体方案详见管理人公告或开放期公告。	(六) 参与和退出的费用 1、参与费率：0.1%。 2、退出费率：0%，本集合计划不收取退出费用。 参与费率以及收费方式可在法律法规和本合同规定范围内进行调整，具体调整方案详见管理人公告或开放期公告。 本集合计划参与费用在份额持有人参与时收取，由份额持有人承担。参与费不列入本集合计划资产。
(九) 巨额退出的认定及处理方式 	(九) 巨额退出的认定及处理方式
2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付 当出现巨额退出或连续巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分延期退出、暂停退出。 (1) 全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的全部退出款项时，按正常退出程序执行。 (2) 部分延期退出：当管理人认为支付投资者的全部退出款项有困难或可能会对集合计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于前一日集合计划总份额的 10%	2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付 当出现巨额退出或连续巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分延期退出、延期支付、暂停退出。 (1) 全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的全部退出款项时，按正常退出程序执行。 (2) 部分延期退出：当管理人认为支付投资者的全部退出款项有困难或可能会对集合计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于前一日集合计划总份额的 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,确定当日受理退出份额。对未受理部分,根据投资者在申请退出时的选择确定延期至下一个工作日办理或撤消退出申请,如投资者在提交退出申请时未作明确选择,则默认投资者不参与延期。延期至下一个工作日的退出申请不享有优先权并以该工作日的集合计划份额净值为依据计算退出金额,并以此类推,直到全部退出为止。因延期退出导致的损失由投资者自行承担。

(3) 暂停退出:发生连续巨额退出的,管理人可以暂停接受退出申请,已经接受的退出申请可以延期支付退出款项。因暂停退出或延期支付导致的损失由投资者自行承担。

3、告知客户方式

当发生巨额退出或连续巨额退出且管理人决定部分延期退出或暂停退出时,管理人应通过在指定网站公告等途径向投资者披露,并说明有关处理方法。

4、单个投资者大额退出的预约申请

本集合计划不设置单个投资者大额退出的预约申请安排,但若构成巨额退出,应按巨额退出程序办理。

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,确定当日受理退出份额。对未受理部分,根据投资者在申请退出时的选择确定延期办理或撤消退出申请。选择延期办理的,将自动转入下一个开放日继续退出,直到全部退出为止;选择撤销退出申请的,当日未获受理的部分退出申请将被撤销。如投资者在提交退出申请时未作明确选择,则默认投资者参与延期。延期至下一个开放日的退出申请不享有优先权并以该开放日的集合计划份额净值为依据计算退出金额,并以此类推,直到全部退出为止。因延期退出导致的损失由投资者自行承担。

(3) 延期支付:发生巨额退出或连续巨额退出时,管理人对符合法律法规及本合同约定的退出申请全部或部分予以接受和确认的,为避免全额支付投资者的退出款项对集合计划的资产净值造成较大波动,管理人可对退出款项延期支付,直至该笔退出款项全部支付完毕。延期支付的退出申请以退出确认前一工作日的本集合计划单位净值为基础计算退出金额。因延期支付导致的损失由投资者自行承担。

(4) 暂停退出:发生连续巨额退出的,管理人可以暂停接受退出申请,

5、管理人可根据市场变化或集合计划运作情况对巨额退出的认定标准进行调整。管理人应当提前1个工作日在指定网站公告调整方案。调整方案经过管理人指定网站公告后即生效，无需就该调整方案征求投资者意见。	已经接受的退出申请可以延期支付退出款项。因暂停退出或延期支付导致的损失由投资者自行承担。 3、告知投资者方式 当发生巨额退出或连续巨额退出且管理人决定部分延期退出、延期支付或暂停退出时，管理人应通过在指定网站公告等途径向投资者披露，并说明有关处理方法。 4、单个投资者大额退出的预约申请 本集合计划不设置单个投资者大额退出的预约申请安排，但若构成巨额退出，应按巨额退出程序办理。 5、管理人可根据市场变化或集合计划运作情况对巨额退出或者连续巨额退出的认定标准进行调整。管理人应当提前1个工作日在指定网站公告调整方案。调整方案经过管理人指定网站公告后即生效，无需就该调整方案征求投资者意见。
(十二) 违约退出 本集合计划不接受违约退出。	(十二) 违约退出 1、违约退出情形 违约退出适用于投资者身患重疾、突发意外等急需使用资金的情形。申请违约退出的投资者需提供情形说明及相关佐证材料，如投资者提供的说明及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，管

	理人有权拒绝办理投资者的违约退出申请。 2、违约退出的费用及违约退出金额的计算方式 (1) 违约退出费率为：0.05%。 (2) 违约退出金额的计算方式 违约退出费用=（违约退出份额×实际违约退出申请日集合计划份额净值-退出费（如有）-业绩报酬（如有））×违约退出费率 违约退出金额=违约退出份额×实际违约退出申请日集合计划份额净值-违约退出费用-退出费（如有）-业绩报酬（如有） 违约退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔违约退出时，按上述公式进行逐笔计算。 违约退出费用全额归入集合计划财产。
（十五）管理人自有资金参与集合计划 2、自有资金参与的方式和金额 在本集合计划初始募集期和存续期内，管理人及其附属机构可以以自有资金参与本集合计划，参与金额不得低于本集合计划初始募集期最低参与金	（十五）管理人自有资金参与集合计划 2、自有资金参与的方式和金额 在本集合计划初始募集期和存续期内，证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与本集合计划，参与金额不得低于本集合计划初始募集期最

额限制（不含参与费用）。 3、自有资金参与的比例和期限 管理人以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该集合计划总份额的 20%，管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该集合计划总份额的 50%。若未来监管机构对自有资金参与有新规定的，本集合计划将按照新规定执行。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，不视为管理人违反此项约定，但在客观条件允许的情况下，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。 管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知投资者和托管人。 为应对本集合计划巨额退出以解决流动性风险，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资产管理合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与或退出集合计划可不受上述两款规定的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会报告。 4、自有资金退出的条件 集合计划存续期间，管理人有权部	低参与金额限制（不含参与费用）。 3、自有资金参与和退出 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该集合计划总份额的 50%。管理人以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该集合计划总份额的 20%。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。 在本集合计划初始募集期内，投资者和托管人在此同意并授权证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与本集合计划。存续期内，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出集合计划的，应当提前 5 个工作日以邮件形式或其他托管人认可的方式征询托管人，取得其同意，并通过征询公告或征询函形式征询全体投资者意见，其中投资者意见征询的方式具体为： （1）证券期货经营机构及其子公司（如有）拟在开放期（含退出开放期）参与或退出的，通过公告方式征询投资者意见。管理人将保障不同意投资者的退出权利，不同意证券期货经营机构及其子公司（如有）自有资金参与、退出的投资者可在管理人指定的开放期内退出，未在管理人指定的开放期退出其持有全部份额及开放期参与的投资者视为同意证券期货经营机构及其子公司
---	--

分或全部退出自有资金持有份额。管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于6个月。参与、退出时，应当提前5个工作日告知投资者和托管人。为应对本集合计划巨额退出以解决流动性风险，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资产管理合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与或退出集合计划可不受上述限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

因资产管理计划规模变动等客观因素导致自有资金份额被动超过法律、法规及本合同规定比例上限的，管理人应当依照中国证监会规定或10个工作日内安排临时开放期退出完成调整。

5、自有资金的收益分配和风险承担

管理人自有资金持有的集合计划份额与投资者持有的同类份额享有同等权益、承担同等风险。

6、风险揭示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响集合计划损益。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，控制风险。管理人以自有资金参与本集合计划并不代表管理人对本集合计划的风险和收益水平作出任何形式的判断，

(如有)自有资金的参与、退出。

(2) 证券期货经营机构及其子公司(如有)拟在仅开放参与的开放期参与的，通过事前征询函方式征询投资者意见，并区分全体投资者回复意见情况分别处理，若全体投资者均同意，则证券期货经营机构及其子公司(如有)自有资金可以在本次开放期内参与，且本次开放期不再开放退出；若未取得全体投资者同意(含投资者未答复的情况)，则证券期货经营机构及其子公司(如有)自有资金将不在本次开放期内参与。

证券期货经营机构及其子公司(如有)自有资金参与集合计划的持有期限不得少于6个月。在满足最低持有时限，管理人在履行自有资金退出程序的基础上，可根据投资需要决策自有资金的退出。

因集合计划规模变动等客观因素导致前述比例被动不符合相关监管规定或其预警值、合同约定的，不视为管理人违反此项约定，但在客观条件允许的情况下，管理人应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定采取必要措施稳妥处置。前述被动超限情况的调整，无需提前5个工作日告知全体投资者和托管人并取得其同意，但应于调整后5个工作日内告知全体投资者和托管

并不对本集合计划的同类份额本金或收益提供任何形式的保障。	人。 为应对本集合计划巨额退出以解决流动性风险，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资产管理合同约定的前提下，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集合计划可不受上述限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。 4、自有资金的收益分配和风险承担 管理人自有资金持有的集合计划份额与投资者持有的同类份额享有同等权益、承担同等风险。
	5、风险揭示：证券期货经营机构及其子公司自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响集合计划损益。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，控制风险。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与或退出本集合计划并不代表管理人对本集合计划的风险和收益水平作出任何形式的判断，亦不对本集合计划的同类份额本金或收益提供任何形式的保障。
（十六）投资者变更情况报送 管理人定期将集合计划投资者变	（十六）投资者变更情况报送 管理人定期将集合计划投资者变

