

华林证券季季安鑫集合资产管理计划修改法律文件及临时开放公告

华林证券季季安鑫集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2022 年 10 月 26 日成立，根据《华林证券季季安鑫集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《管理合同》”）以及《华林证券季季安鑫集合资产管理计划说明书》（以下简称“《说明书》”）的有关约定，并经托管人同意，我司决定对《华林证券季季安鑫集合资产管理计划资产管理合同》及《华林证券季季安鑫集合资产管理计划说明书》相应合同条款进行变更，并将 2024 年 5 月 22 日、2024 年 5 月 29 日作为开放日开放赎回，开放期的有关事项如下：

一、华林证券季季安鑫集合资产管理计划本次开放日为 2024 年 5 月 22 日、2024 年 5 月 29 日开放期 2 天，投资者可在当日沪、深交易所规定的交易时间内办理退出业务。业务受理网点为华林证券各指定的营业网点。

二、本次临时开放期内，允许投资者退出

1、退出：投资者按照份额进行退出，退出时以申请日计划单位净值作为计价基准，按扣除退出费、业绩报酬后的实际金额支付。

退出金额=（T 日计划单位净值×有效退出份额－业绩报酬）*（1-退出费率）

上述计算结果均以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

当投资者某笔退出后导致其剩余持有份额对应的资产净值少于 30 万时，该部分份额将被强制退出。

本集合计划不设单个投资者退出次数限制。

本集合计划无参与、退出费用。

2、业绩报酬

《管理合同》中约定，集合计划存续期间，管理人不主动提取业绩报酬，本



集合计划仅在投资者退出日、本集合计划分红日和本集合计划终止日计提业绩报酬并于投资者退出日和本集合计划终止日后的5个工作日内支付业绩报酬。业绩报酬的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，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。

根据2024年2月披露的《关于华林证券季季安鑫集合资产管理计划调整业绩报酬计提基准的公告》，本次临时开放日内退出的资产份额适用的业绩报酬计提基准为3.6%。

在本集合计划的分红权益登记日、投资者退出日和本集合计划终止日，将根据投资者的期间年化收益率（R），对其超过当期业绩报酬计提基准的部分收取管理人业绩报酬。每一个投资者的期间年化收益率R的计算公式：

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

A为本次业绩报酬计提日的累计单位净值；

B为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；

C为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D为上一业绩报酬计提日（不含）与本次业绩报酬计提日（含）之间的天数；

年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬（H）计算方法
$R \leq 3.6\%$	0	$H=0$
$R > 3.6\%$	50%	$H = (R - 3.6\%) \times 50\% \times C \times F \times D / 365$

注：F为提取业绩报酬的份额。

同时，我公司与托管人协商一致，决定对《华林证券季季安鑫集合资产管理合同》及《华林证券季季安鑫集合资产管理计划说明书》相应合同条款进行变更。合同变更的主要条款详情请参见附件一《华林证券季季安鑫集合资产管理合同》修订对照表和附件二《华林证券季季安鑫集合资产管理计划说明书》修订对照表。委托人可以于本公告发出后的五个工作日内可通过书面签署附件三《征询意见函》反馈意见。如委托人不同意合同变更，应于本公告发出后的五个工作日内并在开放日中提交退出申请，委托人未在本公告规定时间内签署同意变更的《征询意见函》也未在指定开放期退出计划的委托人即视为同意合同变更。华林证券将按照《管理合同》及《说明书》的规定为其办理集合计划份额退出，

本计划不收取退出费用。

委托人未在上述期间申请退出本集合计划的，管理人不再另行通知。

委托人无需就本次变更与管理人、托管人另行签署变更后的《管理合同》及《说明书》或关于本次合同变更的补充协议。经华林证券公告的本次合同变更内容自动成为变更后合同的组成部分。

特此公告。

华林证券股份有限公司

2024年5月21日



附件一：《华林证券季季安鑫集合资产管理计划资产管理合同》修订对照表

变更前	变更后
<p>1) 原《资产管理合同》第二部分“释义”中“《指导意见》”、“《管理办法》”、“《运作规定》”、“《合同指引》”等法律法规，从其最新规定。</p> <p>2) 将原《资产管理合同》中“委托资产”全部更改为“受托资产”。</p>	
<p>四、当事人及权利义务</p>	
<p>(三) 投资者的义务</p> <p>11、如投资者资金来源为募集资金，投资者保证委托资产的来源及用途合法，承诺已经在募集资金环节履行客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存、大额交易和可疑交易报告等反洗钱职责，确认不存洗钱行为，管理人无需对投资者募集资金客户履行反洗钱职责。投资者不得将自有资金和募集资金混同操作；投资者在初始和持续募集资金过程中不得接受资管产品作为募集资金来源；如相关监管机构或自律组织要求管理人提供本计划向上穿透后的投资者信息资料标的，投资者应配合提供；投资者承诺投资本计划后不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本计划从事规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道业务等违法违规行为；</p>	<p>(三) 投资者的义务</p> <p>11、投资者承诺投资本计划后不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本计划从事规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道业务等违法违规行为；</p>
<p>五、集合资产管理计划的基本情况</p>	
<p>(五) 主要投资方向</p> <p>(1) 银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债券类资产，包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可</p>	<p>(五) 主要投资方向</p> <p>(1) 银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债券类资产，包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可</p>

<p>以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债、资产支持证券优先级（ABS），债券正回购、债券逆回购，债券借贷，国债期货等；</p> <p>（2）公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）（如货币基金、债券型基金、股票基金、混合基金、ETF基金、LOF基金、分级基金、权益类QDII基金等）。</p>	<p>以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债、资产支持证券优先级（ABS），债券正回购、债券逆回购，债券借贷，国债期货等；</p> <p>（2）资产管理产品：公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金），本集合计划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。</p>
<p>（六）投资比例</p> <p>（1）本计划投资于存款、债券等债权类资产（包括货币基金、债券型基金）的比例不低于资产管理计划总资产的80%。为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产80%，但不得持续6个月低于计划总资产80%。</p>	<p>（六）投资比例</p> <p>（1）本计划投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产的80%。为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产80%，但不得持续6个月低于计划总资产80%。</p>
<p>八、集合计划的参与、退出与转让</p>	
<p>（二）参与和退出的开放日和时间</p> <p>1、封闭期：本集合计划存续期内除开</p>	<p>（二）参与和退出的开放日和时间</p> <p>1、封闭期：本计划首个封闭期为产品</p>

放期外为封闭期，在每个封闭期内封闭运作，封闭期内原则上不办理集合计划的参与和退出业务（管理人公告临时开放的情况除外）。

开放期：本集合计划成立后，每个自然周的周三开放，每个开放日可办理份额申购业务以及锁定期满的份额赎回业务。若开放期遇法定节假日、非工作日，则当日不开放，且开放期不顺延。

委托人每笔资金自参与日（含）（初始募集期认购的为本计划成立日，存续期申购及红利再投资参与的为份额参与申请日）起需锁定 90 天，委托人可于锁定期满 90 天的自然周对日申请退出集合计划，若该日为非开放日，则委托人可于此后任一个开放日申请退出集合计划。退出申请的持有期限未满 90 天时，该笔退出申请无效，管理人将不予确认（投资者部分退出后的份额资产净值少于 30 万元，导致全部剩余份额强制退出；或由于投资者不同意合同变更，通过临时开放期一次性退出其持有的全部份额等存在强制退出的情况除外）。

管理人可以根据业务实际情况，设置临时开放期。管理人应提前至少 1 个工作日在管理人网站公告具体安排。

举例：若委托人于 2022 年 9 月 21 日（周三）参与集合计划，则锁定期满 90 天

成立之后的 90 日，本集合计划存续期内除开放期外为封闭期，在每个封闭期内封闭运作，封闭期内原则上不办理集合计划的参与和退出业务（管理人公告临时开放的情况除外）。

2、开放期：本集合计划成立完成首个封闭期后，每个自然周的周二为申购开放日，每个申购开放日可办理份额申购业务，遇节假日不开放，且不顺延；本计划首个赎回开放日为封闭期满后第一个交易日，之后 3、6、9、12 月的第三个自然周的周二至周四为赎回开放日，遇节假日，赎回开放日顺延，委托人可申请退出集合计划。

委托人每笔资金自参与日（含）（初始募集期认购的为本计划成立日，存续期申购及红利再投资参与的为份额参与申请日）起需锁定 90 天，委托人可于锁定期满 90 天后的赎回开放日申请退出集合计划。退出申请的持有期限未满 90 天时，该笔退出申请无效，管理人将不予确认（投资者部分退出后的份额资产净值少于 30 万元，导致全部剩余份额强制退出；或由于投资者不同意合同变更，通过临时开放期一次性退出其持有的全部份额等存在强制退出的情况除外）。

管理人可以根据业务实际情况，设置临时开放期。管理人应提前至少 1 个工作日在管理人网站公告具体安排。

<p>后的自然周对日为 2022 年 12 月 20 日（周二）。</p> <p>（1）若 2022 年 12 月 20 日为开放日，则委托人可申请退出集合计划；若委托人未申请退出，则委托人可于此后任一个开放日内申请退出。</p> <p>（2）若 2022 年 12 月 20 日为非开放日，则委托人可于此后最近一个开放日，即在 2022 年 12 月 21 日（周三）申请退出集合计划；若委托人未申请退出，则委托人可于此后任一个开放日内申请退出。</p> <p>（3）若 2022 年 12 月 20 日恰逢法定节假日、非工作日，则 2022 年 12 月 20 日不开放，且开放期不顺延。委托人可于此后任一个开放日内申请退出。</p>	
<p>（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>（3）参与原则</p> <p>1) 存续期参与“未知价”原则，即存续期参与的价格，以首日申请当日的集合计划每份额净值为基准进行计算；</p> <p>2) 采用金额参与的方式，即以参与金额申请；</p> <p>3) 当日的参与申请可以在销售机构规定的时间内撤销；</p> <p>4) 当集合计划募集规模接近或达到约定的规模上限时，管理人将自次日起暂停接受参与申请；</p> <p>5) 管理人有权拒绝投资者的参与申请。</p>	<p>（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>（3）参与原则</p> <p>1) 存续期参与“未知价”原则，即存续期参与的价格，以首日申请当日的集合计划每份额净值为基准进行计算；</p> <p>2) 采用金额参与的方式，即以参与金额申请；</p> <p>3) 当日的参与申请可以在销售机构规定的时间内撤销；</p> <p>4) 当集合计划募集规模接近或达到合同或管理人约定的规模上限时，管理人将自次日起暂停接受参与申请；</p> <p>5) 管理人有权按照产品投资策略拒绝</p>

	<p>投资者的参与申请。</p> <p>3、参与程序</p>
<p>(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>5、退出方式</p> <p>在提交退出申请时须持有足够的份额余额，否则所提交的参与、退出申请无效而不予确认。</p>	<p>(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>5、退出方式</p> <p>本集合计划委托人只能于本集合计划的赎回开放日办理退出申请。</p> <p>本计划首个封闭期为产品成立之后的90日，本计划首个赎回开放日为封闭期满后第一个交易日，之后3、6、9、12月的第三个自然周的周二至周四为赎回开放日，遇节假日，赎回开放日顺延，委托人可申请退出集合计划。具体的业务办理时间以管理人公告为准（含临时开放）。</p> <p>在提交退出申请时须持有足够的份额余额，否则所提交的退出申请无效而不予确认。</p>
<p>十一、集合计划的投资</p>	
<p>(二) 投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>(1) 银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债券类资产，包括在证券交易所、银行间市场等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性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央</p>	<p>(二) 投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>(1) 银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债券类资产，包括在证券交易所、银行间市场等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性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央</p>

<p>银行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债、资产支持证券优先级（ABS），债券正回购、债券逆回购，债券借贷，国债期货等；</p> <p>（2）公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）（如货币基金、债券型基金、股票基金、混合基金、ETF 基金、LOF 基金、分级基金、权益类 QDII 基金等）。</p> <p>特别提示：本计划投资范围包含债券回购，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。</p>	<p>银行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债、资产支持证券优先级（ABS），债券正回购、债券逆回购，债券借贷，国债期货等；</p> <p>（2）资产管理产品：公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金），本集合计划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。</p> <p>特别提示：本计划投资范围包含债券回购，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。</p>
<p>2、投资比例</p> <p>（1）本计划投资于存款、债券等债权类资产（包括货币基金、债券型基金）的比例不低于资产管理计划总资产的 80%。为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。</p>	<p>2、投资比例</p> <p>（1）本计划投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%。为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。</p>
<p>“（六）投资策略”增加如下条款：</p> <p>“（3）资管产品投资策略</p> <p>本计划管理人严格遵循为投资者提供稳健收益的原则，通过详细、谨慎的考察研究，投资于优秀资产管理机构设立的产品。管理人将对资产管理产品进行综合测评，筛选出投资业绩稳定、团队投研功底深厚、内部管理条理完善的资产管理机</p>	