更情况报送中国证券投资基金业协会。	更情况报送中国证券投资基金业协会 (如报备相关监管规定有变更, 将按最新规定执行)。
-------------------	---

16、对原合同第十一章“集合计划的投资”中的表述作如下变更:

原表述:	现表述:
(一) 投资目标 通过对于当前经济形势、货币政策、财政政策、产业政策及资本市场的细致分析研究, 积极主动地对集合计划的大类资产进行配置调整, 力争在有效控制风险的前提下, 努力实现集合计划获取长期稳定投资收益的目标。	(一) 投资目标 通过对于当前经济形势、货币政策、财政政策、产业政策及资本市场的细致分析研究, 积极主动地对集合计划的大类资产进行配置调整, 力争在有效控制风险的前提下, 努力实现集合计划获取投资收益的目标。
(二) 投资范围及比例 1、主要投资方向及投资范围 本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求, 主要投资以下资产: (1) 投资的固定收益类资产: 1) 债券类固定收益品种: 包括在交易所市场、银行间市场依法上市交易的国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债(包括金融机构次级债、混合资本债、政策性金融债)、企业债、公司债(含非公开发行债券)、中期票据(含长期限含权中期票据)、一般短期融资券及超短期融资券、非公开定向债务融资工具、资产证券化产品(如资产支持证券、资产支持票据)优先级;	(二) 投资范围及比例 (1) 固定收益类资产: 包括在交易所市场、银行间市场依法上市交易的国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债(包括金融机构次级债、混合资本债、政策性金融债)、企业债、公司债(含非公开发行债券)、中期票据(含长期限含权中期票据)、短期融资券及超短期融资券、非公开定向债务融资工具、资产证券化产品(包括资产支持证券、资产支持票据)优先级、现金、银行存款、同业存单、债券逆回购、货币市场基金、债券型基金; (2) 债券正回购。 法律法规或监管机构允许投资的品种, 并且得到投资者书面确认的, 经

2) 货币市场工具：包括现金、银行存款、同业存单、债券逆回购； 3) 公开募集证券投资基金：包括货币市场基金、债券型基金； (2) 债券正回购； 法律法规或监管机构允许投资品种，并且得到资产投资者书面确认的，经管理人及托管人一致同意后，可以将其纳入投资范围。 特别提示：本计划投资范围包括债券正回购和逆回购。	管理人及托管人书面一致同意后，可以将其纳入投资范围。 特别提示：本集合计划投资范围包括债券回购。
(三) 投资比例超限的处理方式及流程 如因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素，导致集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的或者资产管理合同约定的投资比例，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 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，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和中国证券投资基金业协会报告。	(三) 投资比例超限的处理方式及流程 如因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素，导致集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的或者资产管理合同约定的投资比例，管理人应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，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。
(四) 风险收益特征 经管理人审慎评估，本集合计划的风险等级为 R2，属于中低风险，适合合格投资者中专业投资者及风险承受能	(四) 风险收益特征 经管理人审慎评估，本集合计划的风险等级为 R2，属于中低风险，适合合格投资者中专业投资者及风险承受能

力为谨慎型（C2）、稳健型（C3）、积极型（C4）、激进型（C5）的普通投资者。	力为谨慎型（C2）、稳健型（C3）、积极型（C4）、激进型（C5）的普通投资者。 若产品风险等级发生变化，管理人将及时在管理人网站以公告的形式向投资者披露风险等级变更情况，若发生投资者所持有产品风险等级与其风险承受能力不匹配的，管理人将主动调整对其的适当性匹配意见，具体的调整方案以公告为准。
（五）投资策略 2、决策程序 管理人执行本集合计划的投资职能。管理人的投资决策程序简述如下：投资经理负责品种选择及投资组合建立；集中交易室执行交易；投资决策小组负责审核和调整投资经理提交的资产配置、投资计划等投资策略，投资决策委员会负责审议和确定投资范围和投资品种，该委员会是资产管理业务投资决策的最高权力机构。投资决策委员会下设质量控制小组负责业务的合规管理、风险管理和质量控制事宜。 3、投资管理的方法和标准 （3）制定投资策略与资产配置比例 投资经理综合考虑政治、经济及资	（五）投资策略 2、决策程序 管理人执行本集合计划的投资职能。管理人的投资决策程序简述如下：相关资产管理业务投资决策委员会负责审议和确定本集合计划投资范围和投资策略；投资经理负责投资品种选择及投资组合建立；集中交易室执行交易；相关履行合规风控职能部门独立负责合规管理、风险管理事宜。 管理人将根据监管规定，内控管理需要，并充分保障投资者权益的基础上，适时调整上述决策程序，届时管理人将按最新的决策程序执行。 3、投资管理的方法和标准 （3）制定投资策略与资产配置比例 投资经理综合考虑政治、经济及资

本市场状况等因素，根据投资目标、原则、限制和研究建议，拟定投资策略，包括整体资产配置策略（期限结构和资产结构）、具体资产配置方案等，报投资决策委员会审批通过。	投资经理综合考虑政治、经济及资本市场状况等因素，根据投资目标、原则、限制和研究建议，拟定投资策略，包括整体资产配置策略（期限结构和资产结构）、具体资产配置方案等，报资产管理业务投资决策委员会审批通过。
（六）投资限制 为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为： 1、债券（不含短期融资券、超短期融资券）的债项评级为 AA+及以上，短期融资券、超短期融资券的债项评级为 A-1 及以上，如债券无债项评级的，发行人主体评级或债券担保人主体评级需为 AA+及以上。主体评级和债项评级均不参考中债资信评估有限责任公司出具的评级结果。 2、本计划总资产不得超过计划净资产的 160%。 3、本计划投资单只债券持有市值不超过其发行规模的 25%（国债、地方政府债券、央行票据和政策性金融债除外）； 4、本计划投资单一货币基金或债券型基金不超过该基金份额的 20%。（根据最新基金份额计算）。 5、本集合计划投资于同一资产的资金，不得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	（六）投资限制 为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为： 1、债券（不含短期公司债券（指债券期限不超过一年的公司债券）、短期融资券、超短期融资券）的债项评级需为 AA 级及以上，短期公司债券、短期融资券、超短期融资券的债项评级需为 A-1 级，如债券无债项评级的，发行人主体评级或债券担保人评级需为 AA 级及以上。主体评级和担保人评级均不参考中债资信评估有限责任公司出具的评级结果。 2、本集合计划总资产不得超过集合计划净资产的 160%。 3、本集合计划投资于同一资产的资金不得超过本集合计划资产净值的 25%，银行活期存款、国债、地方政府债券、央行票据和政策性金融债除外。 4、本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划资产净值的 20%。 5、本集合计划开放退出期内，其

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)； 6、本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。 7、本计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%。 8、不得投资于投资范围之外的投资品种。 9、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。	资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本集合计划资产净值的 10%。 6、本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，该集合计划的总资产不得超过其净资产的 120%，国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。 7、不得投资于投资范围之外的投资品种。 8、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。
(七) 禁止行为 1、利用集合计划从事内幕交易、操纵市场或者其他不当、违法的证券期货业务活动； 2、泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关交易活动； 3、为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利； 4、从事不公平交易、利益输送等损害投资者合法权益的行为； 5、利用集合计划进行商业贿赂； 6、侵占、挪用集合计划财产； 7、利用集合计划或者职务便利为投资者以外的第三方谋取不正当利益； 8、直接或者间接向投资者返还管理费；	(八) 禁止行为 1、利用集合计划从事内幕交易、操纵市场或者其他不当、违法的证券期货业务活动； 2、泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关交易活动； 3、为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利； 4、利用集合计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资； 5、为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利； 6、从事不公平交易、利益输送等

9、以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用集合计划财产进行不必要的交易； 10、直接投资商业银行信贷资产；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；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； 11、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）； 12、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。	损害投资者合法权益的行为： 7、利用集合计划进行商业贿赂； 8、侵占、挪用集合计划财产； 9、利用集合计划或者职务便利为投资者以外的第三方谋取不正当利益； 10、直接或者间接向投资者返还管理费； 11、以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用集合计划财产进行不必要的交易； 12、直接投资商业银行信贷资产；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；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；
	13、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； 14、通过委托贷款、信托贷款等方式从事经营性民间借贷活动； 15、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； 16、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； 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； 18、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； 19、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； 20、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本款第 13 项至第 19 项规定的活动； 21、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。
--	--

17、对原合同第十一章“集合计划的投资”中新增以下表述，后续项目编号顺延：

新增表述：
（七）买入后持仓债券的债项评级、发行人主体评级或担保人评级低于投资评级限制的处理方式及流程 如因证券期货市场环境变化或相关主体经营情况等的因素，导致买入后持仓债券的债项评级、发行人主体评级或担保人评级发生评级下调且低于投资评级限制的，管理人须于 20 个工作日内对该债券风险作出补充评估并明确处置决定，并在集合计划定期报告中进行相应披露。

18、对原合同第十四章“利益冲突及关联交易”之“（二）关联交易”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
关联方指管理人及托管人的关联方，关联交易指管理人将集合计划资产	1、关联交易定义 本集合计划涉及的关联交易的具

投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。 <u>投资者在此同意并授权管理人可以从事上述关联交易。交易完成后，管理人应及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露，通过管理人指定网站告知投资者，并按相关规定报告，采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。</u>	体类型包括但不限于： （1）买卖本集合计划关联方发行证券或承销期内承销的证券（含资产支持证券）； （2）通过本集合计划关联方（管理人除外）席位及交易单元进行产品交易； （3）向本集合计划关联方（管理人、托管人除外）支付报酬； （4）投资于本集合计划关联方管理的其他资产管理计划； （5）与关联方开展证券等交易，交易对手方、质押券涉及关联方。 管理人从事的重大关联交易包括但不限于：
	（1）本集合计划与一个关联方之间单笔交易金额达到 3000 万元以上且占本集合计划资产净值 5%以上的交易； （2）管理人管理的多个资产管理计划与一个关联方之间年度累计交易金额达到 8000 万元以上且占该多个资产管理计划资产净值 10%以上的交易； （3）本集合计划投资其关联方发行证券或承销期内承销的证券（含资产支持证券）。 除上述提到的重大关联交易外，其他关联交易视为一般关联交易。 如法律法规、监管规定以及管理人内部管理制度发生变化的，管理人将适

	时调整上述定义和区分标准，并以公告等形式进行披露及遵照执行。 2、关联交易程序 管理人进行关联交易，应当符合本合同约定的投资目标及策略，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益，并区分一般和重大关联交易进行分级管理，履行不同的交易决策及信息披露程序。 投资者在此同意并授权管理人可以从事一般关联交易，根据管理人的内部制度由相关内控部门进行审批，交易完成后管理人在定期报告中向投资者统一进行披露，并告知托管人及向监管机构报告。管理人从事重大关联交易的，应通过逐笔征求意见或者公告确认等方式取得投资者同意，管理人将保障不同意投资者的退出权利，不同意管理人从事重大关联交易的投资者可在管理人指定的开放期内退出，未在管理人指定的开放期退出其持有全部份额及开放期参与的投资者视为同意管理人从事重大关联交易。重大关联交易根据管理人的内部制度提交资产管理业务投资决策委员会进行审批，交易完成后管理人在临时报告和定期报告中向投资者披露，并告知托管人及向监管机构报告。（如信披与报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）
--	---

	如法律法规、监管规定以及管理人内部管理制度发生变化的，管理人将适时调整上述内部审批机制，并以公告的形式进行披露及遵照执行。 3、关联方认定 关联方按照《企业会计准则》及证券公司相关规定确定。本集合计划关联方包括管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方。管理人关联方名单详见管理人指定网站公告。托管人关联方名单详见托管人官网（http://www.nbc.com.cn/）最新披露的年度报告。 管理人、托管人根据自身及对方提供的关联方名单进行关联交易监控，双方均应事前将其关联方名单或关联方披露途径明确告知相对方，并在相关信息更新时及时通知相对方。因一方未及时提供关联方名单或提供渠道不能查询最新关联方信息导致另一方监控不及时的，由违约方承担相关责任。

19、对原合同第十五章“投资经理的指定与变更”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（一）投资经理的指定 本集合计划投资经理由管理人负责指定。 管理人指定本集合计划的投资经理为：张旭，投资经理简介如下： 张旭先生，硕士研究生学历，具有	（一）投资经理的指定 本集合计划投资经理由管理人负责指定。 管理人指定本集合计划的投资经理为：程杨、冯洁莹、段奕冰，投资经理简介如下：

多年固定收益市场投资分析经验，擅长对市场主体的信用风险把握，同时对宏观经济、货币政策有深刻的理解和认知。不存在兼职情况，具备基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。	程杨先生，北京理工大学工学硕士，不存在兼职情况。曾任职五矿证券固定收益部债券交易员，申港证券资产管理部投资经理助理、交易员、研究员。具有丰富的固定收益市场投资研究经验，擅于自下而上跟踪市场获取信用风险溢价。 冯洁莹女士，清华大学经济学学士，不存在兼职情况。曾从事海外衍生品的投资交易，以及国内固收类证券及衍生品策略的研究和交易，先后任职于交易、研究、投资等岗位，从业时间超过 10 年，在产品设计和投资交易领域具有丰富经验。 段奕冰女士，东北林业大学管理学硕士，不存在兼职情况。具有 9 年固定收益市场投资管理从业经历。历任龙江银行股份有限公司金融市场部交易员、投资经理。具有丰富的固定收益市场投资交易经验。
（二）投资经理变更的条件和程序 管理人可以根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知投资者。 管理人在指定网站公告投资经理调整事项即视为履行了告知义务。	（二）投资经理变更的条件和程序 管理人可以根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知投资者，变更生效时间以管理人公告为准。 管理人在指定网站公告投资经理调整事项即视为履行了告知义务。

20、在原合同第十六章“集合计划的财产”之“（一）集合计划财产的保管与处分”中删除以下表述：

删除表述：
6、集合计划投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，托管人应安全保管在集合计划相关账户的财产，监督管理人投资运作。

21、对原合同第十七章“投资指令的发送、确认和执行”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（六）更换投资指令被授权人的程序 管理人更换被投资指令授权人、更改或终止对被投资指令授权人的授权范围的，应提前通知托管人，变更授权的文件应由管理人的法定代表人或其授权代表签署并加盖公章。变更授权的文件应载明新授权生效日期，若托管人收到文件的日期晚于其载明的生效日期的，则自托管人收到该文件时生效，同时原授权文件作废。变更授权的文件应以原件形式送达托管人。变更授权文件生效前，托管人仍应按原约定执行投资指令，管理人不得否认其效力。在特殊情况下，可按双方商定的方式处理。	（六）更换投资指令被授权人的程序 管理人更换投资指令被授权人、更改或终止对投资指令被授权人的授权范围的，应提前通知托管人，变更授权的文件应由管理人的法定代表人或其授权代表签署并加盖公章。变更授权的文件应载明新授权生效日期，若托管人收到文件的日期晚于其载明的生效日期的，则自托管人收到该文件时生效，同时原授权文件作废。变更授权的文件应以原件形式送达托管人。变更授权文件生效前，托管人仍应按原约定执行投资指令，管理人不得否认其效力。在特殊情况下，可按双方商定的方式处理。

22、对原合同第十八章“越权交易的界定”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（二）越权交易的处理程序 1、违反有关法律法规和资产管理合同的规定进行的投资交易行为 （1）托管人发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反资产管	（二）越权交易的处理程序 1、违反有关法律法规和资产管理合同的规定进行的投资交易行为 （1）托管人发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反资产管

理合同约定的，有权拒绝执行并通知管理人，并有权报告中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会。 (2) 根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人应及时通知管理人，并有权报告中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会。 (3) 管理人应向托管人主动报告越权交易，托管人有权督促管理人在限期内改正并在该限期内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权报告中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会。	理合同约定的，有权拒绝执行并通知管理人，并有权报告中国证监会相关派出机构（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。 (2) 根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人应及时通知管理人，并有权报告中国证监会相关派出机构（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。 (3) 管理人应向托管人主动报告越权交易，托管人有权督促管理人在限期内改正并在该限期内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权报告中国证监会相关派出机构（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。
(三) 托管人对管理人投资运作的监督 托管人根据相关法律法规及资产管理合同的约定，对本集合计划以下投资事项进行监督。托管人根据本第十八章节第（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。 1、主要投资方向及投资范围	(三) 托管人对管理人投资运作的监督 托管人根据相关法律法规及资产管理合同的约定，对本集合计划以下投资事项进行监督。托管人根据本合同第十八章节第（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，若本合同第十八章节第（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，以本合同第十八章节第（三）条“托管人对管理人投资运作的监督”约定为准。 1、主要投资方向及投资范围

(1) 投资的固定收益类资产包括 1) 债券类固定收益品种：包括在交易所市场、银行间市场依法上市交易的国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（包括金融机构次级债、混合资本债、政策性金融债）、企业债、公司债（含非公开发行债券）、中期票据（含长期限含权中期票据）、一般短期融资券及超短期融资券、非公开定向债务融资工具、资产证券化产品（如资产支持证券、资产支持票据）优先级； 2) 货币市场工具：包括现金、银行存款、同业存单、债券逆回购； 3) 公开募集证券投资基金：包括货币市场基金、债券型基金；	(1) 固定收益类资产：包括在交易所市场、银行间市场依法上市交易的国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（包括金融机构次级债、混合资本债、政策性金融债）、企业债、公司债（含非公开发行债券）、中期票据（含长期限含权中期票据）、短期融资券及超短期融资券、非公开定向债务融资工具、资产证券化产品（包括资产支持证券、资产支持票据）优先级、现金、银行存款、同业存单、债券逆回购、货币市场基金、债券型基金； (2) 债券正回购。 法律法规或监管机构允许投资的品种，并且得到投资者书面确认的，经管理人及托管人书面一致同意后，可以
(2) 债券正回购； 法律法规或监管机构允许投资品种，并且得到资产投资者书面确认的，经管理人及托管人一致同意后，可以将其纳入投资范围。 2、投资比例 固定收益类资产：占集合计划总资产的比例为 80%-100%。 具体比例按照该固定收益类资产的市值占整个资产管理计划总值的比例来计算。 3、投资限制 (1) 债券（不含短期融资券、超	将其纳入投资范围。 2、投资比例 固定收益类资产：占集合计划总资产的比例为 80%-100%。 具体比例按照该固定收益类资产的市值占整个资产管理计划总值的比例来计算。 3、投资限制 (1) 债券（不含短期公司债券（指债券期限不超过一年的公司债券）、短期融资券、超短期融资券）的债项评级需为 AA 级及以上，短期公司债券、短期融资券、超短期融资券的债项评级需