构设立的资产管理产品。

(4) 公募基金投资策略

本计划管理人通过对基金管理公司综合素质评估、基金经理人评价、基金业绩稳定性评价、基金风险收益分析、基金评级、基金业绩归因分析、基金选时能力和择券能力评价等，同时结合其他基金评级机构的基金研究报告，对基金过往风险收益状况形成一些定量和定性的基本判断，再根据对未来市场行情、基金未来净值成长性的预期等，构建或整合基金组合。

上述投资策略为管理人主要运用的投资策略，本计划投资策略包括但不限于上述策略。投资经理可在本计划投资范围内，根据市场变动及自主判读采用其他投资策略。”

十四、利益冲突及关联交易

<p>(一) 集合计划存在的或可能存在利益冲突的情形：</p> <ol style="list-style-type: none">1、管理人可能将本计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易；2、管理人及其附属机构有权以自有资金参与本集合计划；3、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方均有权参与本集合计划；4、法律法规、中国证监会等监管机构规定的其他情形。 <p>(二) 集合计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容及披露频率</p> <p>管理人需建立健全内部审批机制和评估机制，并遵循投资者利益优先的原则，采取切实有效措施，防范利益冲突，</p>	<p>(一) 集合计划存在的或可能存在利益冲突的情形：</p> <ol style="list-style-type: none">1、管理人可能将本计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他关联交易；2、管理人及其附属机构有权以自有资金参与本集合计划；3、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方均有权参与本集合计划；4、法律法规、中国证监会等监管机构规定的其他情形。 <p>(二) 关联方及关联交易的定义、分类标准及管控机制</p> <ol style="list-style-type: none">1、关联方及关联交易的定义 <p>关联方包括管理人、管理人股东、管理人股东控制和参股的企业、控制管理人</p>
---	--

保护投资者合法权益；管理人应当事先取得投资者的同意，事后告知投资者和托管人。

投资人签署本合同即视为同意管理人可以将本计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过管理人网站进行披露。集合计划存续期间，管理人自有资金参与计划的持有期限不得少于6个月，参与、退出时，提前5个工作日通过管理人网站公告告知投资者和托管人。如管理人的董事、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，该部分投资者参与份额与集合计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险，管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过管理人网站进行披露。

管理人运用受托管理资产从事关联交易的，应事先取得投资者书面同意，并有充分证据证明未损害投资者利益，事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露。

股东的企业、子公司，托管行、托管行控股股东及实际控制人、托管行控制的企业等，管理人董事、监事、高级管理人员及其关系密切家庭成员控制、共同控制或施加重大影响的企业等。

关联交易指在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同的约定并严格遵守管理人内部关联交易管制等制度的前提下，本计划资产管理人运用委托财产投资资产管理人/资产托管人或资产管理人/资产托管人关联方发行或承销期内承销的证券、管理的证券投资基金、管理人关联方互为交易对手的交易以及发生资产管理人认定的其他类型的关联交易，但投资者或托管人各自就其自身或其关联方另有限制或书面通知管理人的除外。

管理人、托管人关联方名单以公开信息披露为准。

2、关联交易的分类

管理人在运用受托管理资产从事关联交易时，将按照法律法规及中国证监会的有关规定，对关联交易按照重要性原则区分为一般关联交易和重大关联交易并进行分层管理。

3、重大关联交易的管控机制

重大关联交易认定标准如下：

- (1) 将本计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害

关系的公司等发行的单证券的资金或与管理人关联方互为交易对手发生交易行为时，单证券交易金额达到本计划净值的 20%（含）以上且交易金额 300 万元（含）以上的；投资关联方承销期内承销的证券且单只证券预计中签金额达到本计划净值的 20%（含）以上且交易金额 300 万元（含）以上的；投资于关联方管理的证券投资基金且单只基金投资金额超过资产管理计划净值 20%（含）以上且交易金额 300 万元（含）以上属于重大关联交易。

（2）其他法律法规、监管准则、自律规则或按照实质重于形式原则认定的重大关联交易情形。

重大关联交易需先经管理人履行内部审批程序，由管理人设置的资产管理业务决策委员会审批，委员会设主任委员一名，主任委员由公司首席执行官担任。其他委员由分管资产管理业务公司领导、首席风控官、合规总监、资管部落负责人以及主任委员指定的其他人员组成。合规法律部、风险管理部等部门视需要指定人员列席会议。该委员会表决采取一人一票制，每位委员都享有相同的一票投票权，不得弃权，主任委员具有一票否决权，投赞成票超过委员人数三分之二（含）以上为有效通过。此外，重大关联交易还需履行如下程序后方可进行。

	<p>管理人拟运用本集合计划的资产从事重大关联交易的（包括单笔或多笔合计），应对关联交易事项应遵循审慎评估原则，并提前 5 个工作日采取逐笔征询或公告确认等方式事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。投资者如有异议的，应于征询函发送后 5 个工作日内书面回复，如投资者未提出书面异议的，管理人方可开展该次重大关联交易。同时管理人事后应对重大关联交易进行单独披露，并按相关规定报告或备案。</p> <p>管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过管理人指定网站进行披露。集合计划存续期间，管理人自有资金参与计划的持有期限不得少于 6 个月，参与、退出时，提前 5 个工作日通过管理人网站公告告知投资者和托管人。如管理人的董事、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，该部分投资者参与份额与集合计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险，管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过管理人网站进行披露。</p> <p>4、一般关联交易的管控机制</p> <p>投资者在此不可撤销地同意并授权管理人可以将本计划的资产从事以下一般关联交易：</p> <p>（1）将本计划的资产投资于管理人、</p>
--	--

托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等发行的单证券的资金或与管理人关联方互为交易对手发生交易行为时，单证券交易金额未达上述重大关联交易认定标准；投资于关联方企业承销期内承销的证券且单只证券预计中签金额未达上述重大关联交易认定标准；投资于关联方管理的证券投资基金且单只基金投资金额未达上述重大关联交易认定标准的属于一般关联交易。

(2) 其他符合法律法规、监管准则和自律规则认定的一般关联交易。

一般关联交易经管理人相应内部审批程序审批通过后方可进行，管理人设置两级审批流程，资产管理计划需参与关联交易的，由投资经理书面说明关联交易交易的必要性，定价依据等，经部门负责人审批后，由合规法律、风险管理部审核后方可进行交易，审批人员亦需重点审核关联交易的必要性、交易价格公允性等，确保该关联交易符合本资产管理计划投资者的利益。