短期融资券)的债项评级为 AA+及以上,短期融资券、超短期融资券的债项评级为 A-1 及以上,如债券无债项评级的,发行人主体评级或债券担保人主体评级需为 AA+及以上。主体评级和债项评级均不参考中债资信评估有限责任公司出具的评级结果。 (2) 本计划总资产不得超过计划净资产的 160%。 (3) 本计划投资单只债券持有市值不超过其发行规模的 25% (国债、地方政府债券、央行票据和政策性金融债除外); (4) 本计划投资单一货币基金或债券型基金不超过该基金份额的 20%。(根据最新基金份额计算)。 (5) 本集合计划投资于同一资产的资金,不得超过本集合计划净资产的 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); (6) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划净资产的 20%。 (7) 本计划开放退出期内,其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值,不低于该计划净资产的 10%。 (8) 不得投资于投资范围之外的	为 A-1 级,如债券无债项评级的,发行人主体评级或债券担保人评级需为 AA 级及以上。主体评级和担保人评级均不参考中债资信评估有限责任公司出具的评级结果。 (2) 本集合计划总资产不得超过集合计划净资产的 160%。 (3) 本集合计划投资于同一资产的资金不得超过本集合计划净资产的 25%,银行活期存款、国债、地方政府债券、央行票据和政策性金融债除外。 (4) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划净资产的 20%。 (5) 本集合计划开放退出期内,其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值,不低于本集合计划净资产的 10%。 (6) 本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的,该集合计划的总资产不得超过其净资产的 120%,国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。 (7) 不得投资于投资范围之外的投资品种。 (8) 法律法规或监管部门规定的其
---	--

投资品种。 (9) 法律法规或监管部门规定的 其他投资限制。	他投资限制。
--	---------------

23、对原合同第十九章“交易及交收清算安排”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
资产管理人和资产托管人在委托财产场内清算交收及相关风险控制方面的职责按照《托管银行证券资金结算协议》的要求执行。	集合计划采用托管人结算模式，托管人负责办理因集合计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的清算交割。 (一) 资金前端控制额度信息的申报 管理人应当向托管人提供资金前端控制最高额度相关信息，由托管人向中国结算申报，申报信息包括：合计资产总额、交易参与人代码、交易参与人名称、控制类别、最高额度等。其中，最高额度按合计资产总额的1倍计算，合计资产总额是指前一交易日日终管理人在托管人处相关产品的合计托管账户资产总额。管理人授权托管人向中国结算申报上述信息，其中合计资产总额以管理人与托管人核对一致的估值结果中的资产总额为准，如信息申报时段估值结果未核对一致，合计资产总额以托管人估值结果中的资产总额为准。 自设额度为管理人自行申报的低于最高额度的额度，自设额度应低于最高额度。

	因资金前端控制业务规则而无法完成某笔或某些交易，由此造成的损益由集合计划财产承担。 （二）管理人和托管人在资产管理计划财产场内清算交收及相关风险控制方面的职责按照《托管银行证券资金结算协议》的要求执行。
--	---

24、对原合同第二十章“集合计划财产的估值和会计核算”之“（三）估值方法”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
4、首次发行未上市债券采用第三方估值机构提供的价格确定公允价值，第三方估值机构未提供估值价格时，按成本进行估值。	4、对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

25、对原合同第二十一章“集合计划的费用与税收”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（一）集合计划的费用种类、费率、计提标准、计提方式与支付方式 银行间费用（如有）：资产管理人应根据银行间费用相关法律法规及本合同约定，将账户开户、结算管理等各项费用列入或摊入当期委托财产运作费用，经管理人和托管人核对无误后，由管理人授权后划付，管理人收到托管人通知后一个月内未授权划付的，由托管人从委托资产中扣划，无须资产	（一）集合计划的费用种类、费率、计提标准、计提方式与支付方式 8、银行间费用（如有）：管理人应根据银行间费用相关法律法规及本合同约定，将账户开户、结算管理等各项费用列入或摊入当期资产管理计划财产运作费用，经管理人和托管人核对无误后，由管理人授权后划付。资产投资者和管理人在此申明已了解资产管理计划财产投资会产生的银行间费用，

管理人出具指令。资产投资者和资产管理人在此申明已了解委托资产投资会产生银行费用，并确保账户中有足够资金用于银行费用的支付，如因托管账户中的资金不足以支付银行费用影响到指令的执行，资产托管人不承担由此产生的损失和责任。如委托资产未起始运作，由管理人在收到托管人的缴费通知后完成支付，托管人不承担垫付费用义务。	并确保账户中有足够资金用于银行间费用的支付，如因托管账户中的资金不足以支付银行间费用影响到指令的执行，托管人不承担由此产生的损失和责任。如资产管理计划财产未起始运作，由管理人在收到托管人的缴费通知后完成支付，托管人不承担垫付费用义务。
(三) 管理人的业绩报酬 1、业绩报酬的计提原则及提取频率 (1) 本计划将在投资者申请退出或本集合计划期满清算时，仅对退出或清算的份额提取。若投资者申请退出的，则退出确认日为业绩报酬计提日；若合同提前终止或到期终止，则合同终止日为业绩报酬计提日； (2) 按份额持有人每笔参与份额分别计提业绩报酬； (3) 当投资者申请退出或本计划期满清算时，业绩报酬从投资者退出或清算金额中扣除； (4) 份额持有人退出或本集合计划终止时，业绩报酬对应按照份额持有人退出份额和本计划终止时持有份额计算。如退出份额为某一笔认购/申购份额的一部分，则该退出份额单独核算	(三) 管理人的业绩报酬 1、业绩报酬的计提原则及提取频率 (1) 本集合计划将在两种情况下计提业绩报酬： ①是投资者申请退出（含临时开放期的退出及违约退出）或本集合计划终止清算时提取；②是收益分配时提取； (2) 按份额持有人每笔参与份额分别计提业绩报酬； (3) 当投资者申请退出或本集合计划终止清算时，业绩报酬从投资者退出或清算金额中扣除；收益分配时，业绩报酬从投资者收益分配金额中扣除，收益分配金额应当覆盖业绩报酬； (4) 份额持有人退出或本集合计划终止时，业绩报酬对应按照份额持有人退出份额和本集合计划终止时持有份额计算。如退出份额为某一笔持仓份

业绩报酬，而该笔认购/申购份额的剩余部分不受影响；

(5) 业绩报酬提取应当与资产管理计划的存续期限和投资运作特征相匹配，提取频率不得超过每6个月一次。因投资者退出资产管理计划时，管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

2、业绩报酬的计算方法及计提比例

在业绩报酬计提日，管理人计算上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，募集期参与的为集合计划成立日，存续期参与的为份额确认日）到本次业绩报酬计提日的年化收益率 R ，若年化收益率 R 小于或等于 r ，则管理人不提取业绩报酬；若年化收益率 R 大于 r ，则管理人对超出部分按 60% 的比例累进提取业绩报酬，于支付日由管理人出具划款指令给托管人，由托管人根据划款指令支付。

年化收益率的计算公式如下：

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

R 为年化收益率； P_1^* 为业绩报酬计提日的单位累计净值； P_0^* 为上一业绩报酬计提日的单位累计净值； P_0 为上一报

额的一部分，则该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔剩余份额不受影响；

(5) 业绩报酬提取应当与集合计划的存续期限、收益分配和投资运作特征相匹配，从收益分配金额中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次。

2、业绩报酬的计算方法及计提比例

在业绩报酬计提日，管理人计算上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年化收益率 R ，若年化收益率 R 小于或等于 r ，则管理人不提取业绩报酬；若年化收益率 R 大于 r ，则管理人对超出部分按 60% 的比例提取业绩报酬，于支付日由管理人出具划款指令给托管人，由托管人根据划款指令支付。

年化收益率的计算公式如下：

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

R 为年化收益率； P_1^* 为业绩报酬计提日前一日的累计单位净值； P_0^* 为上一个业绩报酬计提日前一日的累计单位净值（若不存在则取份额确认日前一日的累计单位净值）； P_0 为上一个业绩报酬计提日前一日的单位净值（若不存在则取份额确认日前一日的单位净值）； D 为上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（清盘计提业

酬计提日的单位净值； D 为上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限。

管理人业绩报酬计提公式如下：

收 益率 (R)	计 提比例	业绩报酬 (I)
$R \leq r$	0	0
$R > r$	60 %	$I = [(R - r) \times 60\%] \times A \times D$

其中：

(1) I 为管理人应提的业绩报酬；

(2) A 为对应份额在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额；

(3) D 为上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限；

(4) r 为管理人业绩报酬计提的计提基准，在本计划成立时约定为【4.5%】。

管理人有权根据市场情况不定期调整业绩报酬计提的计提基准，但调整频率必须和本计划开放期匹配，调整周期不能短于两次开放期的间隔时间。管理人将提前3个交易日以在管理人网站公告的形式告知相关调整。管理人以在管理人网站 (www.shgsec.com) 公告或投资者认可的其他形式告知前述调整事项即视为履行了告知义务。

绩报酬时， D 为上一个业绩报酬计提日到集合计划终止日的年限，若上一个业绩报酬计提日不存在则取份额确认日)。

管理人业绩报酬计提公式如下：

收 益率 (R)	计 提比例	业绩报酬 (I)
$R \leq r$	0	0
$R > r$	60 %	$I = [(R - r) \times 60\%] \times A \times D$

其中：

(1) I 为管理人应提的业绩报酬；

(2) A 为对应份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额；

(3) D 为上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限 (清盘计提业绩报酬时， D 为上一个业绩报酬计提日到集合计划终止日的年限；若上一个业绩报酬计提日不存在则取份额确认日)；

(4) r 为管理人业绩报酬计提的计提基准，约定为【4.2%】。

管理人有权根据市场情况及集合计划运作情况调整业绩报酬计提的计提基准，但调整频率必须和本集合计划开放退出期匹配，调整周期不能短于两次开放退出期的间隔时间。管理人将提前3个交易日以在管理人网站公告的形式告知相关调整。业绩报酬计提基准的

因业绩报酬计算涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。 3、业绩报酬支付 由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人据此计提应付的管理人业绩报酬，于收到划付指令后复核，并在5个工作日内从集合计划资产中将计提的业绩报酬一次性支付给管理人。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。 4、业绩报酬计提基准确定依据及说明 在集合计划初始募集期以及开放期（不含临时开放期）开始之前，管理人以公告形式告知投资者（包括届时现存的投资者）、托管人下一封闭期适用的业绩报酬计提基准。业绩报酬计提基准的变化，可能对投资者的利益产生不利影响。已持有本集合计划份额的投资者，如不接受调整后的业绩报酬计提基准的，有权并应当根据资产管理合同约定在开放期办理退出集合计划份额；在开放期后投资者继续持有任何本集合计划份额的，视为对调整后的业绩报酬计提基准无异议。 本集合计划设置的业绩报酬计提基准主要是管理人基于集合计划的投	变化，可能对投资者的利益产生不利影响。已持有本集合计划份额的投资者，如不接受调整后的业绩报酬计提基准的，有权并应当根据资产管理合同约定在开放期办理退出集合计划份额；在开放期后投资者继续持有任何本集合计划份额的，视为对调整后的业绩报酬计提基准无异议。 因业绩报酬计算涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人计算。 3、业绩报酬支付 由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人据此计提应付的管理人业绩报酬，于收到划付指令后在5个工作日内从集合计划资产中将计提的业绩报酬一次性支付给管理人。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。 4、业绩报酬计提基准确定依据及说明 本集合计划设置的业绩报酬计提基准主要是管理人基于集合计划的投资组合，并考虑管理成本、合理利润等相关费用后确定。管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划资产本金不受损失，也不保证最低收益。本集合计划的业绩报酬计提基准仅为本集合
---	--

投资组合，并考虑管理成本、合理利润等相关费用后确定。管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划资产本金不受损失，也不保证最低收益。本集合计划的业绩报酬计提基准仅为本集合计划管理人提取业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人和销售机构保证委托财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。 （四）费用调整 管理人可调减管理费或调低管理人业绩报酬计提比例或与托管人协商调减托管费，并在新的费率或计提比例开始实施前在管理人指定网站公告，无须征得投资者同意，管理人指定网站上发布公告即视为履行了告知义务。	计划管理人提取业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人和销售机构保证资产管理计划财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。 （四）费用调整 在不损害投资者利益的前提下，管理人可调减管理费率、业绩报酬计提比例或与托管人协商调减托管费率，并在新的费率或业绩报酬计提比例开始实施前在管理人指定网站公告，履行告知投资者义务，具体生效时间以公告为准。
---	---

26、对原合同第二十二章“集合计划的收益分配”之“（二）收益分配原则”中新增以下表述，后续项目编号顺延：

新增表述：
5、在不违反法律法规且对投资者利益无实质不利影响的前提下，管理人可在法律法规允许的前提下，酌情调整收益分配原则和支付方式，并于变更实施日前在管理人指定网站向投资者披露。

27、对原合同第二十二章“集合计划的收益分配”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（四）收益分配的执行方式	（四）收益分配的执行方式
2、本集合计划收益分配时，只采	2、本集合计划收益分配时，收益

用现金分红的方式，由托管人根据管理人指令将分红款划拨给份额登记机构，再由份额登记机构以货币资金形式将分红款划入投资者账户或销售机构账户。托管人依据合同约定及管理人指令，对收益分配方案中的收益范围、分配方式、分配金额等要素进行核对。若划至销售机构/推广机构统一分配，托管人对于收益分配方案的复核内容限于对收益分配的总金额进行复核，对于在不同投资者之间分配的金额、分配顺序不承担复核义务，管理人应对向受益人划转资金本息的及时性、准确性负责。	分配方式为现金分红或分红转投资，投资者未明确的，默认为现金分红。现金分红或分红转投资的分红款为扣除管理人业绩报酬后的金额（如有）。 3、若采用现金分红的方式，由托管人根据管理人指令将分红款划拨给份额登记机构，再由份额登记机构以货币资金形式将分红款划入销售机构账户。 4、若采用分红转投资的方式，管理人将把分红资金自动转为集合计划份额进行再投资。 托管人依据合同约定及管理人指令，对收益分配方案中的可供分配利润、分配方式、分配金额等要素进行核对。若划至份额登记机构统一分配，托管人对于收益分配方案的复核内容限于对收益分配的总金额进行复核，对于在不同投资者之间分配的金额、分配顺序不承担复核义务，管理人应对向销售机构划转资金本息的及时性、准确性负责，销售机构应对向投资者划转资金本息的及时性、准确性负责。
---	--

28、对原合同第二十三章“信息披露与报告”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（一）定期报告 定期报告包括集合计划份额净值报告、集合计划的季度报告和年度报告、托管年度报告、年度审计报告。	（一）定期报告 定期报告包括集合计划份额净值报告、集合计划的季度报告和年度报告、集合计划的季度和年度托管报告、

..... 2、集合计划的季度报告和年度报告 （9）投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项； 3、托管年度报告 托管人在每年度结束之日起四个月内编制托管年度报告，并报中国证监会相关派出机构和中国证券投资基金业协会备案（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。	年度审计报告。 2、集合计划的季度报告和年度报告 （9）投资经理变更、关联交易等涉及投资者权益的重大事项； 3、集合计划的季度和年度托管报告 托管人在每季度和每年度提供集合计划季度报告和年度报告，季度报告应于每季度结束之日起一个月内由管理人通过指定网站等披露，年度报告应于在每年度结束之日起四个月内披露（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。
（二）临时报告 集合计划存续期间，发生资产管理合同约定或可能对集合计划持续运行、投资者利益、集合计划资产净值产生重大影响的事项，管理人应当在事项发生之日起5日内以指定网站公告方式向投资者披露，并按照相关规定及时报告。临时报告的情形包括但不限于： 1、集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资经理发生变更；	（二）临时报告 集合计划存续期间，发生资产管理合同约定或可能对集合计划持续运行、投资者利益、集合计划资产净值产生重大影响的事项，管理人应当在事项发生之日起5个工作日内以指定网站公告方式向投资者披露（除第4条情形外），并按照相关规定及时报告。临时报告的情形包括但不限于： 1、集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投

2、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请； 3、发生巨额退出并延期支付； 4、集合计划终止和清算； 5、集合计划存续期满并展期； 6、资产管理合同的补充、修改与变更； 7、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项； 8、负责本集合计划的销售机构发生变更； 9、以集合计划资产从事重大关联交易的； 10、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； 11、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责； 12、发生其他对集合计划持续运行、投资者利益、集合计划资产净值产生重大影响事件的； 13、监管机构规定应当披露的其他情形。	资经理发生变更； 2、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请； 3、发生巨额退出并延期支付； 4、集合计划T日收市后单位净值小于等于集合计划预警线（管理人应在计算出该净值并与托管人核对一致后的一个工作日内进行披露预警）； 5、集合计划终止和清算； 6、集合计划存续期满并展期； 7、资产管理合同的补充、修改与变更； 8、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项； 9、负责本集合计划的销售机构发生变更； 10、以集合计划资产从事重大关联交易的； 11、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格； 12、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责； 13、发生其他对集合计划持续运行、投资者利益、集合计划资产净值产生重大影响事件的； 14、监管机构规定应当披露的其他情形。
（三）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人	（三）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人

或者其他关联方参与本集合计划的，管理人将及时以指定网站公告方式向投资者充分披露，并及时报送中国证监会相关派出机构和中国证券投资基金业协会。	或者其他关联方参与本集合计划的，管理人将以指定网站公告方式向投资者充分披露，并及时向中国证监会相关派出机构报告（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。
---	---