管理人在一般关联交易发生后，应及时告知投资者和托管人，事后单独以函件或定期报告的形式进行披露并按照最新监管要求履行报告义务。管理人应及时向托管人提供关联方名单，如因管理人未及时提供关联方名单导致托管人

	<p>监控不及时，托管人不承担责任。</p> <p>以上关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。</p> <p>资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人应当坚持投资者利益优先原则，从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，资产管理人应当视具体利益冲突情形选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中进行披露。</p> <p>（三）其他利益冲突的情形</p> <p>除前述规定外，管理人不得将本计划的委托资产，通过直接投资、投资其他资产管理计划或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。</p> <p>管理人禁止违规关联交易，遵循委托人利益优先原则对非禁止性关联交易进行专项审批和管控，防范利益冲突，保护委托人合法权益。法律法规、监管准则和自律规则对资管计划关联交易另有规定的，管理人按届时有效的规定执行。</p>
<p>十八、越权交易的界定</p>	
<p>（三）托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、资产托管人根据合同的约定，对本</p>	<p>（三）托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、资产托管人根据合同的约定，对本</p>

<p>计划的投资范围进行监督。对投资范围的监督如下：</p> <p>(1) 银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债券类资产，包括在证券交易所、银行间市场等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性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债、资产支持证券优先级（ABS），债券正回购、债券逆回购，债券借贷，国债期货等；</p> <p>(2) 公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）（如货币基金、债券型基金、股票基金、混合基金、ETF 基金、LOF 基金、分级基金、权益类 QDII 基金等）。</p>	<p>计划的投资范围进行监督。对投资范围的监督如下：</p> <p>(1) 银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债券类资产，包括在证券交易所、银行间市场等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性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债、资产支持证券优先级（ABS），债券正回购、债券逆回购，债券借贷，国债期货等；</p> <p>(2) 资产管理产品：公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金），本集合计划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。</p>
<p>2、资产托管人对本计划的受托资产投资比例限制进行监督，如下：</p> <p>投资比例：</p> <p>(1) 本计划投资于存款、债券等债权类资产（包括货币基金、债券型基金）</p>	<p>2、资产托管人对本计划的受托资产投资比例限制进行监督，如下：</p> <p>投资比例：</p> <p>(1) 本计划投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于资产管理计划总</p>

<p>的比例不低于资产管理计划总资产的 80%。为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。</p>	<p>资产的 80%。为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。</p>
---	--

十九、集合计划财产的估值与会计核算

<p>(三) 估值方法</p> <p>2、投资证券投资基金的估值方法</p> <p>(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;</p> <p>(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计划份额净值估值;估值日前一交易日计划份额净值无公布的,按此前最近交易日的计划份额净值估值;</p> <p>(3)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;</p> <p>(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;没有公布份额净值的,按照成本估值。</p>	<p>(三) 估值方法</p> <p>2、投资资产管理产品及证券投资基金的估值方法</p> <p>(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;</p> <p>(2)持有的场外基金及资产管理产品(包括托管在场外的上市开放式基金 (LOF)),按场外投资标的管理人提供的最新份额净值估值;估值日计划份额净值无公布的,按此前最近交易日的计划份额净值估值;</p> <p>(3)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;</p> <p>(4)持有的基金及资产管理产品处于封闭期的,封闭期内如无重大变化的,按照</p>
--	--

最新公布的单位净值估值;无单位净值的,参考近期投资价格进行估值。

(5)如遇所投资资产管理产品或者基金不公布产品份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情況, 管理人根据以下原则进行估值:

①以所投资资管产品或基金的份额净值估值的, 若所投资资管产品或者基金与本产品估值频率一致但未公布估值日份额净值, 按其最近公布的份额净值为基础估值

②以所投资基金的收盘价估值的, 若估值日无交易, 且最近交易日后市场环境未发生重大变化, 按最近交易日的收盘价估值; 如最近交易日后市场环境发生了重大变化的, 可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价, 确定公允价值。

③如果所投资资管产品或基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分, 根据份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

④管理人认为按上述第①至第③条进行估值存在不公允时, 应与托管人协商一致采用合理的估值技术或估值标准确定其公允价值。

二十、集合计划的费用与税收

1) “1、管理费及业绩报酬”中第(1)条中的“管理费的年费率”: 由 0.8%变更

为 0.4%。

(2) 业绩报酬

a、收取业绩报酬的原则

集合计划存续期间，管理人不主动提取业绩报酬，本集合计划仅在投资者退出日、本集合计划分红日和本集合计划终止日计提业绩报酬并于投资者退出日和本集合计划终止日后的 5 个工作日内支付业绩报酬。业绩报酬的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，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。

b、业绩报酬的计提方法

本计划每期资产的业绩报酬计提基准为 4.5%。原则上，集合计划存续期间，如管理人修改业绩报酬计提基准，需于每一个运作周期开始前 5 个工作日公告变更后的业绩报酬计提基准。如果投资人不认可变更后的业绩报酬计提基准，可以选择在最近的开放日申请退出。

管理人特别声明：此业绩报酬计提标准不是预期收益和保证收益率。投资者已知悉，资产管理合同所提及的业绩报酬计提标准仅是管理人计提业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人对委托财产收益状况的任何承诺或担保，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。

(2) 业绩报酬

1) 收取业绩报酬的原则

a、集合计划存续期间，管理人不主动提取业绩报酬，本集合计划仅在投资者退出日、本集合计划分红日和本集合计划终止清算时计提业绩报酬并于投资者退出日和本集合计划终止日后的 5 个工作日内支付业绩报酬。

b、同一投资者不同时间多次参与的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬。

c、投资者申请退出时，管理人按照“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算与提取退出份额对应的业绩报酬。

d、集合计划分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不得超过分红资金。在投资者退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或者清算资金中扣除。

e、如管理人已经提取业绩报酬，即使投资者退出本集合计划时净值有所下跌，则该部分已提取业绩报酬亦不退还投资者。

f、业绩报酬的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，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

在本集合计划的分红权益登记日、投资者退出日和本集合计划终止日，将根据投资者的期间年化收益率（R），对其超过当期业绩报酬计提基准的部分收取管理人业绩报酬。每一个投资者的期间年化收益率 R 的计算公式：