29、对原合同第二十四章“风险揭示”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（一）特殊风险揭示 2、集合计划委托募集所涉风险 管理人可以委托具有基金销售资格的机构募集本集合计划，虽然管理人通过签署相关协议与销售机构进行权利义务的划分，但仍可能存在因销售机构自身违法违规行为、违反资产管理合同约定的操作、技术系统故障或操作差错等非管理人的原因而导致集合计划投资者合法权益受损的风险。 3、集合计划未在中国证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险 本集合计划相关材料需要报中国证券投资基金业协会备案，若出现未完成备案手续或不予备案的情形，则需要按照监管机构或自律协会的要求修改资产管理合同或者根据资产管理合同约定本集合计划应当终止清算，存在无法投资运作的风险。同时可能发生备案	（一）特殊风险揭示 2、集合计划委托募集所涉风险 管理人可以委托具有公开募集证券投资基金销售资格的机构募集本集合计划，虽然管理人通过签署相关协议与销售机构进行权利义务的划分，但仍可能存在因销售机构自身违法违规行为、违反资产管理合同约定的操作、技术系统故障或操作差错等非管理人的原因而导致集合计划投资者合法权益受损的风险。 3、集合计划未在中国证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险 本集合计划相关材料需要报中国证券投资基金业协会备案，可能出现未完成备案手续或不予备案的情形，包括首次提交备案及修改资产管理合同后提交备案未通过等情况，故存在无法投资运作需提前终止或因备案周期较长

时间较长的情况，且监管机构要求集合计划证券账户、期货账户等需备案通过后方可申请开通，因此存在影响集合计划的运营、投资的风险，请投资者注意。	影响相关账户开立，从而影响集合计划的投资运作的风险。 4、集合计划锁定期无法赎回的风险 本集合计划对投资者的每笔参与份额持有时间设置锁定期，锁定期为当次参与所对应的申购确认日起 80 个自然日，投资者仅可申请满足锁定期要求的份额退出，对于不满足锁定期要求的份额管理人有权拒绝赎回。
(二) 一般风险揭示 1、本金损失风险 本集合计划的风险等级为 R2，属于中风险，适合合格投资者中专业投资者及风险承受能力为谨慎型（C2）、稳健型（C3）、积极型（C4）、激进型（C5）的普通投资者。	(二) 一般风险揭示 1、本金损失风险 本集合计划的风险等级为 R2，属于中低风险，适合合格投资者中专业投资者及风险承受能力为谨慎型（C2）、稳健型（C3）、积极型（C4）、激进型（C5）的普通投资者。
7、集合计划份额转让所涉风险 在集合计划存续期间，在转让条件允许的情况下，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计划份额，在办理转让业务时可能出现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某些人为或客观原因出现故障，从而影响转让业务办理； (2) 折/溢价风险。集合计划份额	7、集合计划份额转让所涉风险 在技术条件成熟的前提下，经管理人申请并开通份额转让事宜后，本集合计划份额可以转让。本集合计划份额如允许通过证券交易所以及中国证监会认可的交易平台依法转让，将会存在因转让场所规则限制、投资者持有份额被司法冻结、投资者未满足资产管理合同最低持有金额要求或其他不可抗力的因素等造成的转让失败风险。

转让的交易价格与其资产净值之间可能发生偏离并出现折价/溢价交易的风险； （3）集合计划份额在证券交易所进行转让的，并非集中竞价交易，可能不具有一个活跃的转让市场，存在难以找到交易对手或因交易双方未能就转让价格达成一致导致转让失败的风险。此外，证券交易所可以根据需要暂停或终止转让服务，可能导致份额转让失败或延期。	
8、投资标的风险 （6）债券回购风险 债券回购为提升整体组合收益提供了可能,但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险、杠杆风险及质押券价值变动风险。其中,信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时,不能偿还全部或部分证券或价款,造成损失的风险;投资风险是指在进行回购操作时,回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大,致使整个组合风险放大的风险;杠杆风险是指在进行回购操作时,在对组合收益进行放大的同时,也对组合的波动性(标准差)进行了放大,即组合的风险将会加大;质押券价值变动风险是指质押券在质押期	8、投资标的风险 （5）债券回购风险 债券回购为提升整体组合收益提供了可能,但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及杠杆风险。其中,信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时,不能偿还全部或部分证券或价款,造成损失的风险;投资风险是指在进行回购操作时,回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大,致使整个组合风险放大的风险;杠杆风险是指在进行回购操作时,在对组合收益进行放大的同时,也对组合的波动性(标准差)进行了放大,即组合的风险将会加大。回购比例越高,风险暴露程度也就越高,造成损失的可能

间,可能存在质押券价值波动、分期偿还、分期摊还、司法冻结或扣划等情形导致质押券贬值或不足的风险。回购比例越高,风险暴露程度也就越高,造成损失的可能性也就越大。	性也就越大。
10、关联交易的风险 本集合计划可能投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券,或从事其他重大关联交易。 虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则,遵守相关法律法规的规定进行操作,积极防范利益冲突,但仍可能存在因从事关联交易被监管机构认为存在重大风险,且管理人无法确保关联交易比类似的非关联交易的实际交易结果更优,进而可能影响投资者的利益。此外,管理人运用集合计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规被限制相关权利的行使,进而可能影响集合计划资产的投资收益。	10、关联交易的风险 (1) 关联交易特别风险提示 虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突,但仍可能因管理人运用集合计划财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险,进而可能导致投资者的利益受损。 此外,管理人运用集合计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使,进而可能影响集合计划财产的投资收益。 (2) 一般关联交易特定风险提示 根据本合同约定:“投资者在此同意并授权管理人可以从事一般关联交易”,管理人虽会采取措施防范利益冲突,保护投资者的合法权益,但投资者仍有可能面临一般关联交易存在相关投资风险、无法事前知悉每笔一般关联交易等情况,导致投资者利益受到损害的风险。 (3) 重大关联交易特定风险提示

	本集合计划进行重大关联交易时，管理人应遵守法律法规、监管规定、行业自律组织要求、合同约定及管理人相关内控制度，保护投资者的合法权益，但投资者仍有可能面临重大关联交易存在相关投资风险等情况，导致投资者利益受到损害的风险。 投资者应充分知悉本合同条款关于重大关联交易的各项机制安排和所涉风险，关注管理人相关公告并及时做出相应安排。
12、投资者退出的风险 投资者部分退出集合计划的，其退出后持有的集合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。投资者持有的集合计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出集合计划的，应当一次性全部退出。在此情况下投资者可能面临无法按申请份额退出本集合计划的风险。 本集合计划部分投资品种可能缺乏市场流动性，可能导致在投资者申请退出、本集合计划终止清算分配时，无法及时变现非现金资产，导致无法满足投资者退出本集合计划的需求。投资者申请退出时，可能发生巨额退出或连续巨额退出的情形，该情形下可能存在资产无法及时变现等流动性风险，届时管理人可以根据委托财产当时的流动性	12、投资者退出的风险 投资者部分退出集合计划的，其退出后持有的集合计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低持有金额。投资者提出部分退出申请后导致该投资者持有的剩余部分资产净值低于最低持有金额要求时，管理人有权按照最低持有金额强制保留其持有本集合计划的份额。 本集合计划部分投资品种可能缺乏市场流动性，可能导致在投资者申请退出、本集合计划终止清算分配时，无法及时变现非现金资产，导致无法满足投资者退出本集合计划的需求。投资者申请退出时，可能发生巨额退出或连续巨额退出的情形，该情形下可能存在资产无法及时变现等流动性风险，届时管理人可以根据资产管理计划财产当时

状况决定全额退出、部分延期退出或暂停退出，因延期退出造成退出价格波动导致的损失由投资者自行承担。	的流动性状况决定全额退出、部分延期退出、延期支付或暂停退出，因部分延期退出、延期支付或暂停退出导致的损失由投资者自行承担。
20、估值风险 本集合计划约定“对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券及其他不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定其公允价值。如本集合计划管理人认为成本能够近似体现公允价值，管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。”管理人针对上述交易品种可能采用成本估值，该估值方法存在无法真实反应资产交易时折溢价的风险。 本集合计划采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示所持资产的实际价值，或经济环境发生重大变化时，在一定时期内可能高估或低估本集合计划资产净值。管理人将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，与托管人协商，调整相应投资品种的估值，尽可能公允地反映集合计划资产价值。但调整估值可能引起本集合计划的净值波动。	20、估值风险 本集合计划采用的估值方法有可能不能充分反映和揭示所持资产的实际价值，或经济环境发生重大变化时，在一定时期内可能高估或低估本集合计划资产净值。管理人将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，与托管人协商，调整相应投资品种的估值，尽可能公允地反映集合计划资产价值。但调整估值可能引起本集合计划的净值波动。若管理人依据第三方提供的估值表或其他列明估值结果文件进行估值，因前述估值结果文件报送频率的时滞或数据偏差等因素可能导致本集合计划估值偏差。
21、前端控制风险 根据交易所、中登公司的相关规定，交易所、中登公司根据最高额度和	21、前端控制风险 根据交易所、中登公司的相关规定，交易所、中登公司根据最高额度和