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

A 为本次业绩报酬计提日的累计单位净值；

B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；

C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为上一业绩报酬计提日（不含）与本次业绩报酬计提日（含）之间的天数；

年化收益率(R)	计提比例	业绩报酬(H)计算方法
R ≤ 4.5%	0	H=0
R > 4.5%	50%	H = (R - 4.5%) × 50% × C × F × D / 365

注：F 为提取业绩报酬的份额。

c、业绩报酬支付

由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据划款指令支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

管理费及业绩报酬收入账户信息：

户 名：华林证券股份有限公司

账 号：41005200040004682

开户银行：中国农业银行股份有限公司

制。

2) 业绩报酬的计提方法

业绩报酬计提基准以管理人公告为准。原则上，集合计划存续期间，如管理人调整业绩报酬计提基准，需于每一个运作周期开始前 5 个工作日公告变更后的业绩报酬计提基准。管理人公告应明确变更后的业绩报酬计提基准生效日，原则上，应满足公告披露满 5 个工作日且于因变更指定的开放期结束后生效。如果投资人不认可变更后的业绩报酬计提基准，可以选择在最近的开放日（含临时开放日）申请退出。在下一业绩报酬计提基准调整之前，本集合计划存续份额均以该业绩报酬计提基准对投资收益超过业绩报酬计提基准的部分计提业绩报酬。业绩报酬计提基准仅作为管理人计提业绩报酬的依据，不作为管理人对此业绩的承诺。

管理人特别声明：此业绩报酬计提标准不是预期收益和保证收益率。投资者已知悉，资产管理合同所提及的业绩报酬计提标准仅是管理人计提业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人对委托财产收益状况的任何承诺或担保，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。

在本集合计划的分红权益登记日、投资者退出日和本集合计划终止日，将根据

深圳中航城支行

大额支付行号：103584000523

投资者的期间年化收益率 (R)，对其超过当期业绩报酬计提基准的部分收取管理人业绩报酬。每一个投资者的期间年化收益率 R 的计算公式：

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

A 为本次业绩报酬计提日的累计单位净值；

B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；

C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为上一业绩报酬计提日（不含）与本次业绩报酬计提日（含）之间的天数；

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法
$R \leq$ 业绩报酬计提基准%	0	$H=0$
$R >$ 业绩报酬计提基准%	50%	$H = (R - \text{业绩报酬计提基准}\%) \times 50\% \times C \times F \times D / 365$

注：F 为提取业绩报酬的份额。

c、业绩报酬支付

由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据划款指令支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

管理费及业绩报酬收入账户信息：

户 名：华林证券股份有限公司

账 号：41005200040004682

	<p>开户银行：中国农业银行股份有限公司 深圳中航城支行 大额支付行号：103584000523</p>
<p>(三) 其他费用的计提原则和计算方法</p> <p>2、其他费用</p> <p>(1) 银行结算费用、银行账户维护费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>(2) 银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>(3) 开户费、银行间交易相关维护费用、转托管费用、注册登记相关费用(包括但不限于服务月费、登记结算费、年度电子合同服务费等)等集合计划运营过程中发生的相关费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>(4) 在本集合计划存续期间发生的、与集合计划相关的审计费(按与会计师事务所签定协议所规定的金额)、律师费(按与律师事务所签定协议所规定的金额，签订协议前需向投资者披露)、信息披露费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，在相应的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。</p> <p>(5) 在本集合计划清算过程中因处置未变现集合计划资产而产生的全部费用(包括但不限于诉讼费、仲裁费、律师费(按与律师事务所签定协议所规定</p>	<p>(三) 其他费用的计提原则和计算方法</p> <p>2、其他费用</p> <p>(1) 银行结算费用、银行账户维护费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>(2) 银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间进行预提。</p> <p>(3) 开户费、银行间交易相关维护费用、转托管费用、注册登记相关费用(包括但不限于服务月费、登记结算费、年度电子合同服务费等)等集合计划运营过程中发生的相关费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>(4) 在本集合计划存续期间发生的、与集合计划相关的审计费(按与会计师事务所签定协议所规定的金额)、律师费(按与律师事务所签定协议所规定的金额，签订协议前需向投资者披露)、信息披露费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，在相应的会计期间进行预提。</p> <p>(5) 在本集合计划清算过程中因处置未变现集合计划资产而产生的全部费用(包括但不限于诉讼费、仲裁费、律师费(按与律师事务所签定协议所规定的金额，签订协议前需向投资者披露)、</p>

<p>的金额，签订协议前需向投资者披露)、公证费、拍卖费及其他形式的资产处置费等费用)，在发生时可计入本集合计划费用。</p> <p>(6) 其他费用由管理人本着保护投资者利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。本合同项下的管理费、业绩报酬、托管费及其他管理人或托管人收取的各类费用均为包含增值税的含税价。</p>	<p>公证费、拍卖费及其他形式的资产处置费等费用)，在发生时可计入本集合计划费用。</p> <p>(6) 其他费用由管理人本着保护投资者利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。本合同项下的管理费、业绩报酬、托管费及其他管理人或托管人收取的各类费用均为包含增值税的含税价。</p>
--	--

二十二、集合计划的信息披露与报告

<p>(二) 集合计划份额净值</p> <p>披露时间：本集合计划成立后的每个交易日披露集合计划份额净值、累计净值。</p>	<p>(二) 集合计划份额净值</p> <p>披露时间：本集合计划成立后的每个申购开放日、赎回开放日披露集合计划份额净值、累计净值。</p>
--	--

二十三、风险揭示

“本集合计划面临包括但不限于以下风险：” 增加对投资资产管理产品风险的披露，具体如下：

“(十三) 投资资产管理产品的风险

本集合计划部分资产将配置于公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金），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。本集合计划主要投资于公募中长期纯债基金，短债基金，同业存单指数基金，公募 REITs；投资以绝对收益为目标的量化对冲，宏观对冲，中性策略的公、私募基金等产品。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

本集合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，从而造成集合计划净值下降，最终导致集合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) 集合计划所投资的资产管理产品因流动性问题导致赎回资金延迟到账风险
因本集合计划投资者退出或资产配置调整需要，管理人赎回所投资的资产管理产品时，可能面临资产管理产品不在开放期，也可能面临资产管理产品触发大额赎回或巨额赎回条款，从而导致赎回资金延迟到账的风险。