自设额度对管理人的关联交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并对管理人实施前端控制，其中，最高额度为按照交易所、中登公司对于最高额度的定义计算的额度，自设额度为管理人自行申报的低于最高额度的额度，自设额度应低于最高额度。如果本集合计划或管理人管理的其他资产管理计划下的某笔交易导致管理人关联交易单元全天净买入申报金额达到或超过自设额度的，交易所将拒绝接受该笔交易及该关联交易单元后续的竞价交易买入申报，本集合计划的相关投资交易将无法成功申报。尽管管理人可在规定时间内通过托管人向中登公司申请盘中紧急调整最高额度或自设额度，但调整能否成功取决于申请是否在规定时间内、中登公司及交易所是否同意等诸多因素，并且调整完成需要一段时间，仍然存在无法及时完成投资的风险。上述原因可能导致管理人无法完成投资，从而影响投资收益、给委托财产造成损失。因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的，交易所、中登公司可以采取调整额度、暂停实施资金前端控制、限制交易单元交易权限等处置措施。资金前端控制异常情况及交易所、中登公司采取的相应措施可能影响管	自设额度对管理人的关联交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并对管理人实施前端控制，其中，最高额度为按照交易所、中登公司对于最高额度的定义计算的额度，自设额度为管理人自行申报的低于最高额度的额度，自设额度应低于最高额度。 （1）如果本集合计划或管理人管理的其他资产管理计划下的某笔交易导致管理人关联交易单元全天净买入申报金额达到或超过自设额度的，交易所将拒绝接受该笔交易及该关联交易单元后续的竞价交易买入申报，本集合计划的相关投资交易将无法成功申报。尽管管理人可在规定时间内通过托管人向中登公司申请盘中紧急调整最高额度或自设额度，但调整能否成功取决于申请是否在规定时间内、中登公司及交易所是否同意等诸多因素，并且调整完成需要一段时间，仍然存在无法及时完成投资的风险。上述原因可能导致管理人无法完成投资，从而影响投资收益、给资产管理计划财产造成损失。 （2）因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的，交易所、中登公司可以采取调整额度、暂停实施资金前端控制、限制交易单元交易权限等处置措施。资金前端控制异常情况及交易所、
---	---

理人的投资，影响委托财产的投资收益、给委托财产造成损失。	中登公司采取的相应措施可能影响管理人的投资，影响资产管理计划财产的投资收益、给资产管理计划财产造成损失。 (3) 如因管理人、托管人操作失误，合计资产总额发生变动导致最高额度未能及时变更等，影响产品正常交易、无法有效进行风险控制等风险。
------------------------------	--

30、对原合同第二十四章“风险揭示”之“(二)一般风险揭示”中新增以下表述，后续项目编号顺延：

新增表述： 25、存续期内持仓债项评级、发行人主体评级或担保人评级下调的风险 本集合计划存续期内，可能发生持仓债项评级、发行人主体评级或担保人发生评级下调且低于投资限制的情况，如遇评级下调，管理人可根据实际情况进行处置决定，包括但不限于继续持有已下调评级的资产、低于市场估值卖出已下调评级的资产等，进而产生相应的风险。 26、预警线和止损线风控措施的风险 (1) 本集合计划份额净值等于或低于预警线时，管理人将调整投资组合，并可能限制本集合计划投资操作的灵活性，直接影响本集合计划的收益水平。 (2) 本集合计划份额净值等于或低于止损线时，管理人将进行强制止损，执行平仓变现操作。止损线的设置本身是一种风险控制手段，但平仓操作的执行效果与所持有品种的流动性及平仓时所处的市场环境等因素有关，既可能出现存在平仓不能及时完成、本集合计划份额净值进一步下跌的可能，也可能出现因流动性等原因，平仓价格不理想导致本集合计划财产损失的可能性。 27、业绩报酬计提基准的风险 本集合计划的业绩报酬计提基准仅为本集合计划管理人提取业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人和销售机构保证资产管理计划财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。本集合计划业绩报酬计提基准发生变更时由管理人通过

公告形式告知投资者（包括届时现存的投资者）及托管人。业绩报酬计提基准的变化，可能对投资者的利益产生不利影响。已持有本集合计划份额的投资者如不接受调整后的业绩报酬计提基准的，应当根据资产管理合同约定在开放期退出其全部持有的集合计划份额。在开放期后投资者继续持有任何本集合计划份额的，视为对调整后的业绩报酬计提基准无异议。

31、对原合同第二十五章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（一）资产管理合同变更的条件和程序 1、因法律法规或中国证监会、中国证券投资基金业协会等监管机构的相关规定、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，并由管理人按照资产管理合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。如投资者对变更的内容有异议，可以根据管理人的安排申请退出集合计划；若投资者未在管理人指定的期限内申请退出其持有的全部集合计划份额，则视为同意，管理人不再另行通知。 2、因其他原因需要变更资产管理合同的，管理人和托管人应以书面形式就资产管理合同变更内容达成一致，并由管理人通知投资者。投资者不同意变更的，应在管理人公告指定的期限内申请退出其持有的全部集合计划份额；投	（一）资产管理合同变更的条件和程序 1、由于其他原因需要变更资产管理合同的，管理人和托管人应书面达成一致，并由管理人以指定网站公告方式或书面等形式通知投资者。投资者应在征询期间内给出书面或其他约定方式的答复。投资者不同意变更的，应当在管理人指定的期限内申请退出其持有的全部本集合计划份额；投资者答复不同意变更且在管理人指定的期限未退出的，管理人有权在指定的期限交易时间届满后将相关份额强制退出本集合计划；征询期限届满未有意见答复且在管理人指定的期限内未申请退出其持有的全部本集合计划份额的，视为同意资产管理合同变更，管理人不再另行通知。若前述指定期限与本集合计划开放期重合，则投资者在上述指定期限内根据资产管理合同约定参与集合计划的，

投资者在上述指定期限内未申请退出其持有的全部集合计划份额的，视为投资者同意资产管理合同变更。投资者同意，无论其是否提出退出申请，按照上述约定进行的资产管理合同变更均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。投资者在上述指定期限内根据资产管理合同约定参与集合计划的，视为同意资产管理合同变更并接受变更后的资产管理合同。资产管理合同变更自上述指定期限届满后次日或管理人公告中指定的资产管理合同变更生效日起生效。 3、集合计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意，并按上述规定履行资产管理合同变更程序。 4、根据资产管理合同约定进行资产管理合同变更的，同意变更的投资者无需就资产管理合同变更与管理人、托管人另行签署变更后的资产管理合同或关于资产管理合同变更的补充协议，经管理人公告的资产管理合同变更内容自变更生效时起自动成为变更后资产管理合同的组成部分。资产管理合同变更后，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的资产管理合同行使相关权利，履行相应义务。 5、资产管理合同发生变更的，管理人应按照中国证券投资基金业协会	视为同意资产管理合同变更并接受变更后的资产管理合同。资产管理合同变更自上述指定期限届满后次日或管理人公告中指定的资产管理合同变更生效日起生效。 2、因监管规则变化需要变更资产管理合同的，管理人可以与托管人书面协商一致后修改资产管理合同，并由管理人以指定网站公告的方式及时向投资者披露变更的具体内容。如投资者对变更的内容有异议，可以根据管理人的安排申请退出本集合计划。 3、集合计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意，并按上述规定履行资产管理合同变更程序。 4、资产管理合同发生变更的，管理人应按照中国证券投资基金业协会要求及时报中国证券投资基金业协会备案（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。 5、根据资产管理合同约定进行资产管理合同变更的，同意变更的投资者无需就资产管理合同变更与管理人、托管人另行签署变更后的资产管理合同或关于资产管理合同变更的补充协议，资产管理合同变更内容自变更生效时起自动成为变更后资产管理合同的组成部分。资产管理合同变更后，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的资
--	--

要求及时报中国证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。	产管理合同行使相关权利，履行相应义务。 6、投资者签署本合同即表示同意，管理人经与托管人书面达成一致后依据本合同规定进行的合同变更均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。
（三）集合计划的终止 5、存续期内，连续五个工作日集合计划投资者少于2人或开放期发生所有投资者提出全部份额的赎回申请，且当日无新增申购申请的情况； 特别提示：若本集合计划存续期间开放期发生所有投资者提出全部份额的赎回申请，且发生所有投资者全部份额赎回的当日无新增申购申请的情况下，当日投资者的退出申请将被判定为赎回失败，同时本集合计划将提前终止，终止后相关事项以合同终止约定为准； 6、未在中国证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形； 7、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。 管理人应当自集合计划终止之日起5个工作日内报中国证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构（如报备相关监管规定有变更，将	（三）集合计划的终止 5、存续期内，连续五个工作日集合计划投资者少于2人或开放期发生所有投资者提出全部份额的赎回申请，且无新增申购申请或申购申请不满足本集合计划存续条件的情况； 特别提示：若本集合计划存续期间开放期发生所有投资者提出全部份额的赎回申请，且无新增申购申请或申购申请不满足本集合计划存续条件，当日投资者的退出申请将被按赎回失败处理，同时本集合计划将提前终止，终止后相关事项以合同终止约定为准； 6、未在中国证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形（本合同另有规定的从其规定）； 7、在本集合计划存续期内任何一个交易日日终，本集合计划份额净值等于或低于止损线，T+1日本集合计划终止； 8、发生资产管理合同约定的应当