(5) 投资资产管理产品可能面临双层收费的风险

本集合计划投资者需要承担双层费用，即集合计划费用及集合计划所投资的资产管理产品自身需要承担费用。集合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）、认购费或参与费（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，从而造成集合计划净值下降。

(6) 投资的多个资产管理产品估值时间不一致导致集合计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况的风险

本集合计划投资多个资产管理产品，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。在存续期间，集合计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。

(7) 底层资产管理产品提取业绩报酬对集合计划净值造成下跌的风险。”

附件二：《华林证券季季安鑫集合资产管理计划说明书》修订对照表

变更前	变更后
开放期	
<p>本集合计划成立后，每个自然周的周三开放，每个开放日可办理份额申购业务以及锁定期满的份额赎回业务。若开放期遇法定节假日、非工作日，则当日不开放，且开放期不顺延。</p> <p>委托人每笔资金自参与日（含）（初始募集期认购的为本计划成立日，存续期申购及红利再投资参与的为份额参与申请日）起需锁定 90 天，委托人可于锁定期满 90 天的自然周对日申请退出集合计划，若该日为非开放日，则委托人可于此后任一个开放日申请退出集合计划。退出申请的持有期限未满 90 天时，该笔退出申请无效，管理人将不予确认（投资者部分退出后的份额资产净值少于 30 万元，导致全部剩余份额强制退出；或由于投资者不同意合同变更，通过临时开放期一次性退出其持有的全部份额等存在强制退出的情况除外）。</p> <p>管理人可以根据业务实际情况，设置临时开放期。管理人应提前至少 1 个工作日在管理人网站公告具体安排。</p>	<p>本计划成立完成首个封闭期后，每个自然周的周二为申购开放日，每个申购开放日可办理份额申购业务，遇节假日不开放，且不顺延；本计划首个赎回开放日为封闭期满后第一个交易日，之后 3、6、9、12 月的第三个自然周的周二至周四为赎回开放日，遇节假日，赎回开放日顺延，委托人可申请退出集合计划。</p> <p>委托人每笔资金自参与日（含）（初始募集期认购的为本计划成立日，存续期申购及红利再投资参与的为份额参与申请日）起需锁定 90 天，委托人可于锁定期满 90 天后的赎回开放日申请退出集合计划。退出申请的持有期限未满 90 天时，该笔退出申请无效，管理人将不予确认（投资者部分退出后的份额资产净值少于 30 万元，导致全部剩余份额强制退出；或由于投资者不同意合同变更，通过临时开放期一次性退出其持有的全部份额等存在强制退出的情况除外）。</p> <p style="text-align: center;">管理人可以根据业务实际情况，设置临时开放期。管理人应提前至少 1 个工作日在管理人网站公告具体安排。</p>
主要投资方向	
(1) 银行存款、同业存单，以及符合	(1) 银行存款、同业存单，以及符合

<p>《指导意见》规定的标准化债券类资产，包括在证券交易所、银行间市场等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性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债、资产支持证券优先级（ABS），债券正回购、债券逆回购，债券借贷，国债期货等；</p> <p>（2）公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）（如货币基金、债券型基金、股票基金、混合基金、ETF基金、LOF基金、分级基金、权益类QDII基金等）。</p>	<p>《指导意见》规定的标准化债券类资产，包括在证券交易所、银行间市场等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性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债、资产支持证券优先级（ABS），债券正回购、债券逆回购，债券借贷，国债期货等；</p> <p>（2）资产管理产品：公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金），本集合计划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。</p>
<p>投资范围</p>	
<p>（1）银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债券类资产，包括在证券交易所、银行间市场等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性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、</p>	<p>（1）银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债券类资产，包括在证券交易所、银行间市场等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性机制的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、可转换债券、</p>

<p>分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债、资产支持证券优先级（ABS），债券正回购、债券逆回购，债券借贷，国债期货等；</p> <p>（2）公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）（如货币基金、债券型基金、股票基金、混合基金、ETF 基金、LOF 基金、分级基金、权益类 QDII 基金等）。</p> <p>特别提示：本计划投资范围包含债券回购，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。</p>	<p>分离交易可转债、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开发行公司债、资产支持证券优先级（ABS），债券正回购、债券逆回购，债券借贷，国债期货等；</p> <p>（2）资产管理产品：公开募集证券投资基金、受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的其他资产管理产品（含私募证券投资基金），本集合计划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。</p> <p>特别提示：本计划投资范围包含债券回购，为提升组合收益提供了可能，但也存在一定风险。</p>
<p>投资比例</p>	
<p>（1）本计划投资于存款、债券等债权类资产（包括货币基金、债券型基金）的比例不低于资产管理计划总资产的 80%。为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。</p>	<p>（1）本计划投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%。为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。</p>
<p>投资策略</p>	
<p>“投资策略”增加如下条款：</p> <p>（3）资管产品投资策略</p>	

本计划管理人严格遵循为投资者提供稳健收益的原则，通过详细、谨慎的考察研究，投资于优秀资产管理机构设立的产品。管理人将对资产管理产品进行综合测评，筛选出投资业绩稳定、团队投研功底深厚、内部管理条理完善的资产管理机构设立的资产管理产品。

(4) 公募基金投资策略

本计划管理人通过对基金管理公司综合素质评估、基金经理人评价、基金业绩稳定性评价、基金风险收益分析、基金评级、基金业绩归因分析、基金选时能力和择券能力评价等，同时结合其他基金评级机构的基金研究报告，对基金过往风险收益状况形成一些定量和定性的基本判断，再根据对未来市场行情、基金未来净值成长性的预期等，构建或整合基金组合。

上述投资策略为管理人主要运用的投资策略，本计划投资策略包括但不限于上述策略。投资经理可在本计划投资范围内，根据市场变动及自主判读采用其他投资策略。

管理费

管理费的年费率由 **0.8%** 变更为 **0.4%**。

业绩报酬

a、收取业绩报酬的原则

集合计划存续期间，管理人不主动提取业绩报酬，本集合计划仅在投资者退出日、本集合计划分红日和本集合计划终止日计提业绩报酬并于投资者退出日和本集合计划终止日后的5个工作日内支付业绩报酬。业绩报酬的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，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。

b、业绩报酬的计提方法

本计划每期资产的业绩报酬计提基准为【4.5%】。原则上，集合计划存续期

1) 收取业绩报酬的原则

a、集合计划存续期间，管理人不主动提取业绩报酬，本集合计划仅在投资者退出日、本集合计划分红日和本集合计划终止清算时计提业绩报酬并于投资者退出日和本集合计划终止日后的5个工作日内支付业绩报酬。

b、同一投资者不同时间多次参与的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬。

c、投资者申请退出时，管理人按照“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算与提取退出份额对应

间，如管理人修改业绩报酬计提基准，需于每一个运作周期开始前5个工作日公告变更后的业绩报酬计提基准。如果投资人不认可变更后的业绩报酬计提基准，可以选择在最近的开放日申请退出。

管理人特别声明：此业绩报酬计提标准不是预期收益和保证收益率。投资者已知悉，资产管理合同所提及的业绩报酬计提标准仅是管理人计提业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人对委托财产收益状况的任何承诺或担保，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。

在本集合计划的分红权益登记日、投资者退出日和本集合计划终止日，将根据投资者的期间年化收益率（R），对其超过当期业绩报酬计提基准的部分收取管理人业绩报酬。每一个投资者的期间年化收益率 R 的计算公式：

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

A 为本次业绩报酬计提日的累计单位净值；

B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；

C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为上一业绩报酬计提日（不含）与本次业绩报酬计提日（含）之间的天数；

的业绩报酬。

d、集合计划分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不得超过分红资金。在投资者退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或者清算资金中扣除。

e、如管理人已经提取业绩报酬，即使投资者退出本集合计划时净值有所下跌，则该部分已提取业绩报酬亦不退还投资者。

f、业绩报酬的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，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) 业绩报酬的计提方法

业绩报酬计提基准以管理人公告为准。原则上，集合计划存续期间，如管理人调整业绩报酬计提基准，需于每一个运作周期开始前5个工作日公告变更后的业绩报酬计提基准。管理人公告应明确变更后的业绩报酬计提基准生效日，原则上，应满足公告披露满5个工作日且于因变更指定的开放期结束后生效。如果投资人不认可变更后的业绩报酬计提基准，可以选择在最近的开放日（含临时开放日）申请退出。在下次业绩报酬计提基准调整之前，本集合计划存续份额均以该业绩报酬计提基准对投资收益超过业绩报酬计提基准的

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法
R ≤ 4.5%	0	H=0
R > 4.5%	50%	H = (R - 4.5%) × 50% × C × F × D / 365

部分计提业绩报酬。业绩报酬计提基准仅作为管理人计提业绩报酬的依据，不作为管理人对此业绩的承诺。

管理人特别声明：此业绩报酬计提标准不是预期收益和保证收益率。投资者已知悉，资产管理合同所提及的业绩报酬计提标准仅是管理人计提业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人对委托财产收益状况的任何承诺或担保，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。

在本集合计划的分红权益登记日、投资者退出日和本集合计划终止日，将根据投资者的期间年化收益率 (R)，对其超过当期业绩报酬计提基准的部分收取管理人业绩报酬。每一个投资者的期间年化收益率 R 的计算公式：

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

A 为本次业绩报酬计提日的累计单位净值；

B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；

C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为上一业绩报酬计提日 (不含) 与本次业绩报酬计提日 (含) 之间的天数；

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法
R ≤ 业绩报	0	H=0

	酬计提基准%		
	R>业绩报酬计提基准%	50%	H= (R-业绩报酬计提基准%) × 50% × C × F × D / 365

注：F 为提取业绩报酬的份额。

其他费用

<p>2、其他费用</p> <p>(1) 银行结算费用、银行账户维护费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>(2) 银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>(3) 开户费、银行间交易相关维护费用、转托管费用、注册登记相关费用(包括但不限于服务月费、登记结算费、年度电子合同服务费等)等集合计划运营过程中发生的相关费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>(4) 在本集合计划存续期间发生的、与集合计划相关的审计费(按与会计师事务所签定协议所规定的金额)、律师费(按与律师事务所签定协议所规定的金额，签订协议前需向投资者披露)、信息披露费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，在相应的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。</p> <p>(5) 在本集合计划清算过程中因处置未变现集合计划资产而产生的全部费用(包括但不限于诉讼费、仲裁费、律</p>	<p>2、其他费用</p> <p>(1) 银行结算费用、银行账户维护费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>(2) 银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间进行预提。</p> <p>(3) 开户费、银行间交易相关维护费用、转托管费用、注册登记相关费用(包括但不限于服务月费、登记结算费、年度电子合同服务费等)等集合计划运营过程中发生的相关费用，在发生时一次性计入本集合计划费用。</p> <p>(4) 在本集合计划存续期间发生的、与集合计划相关的审计费(按与会计师事务所签定协议所规定的金额)、律师费(按与律师事务所签定协议所规定的金额，签订协议前需向投资者披露)、信息披露费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，在相应的会计期间进行预提。</p> <p>(5) 在本集合计划清算过程中因处置未变现集合计划资产而产生的全部费用(包括但不限于诉讼费、仲裁费、律</p>
--	--

<p>师费（按与律师事务所签定协议所规定的金额，签订协议前需向投资者披露）、公证费、拍卖费及其他形式的资产处置费等费用），在发生时可计入本集合计划费用。</p> <p>（6）其他费用由管理人本着保护投资者利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。本合同项下的管理费、业绩报酬、托管费及其他管理人或托管人收取的各类费用均为包含增值税的含税价。</p>	<p>的金额，签订协议前需向投资者披露）、公证费、拍卖费及其他形式的资产处置费等费用），在发生时可计入本集合计划费用。</p> <p>（6）其他费用由管理人本着保护投资者利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。本合同项下的管理费、业绩报酬、托管费及其他管理人或托管人收取的各类费用均为包含增值税的含税价。</p>
<p>投资者的义务</p>	
<p>11、如投资者资金来源为募集资金，投资者保证委托资产的来源及用途合法，承诺已经在募集资金环节履行客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存、大额交易和可疑交易报告等反洗钱职责，确认不存洗钱行为，管理人无需对投资者募集资金客户履行反洗钱职责。投资者不得将自有资金和募集资金混同操作；投资者在初始和持续募集资金过程中不得接受资管产品作为募集资金来源；如相关监管机构或自律组织要求管理人提供本计划向上穿透后的投资者信息资料标的，投资者应配合提供；投资者承诺投资本计划后不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本计划从事规避投资范围、杠杆约束等监</p>	<p>11、投资者承诺投资本计划后不存在违反监管要求的产品嵌套，以及以投资本计划从事规避投资范围、杠杆约束等监管要求的通道业务等违法违规行为；</p>