按最新规定执行），前述第 6 项约定的情形除外。 （四）有下列情形之一的，管理人有权决定（但并非必须）终止集合计划，无需取得投资者同意，并在指定网站公告： 1、当本集合计划资产净值低于人民币 1000 万元时，管理人有权（但并非必须）终止本集合计划。 2、在一定期限内无法完成中国证券投资基金业协会备案或取得备案的时间难以确定的，管理人有权视情况决定终止本集合计划。 3、发生影响或可能影响本集合计划运作的情形（包括但不限于法律法规变动、中国证监会或相关自律组织不时发布的监管意见等），管理人有权视情况决定终止本集合计划。	终止的情形； 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。 管理人应当自集合计划终止之日起 5 个工作日内报中国证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行），前述第 6 项约定的情形除外。 （四）有下列情形之一的，管理人有权决定（但并非必须）终止集合计划，无需取得投资者同意，并在指定网站公告： 1、本集合计划资产净值低于人民币 1000 万元，管理人有权视情况决定终止本集合计划； 2、如因监管政策变化、监管机构要求禁止或限制本合同项下业务的，管理人有权视情况决定终止本集合计划； 3、由于市场变化等管理人之外的因素导致本集合计划的投资目的已无法实现，继续存续不利于投资者利益的，管理人有权视情况决定终止本集合计划。
（五）集合计划的财产清算 2、集合计划财产清算的程序 （5）将清算报告及时向中国证监	（五）集合计划的财产清算 2、集合计划财产清算的程序 （5）将清算报告及时向中国证券

会相关派出机构和中国证券投资基金业协会报告； 5、集合计划延期清算处理方式 若本集合计划在清算时有未能变现的证券或资产，管理人可进行延期清算，对前述未能变现的证券或资产在可变现后进行二次清算，并将变现后的资产扣除相关费用后按照投资者持有份额占总份额的比例或资产管理合同的约定，以货币资金形式全部分配给投资者。	投资基金业协会报告（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）； 5、集合计划延期清算处理方式 若本集合计划在清算时有未能流通变现的资产，管理人可进行多次分配，并制定多次清算方案，该方案应经托管人认可，通过管理人指定网站进行披露。管理人应根据多次清算方案的规定，对前述未能流通变现的资产在可流通变现后进行多次清算，并将变现后的资产扣除相关费用后按照投资者持有份额占总份额的比例或资产管理合同的约定，以货币资金形式全部分配给投资者。
--	--

32、对原合同第二十六章“违约责任”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（一） 1、不可抗力。 2、管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会或中国证券投资基金业协会等监管机构的规定作为或不作为而造成的损失等。 3、管理人由于按照资产管理合同规定的投资原则行使或不行使其投资权利而造成的损失等。	（一） 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致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

	2、管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会或中国证券投资基金业协会等监管机构的规定作为或不作为而造成的损失等。 3、管理人由于按照资产管理合同规定的投资原则行使或不行使其投资权利而造成的损失等。 4、在计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。
--	--

33、对原合同第二十七章“争议的处理”中新增以下表述：

新增表述： 各方当事人确认，因本合同的签署、履行等引发争议而产生的仲裁中的送达根据以下约定方式及地址进行： 投资者全称：签订《申港证券睿泽1号集合资产管理计划资产管理合同》的投资者。投资者的约定方式及地址以其在纸质合同签署页或电子签名合同数据电文中列示的信息为准。 管理人全称：申港证券股份有限公司 1、邮寄送达地址：上海浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦19楼 邮编：200120 2、电子邮箱送达地址：leibote@shgsec.com；zcgl@shgsec.com 托管人全称：宁波银行股份有限公司 1、邮寄送达地址：中国浙江宁波市鄞州区宁东路345号 邮编：315000 2、电子邮箱送达地址：custody@nbcab.cn 3、传真送达号码：0574-89103213 各方当事人承诺，同意仲裁机构采用上述任何一种（或多种）方式进行送
--

达，同意采用电子方式送达，上述所有送达地址均真实、有效、畅通并构成有效的诉讼法律文书送达地址。

34、对原合同第二十八章“资产管理合同的效力”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（一）资产管理合同签署的方式 资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函形式对本集合计划资产管理合同的有效修订和补充）可采用电子或纸质方式签订，中国证券投资基金业协会另有规定的从其规定。管理人、托管人作为资产管理合同签署方，已接受资产管理合同项下的全部条款。 如因资产投资者在销售机构平台	（一）资产管理合同签署的方式 资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函、网站公告征求意见等形式对本合同的有效修订和补充）可采用电子或纸质方式签订，中国证券投资基金业协会另有规定的从其规定。管理人、托管人作为资产管理合同签署方，已接受资产管理合同项下的全部条款。 本合同采用管理人自建 TA 电子签
签署的本合同与资产托管人和资产管理人纸质签署的本合同内容不一致引发的任何责任和损失，由资产管理人承担；资产托管人因此被资产投资者投诉、起诉及/或遭受损失的，资产管理人应予以充分协助，并承担所有责任及损失。 资产管理人应通过深圳通将投资者信息发送给资产托管人，资产管理人应确保发送给资产托管人的投资者信息与销售机构留存的投资者信息的一致性。	约模式，托管人不承担因投资者在销售机构平台签署的本合同与托管人和管理人纸质签署的本合同内容不一致引发的任何责任和损失，管理人有权向相应过失方追责；托管人因此被投资者投诉、起诉及/或遭受损失的，管理人应予以充分协助，承担所有责任及损失，并有权向相应过失方追责。 管理人应通过深证通（管理人深证通小站号为：S_SGZQ02）将投资者信息发送给托管人，管理人应确保发送给托管人的投资者信息与 TA 系统留存的投资者信息的一致性。

(四) 资产管理合同的组成 《说明书》、经管理人确认有效的投资者参与/退出本集合计划的申请材料或数据电文和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、管理人通过指定网站发布的公告等是资产管理合同的有效组成部分。 《说明书》如与资产管理合同有不一致的，以资产管理合同为准。	(四) 资产管理合同的组成 说明书、风险揭示书、经管理人确认有效的投资者参与/退出本集合计划的申请材料或数据电文和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、管理人通过指定网站发布的公告等是资产管理合同的有效组成部分。说明书如与资产管理合同有不一致的，以资产管理合同为准。
---	--

35、对原合同第三十章“其他事项”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
除资产管理合同另有定义之外，词语在资产管理合同中使用时具有与在《说明书》中使用时相同的含义。	除资产管理合同另有定义之外，词语在资产管理合同中使用时具有与在说明书、 风险揭示书 中使用时相同的含义。

二、变更方案的安排对本次变更事项

现将投资者如何参与本集合计划合同变更相关事宜说明如下：

自合同变更相关安排的公告发布之日起，请投资者至我司或自行打印或通过销售机构指定的销售渠道以电子或纸质签署等有效途径填写《申港证券睿泽1号集合资产管理计划合同变更征询的回函》（以下简称“回函”）并务必于2024年4月18日（含）前将回函意见通过邮寄、电子签章等方式告知管理人。同时，对于本次回函，做如下说明：

- 1、本次合同变更期间（即征询期间）为：自合同变更及设置临时开放期公告发布之日起到2024年4月18日（含）止，投资者回函必须在上述时间内完成。
- 2、若投资者回函意见为“同意”，即视为同意合同变更相关内容，若投资

者的回函意见与其退出申请不一致，则以退出申请为准。

3、若投资者回函意见为“不同意”，应在征询期间提出退出申请，对于提出退出申请的投资者，管理人将按照正常退出申请流程进行退出份额确认。

特别提示：

(1) 2024 年 4 月 18 日：投资者提出的退出申请可不受锁定期限制。

(2) 投资者回函意见为“不同意”但未申请退出其持有的全部本集合计划份额的，在此同意并授权销售机构代为提出退出其持有的全部本集合计划份额的申请，管理人将统一在指定的期限届满后（即 2024 年 4 月 18 日）做强制赎回处理。

4、若投资者未在征询期间回复意见且未在征询期间申请退出其持有的全部集合计划份额的，视为同意本次合同变更。

本次合同变更自管理人公告中指定的资产管理合同变更生效日起生效，对合同各方均具有法律效力。

感谢您的支持与配合！如有疑问，可咨询申港证券股份有限公司。

邮寄回函地址：

地址：上海浦东新区世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 19 楼

联系人：雷伯特

联系电话：021-20639470



申港证券睿泽 1 号集合资产管理计划

合同变更征询的回函

请投资者根据以上内容作出意见表示：同意合同变更之投资者，请于“同意”栏填写“同意”并签字或盖章；不同意合同变更之投资者，请于“不同意”栏填写“不同意”并签字或盖章。

申港证券睿泽1号集合资产管理计划合同变更征询的回函	
意见	投资者反馈
同意	
不同意	
投资者声明：若本人/机构回函意见为“不同意”但未申请退出持有的全部本集合计划份额的，本人/机构在此同意并授权销售机构代为提出退出本人/机构持有的全部本集合计划份额的申请，管理人有权统一在指定的期限届满后（即 2024 年 4 月18日）做强制赎回处理。 签字或盖章： 年 月 日	