管要求的通道业务等违法违规行为；	
信息披露的内容、方式、频率	
<p>(二) 集合计划份额净值</p> <p>披露时间：本集合计划成立后的每个交易日披露集合计划份额净值、累计净值。</p>	<p>(二) 集合计划份额净值</p> <p>披露时间：本集合计划成立后的每个申购开放日、赎回开放日披露集合计划份额净值、累计净值。</p>
集合计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容及披露频率	
<p>管理人需建立健全内部审批机制和评估机制，并遵循投资者利益优先的原则，采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益；管理人应当事先取得投资者的同意，事后告知投资者和托管人。</p> <p>投资人签署本合同即视为同意管理人可以将本计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过管理人网站进行披露。集合计划存续期间，管理人自有资金参与计划的持有期限不得少于 6 个月，参与、退出时，提前 5 个工作日通过管理人网站公告告知投资者和托管人。如管理人的董事、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，该部分投资者参与份额与集合计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险，管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过管理人</p>	<p>(一) 关联方及关联交易的定义、分类标准及管控机制</p> <p>1、关联方及关联交易的定义</p> <p>关联方包括管理人、管理人股东、管理人股东控制和参股的企业、控制管理人股东的企业、子公司，托管行、托管行控股股东及实际控制人、托管行控制的企业等，管理人董事、监事、高级管理人员及其关系密切家庭成员控制、共同控制或施加重大影响的企业等。</p> <p>关联交易指在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同的约定并严格遵守管理人内部关联交易管制等制度的前提下，本计划资产管理人运用委托财产投资资产管理人/资产托管人或资产管理人/资产托管人关联方发行或承销期内承销的证券、管理的证券投资基金、管理人关联方互为交易对手的交易以及发生资产管理人认定的其他类型的关联交易，但投资者或托管人各自就其自身或其关联方另有限制或书面通知管理人的除外。</p> <p>管理人、托管人关联方名单以公开信息</p>

网站进行披露。

披露为准。

2、关联交易的分类

管理人在运用受托管理资产从事关联交易时，将按照法律法规及中国证监会的有关规定，对关联交易按照重要性原则区分为一般关联交易和重大关联交易并进行分层管理。

3、重大关联交易的管控机制

重大关联交易认定标准如下：

(1) 将本计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等发行的单证券的资金或与管理人关联方互为交易对手发生交易行为时，单证券交易金额达到本计划净值的 20%（含）以上且交易金额 300 万元（含）以上的；投资关联方承销期内承销的证券且单只证券预计中签金额达到本计划净值的 20%（含）以上且交易金额 300 万元（含）以上的；投资于关联方管理的证券投资基金且单只基金投资金额超过资产管理计划净值 20%（含）以上且交易金额 300 万元（含）以上属于重大关联交易。

(2) 其他法律法规、监管准则、自律规则或按照实质重于形式原则认定的重大关联交易情形。

重大关联交易需先经管理人履行内部审批程序，由管理人设置的资产管理业务决策委员会审批，委员会设主任委员

一名，主任委员由公司首席执行官担任。其他委员由分管资产管理业务公司领导、首席风控官、合规总监、资管部落负责人以及主任委员指定的其他人员组成。合规法律部、风险管理部等部门视需要指定人员列席会议。该委员会表决采取一人一票制，每位委员都享有相同的一票投票权，不得弃权，主任委员具有一票否决权，投赞成票超过委员人数三分之二（含）以上为有效通过。此外，重大关联交易还需履行如下程序后方可进行。

管理人拟运用本集合计划的资产从事重大关联交易的（包括单笔或多笔合计），应对关联交易事项应遵循审慎评估原则，并提前 5 个工作日采取逐笔征询或公告确认等方式事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。投资者如有异议的，应于征询函发送后 5 个工作日内书面回复，如投资者未提出书面异议的，管理人方可开展该次重大关联交易。同时管理人事后应对重大关联交易进行单独披露，并按相关规定报告或备案。

管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过管理人指定网站进行披露。集合计划存续期间，管理人自有资金参与计划的持有期限不得少于 6 个月，参与、退出时，提前 5 个工作日通过管理人网站公告告知投资者和托管人。如管

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，该部分投资者参与份额与集合计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险，管理人应在该事项发生之日起五个工作日内通过管理人网站进行披露。

4、一般关联交易的管控机制

投资者在此不可撤销地同意并授权管理人可以将本计划的资产从事以下一般关联交易：

（1）将本计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等发行的单证券的资金或与管理人关联方互为交易对手发生交易行为时，单证券交易金额未达上述重大关联交易认定标准；投资于关联方企业承销期内承销的证券且单只证券预计中签金额未达上述重大关联交易认定标准；投资于关联方管理的证券投资基金且单只基金投资金额未达上述重大关联交易认定标准的属于一般关联交易。

（2）其他符合法律法规、监管准则和自律规则认定的一般关联交易。

一般关联交易经管理人相应内部审批程序审批通过后方可进行，管理人设置两级审批流程，资产管理计划需参与关联交易的，由投资经理书面说明关联交

易交易的必要性，定价依据等，经部门负责人审批后，由合规法律、风险管理部审核后方可进行交易，审批人员亦需重点审核关联交易的必要性、交易价格公允性等，确保该关联交易符合本资产管理计划投资者的利益。

管理人在一般关联交易发生后，应及时告知投资者和托管人，事后单独以函件或定期报告的形式进行披露并按照最新监管要求履行报告义务。管理人应及时向托管人提供关联方名单，如因管理人未及时提供关联方名单导致托管人监控不及时，托管人不承担责任。

以上关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人应当坚持投资者利益优先原则，从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，资产管理人应当视具体利益冲突情形选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露。

（二）其他利益冲突的情形

除前述规定外，管理人不得将本计划的受托资产，通过直接投资、投资其他资产管理计划或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构、托管人及

	<p>前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。</p> <p>管理人禁止违规关联交易，遵循委托人利益优先原则对非禁止性关联交易进行专项审批和管控，防范利益冲突，保护委托人合法权益。法律法规、监管准则和自律规则对资管计划关联交易另有规定的，管理人按届时有效的规定执行。</p>
--	--

附件三

征询意见函

本委托人同意/不同意华林证券股份有限公司于2024年5月 日发布的《华林证券季季安鑫集合资产管理计划修改法律文件及临时开放公告》中关于《华林证券季季安鑫集合资产管理计划资产管理合同》和《华林证券季季安鑫集合资产管理计划说明书》的变更事项。

特此回复。

委托人：

日期：



