

# 关于第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划 合同变更的公告

尊敬的投资者：

由我司作为管理人，兴业银行股份有限公司作为托管人的第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2022 年 7 月 19 日成立。管理人拟对《第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划资产管理合同》、《第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划说明书》及《第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划风险揭示书》进行变更。详细内容见本公告附件。

为保证投资者的利益，本计划变更事宜已经获得托管人的书面同意确认。投资者不同意本次合同变更的应在 2024 年 7 月 18 日提出退出申请。未提出退出申请的，视同投资者已经同意本次合同变更。截止 2024 年 7 月 18 日，若同意本次合同变更的投资者数量不少于 2 人（含 2 人），则我司约定 2024 年 7 月 19 日为本次合同变更的生效日；若同意本次合同变更的客户数量少于 2 人，则本计划将终止。

特此公告。

附件 1：第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划资产管理合同变更对照表

附件 2：第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划说明书变更对照表

附件 3：第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划风险揭示书变更对照表

第一创业证券股份有限公司

二〇二四年七月十七日

附件 1：第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划资产管理合同变更对照表

序号	位置	原合同	变更后合同
1	合同全文	原合同中“委托人”表述	统一修改为“投资者”
2	“五、资产管理计划的基本情况” “（四）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例”	1、投资目标 在有效控制投资风险的前提下，争取本计划财产的保值增值，为委托人谋求稳定的投资回报。 2、主要投资方向 本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的固定收益类资产、现金类资产、期	1、投资目标 在有效控制投资风险的前提下，争取本计划财产的保值增值，为投资者谋求稳定的投资回报。 2、主要投资方向 本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的固定收益类资产、现金类资

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种。</p> <p>3、投资比例</p> <p>本计划财产投向固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例不低于资产总值的 80%；任一交易日日终【（国债期货空头合约价值－国债期货多头合约价值－固定收益类证券市值）/集合资产管理计划资产净值】≤20%，固定收益类证券市值计算不包括同业存单、可转债、可交债，期货和衍生品类资产的持仓合约价值（按衍生品的多头合约价值与空头合约价值之和计算）为资产总值的 0%（含）-80%（不含）；参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p>	<p>产及中国证监会认可的其他投资品种。</p> <p>3、投资比例</p> <p>（1）本计划财产投向固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例不低于资产总值的 80%；</p> <p>（2）参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p>
3	<p>“八、资产管理计划的参与、退出与转让”</p> <p>“（一）资产管理计划的参与、退出”</p> <p>“6、参与和退出的费用”</p>	<p>（1）参与费用</p> <p>本计划无参与费，即参与费率为 0。</p> <p>（2）退出费用</p> <p>.....</p> <p>投资者申请退出本计划时发生的退出费列入集合计划资产，本计划终止时发生的退出费归管理人所有。</p>	<p>（1）参与费用</p> <p>本计划无参与费，即参与费率为 0。</p> <p>（2）退出费用</p> <p>.....</p> <p>投资者申请退出本计划时发生的退出费列入集合计划资产，本计划终止时（含提前终止）不收取退出费。</p>
4	<p>“十一、资产管理计划的投</p>	<p>1、投资范围</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规</p>	<p>1、投资范围</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
	<p>资” “(二) 资产管理 计划的投 资范围及 投资比 例”</p>	<p>则允许证券公司集合资产管理计划投资的固定收益类资产、现金类资产、期货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>(1) 现金类资产：现金、各类银行存款（不含结构性存款）、货币市场基金等；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国债、地方政府债、政府支持机构债、企业债券、公司债券（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债券（含可分离交易的可转债，不可转股）、可交换债（含可交换私募债，不可换股）、资产支持证券（不含劣后级）、债券型公募基金，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，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持票据（ABN，不含劣后级）、非公开定向债务融资工具（PPN）等，债券逆回购；</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产：国债期货。</p> <p>(4) 本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例不低于资产总值的80%；</p>	<p>则允许证券公司集合资产管理计划投资的固定收益类资产、现金类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>(1) 现金类资产：现金、各类银行存款（不含结构性存款）、货币市场基金等；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国债、地方政府债、政府支持机构债、企业债券、公司债券（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债券（含可分离交易的可转债，不可转股）、可交换债（含可交换私募债，不可换股）、资产支持证券（不含劣后级）、债券型公募基金，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，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持票据（ABN，不含劣后级）、非公开定向债务融资工具（PPN）等，债券逆回购；</p> <p>(3) 本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例不低于资产总值的80%；</p> <p>(2) 参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>(2)任一交易日日终【(国债期货空头合约价值—国债期货多头合约价值—固定收益类证券市值)/集合资产管理计划资产净值】≤20%，固定收益类证券市值计算不包括同业存单、可转债、可交债，期货和衍生品类资产的持仓合约价值（按衍生品的多头合约价值与空头合约价值之和计算）为资产总值的0%（含）-80%（不含）；</p> <p>(3)参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的100%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>本计划投资于公开募集证券投资基金的，计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资公开募集证券投资基金的总资产，且按照穿透原则合并计算投资同类资产的金额需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资公开募集证券投资基金披露投资组合的频率，更新计算计划所投资资产的金额或比例。</p>	<p>计划上一日资产净值的100%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>本计划投资于公开募集证券投资基金的，计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资公开募集证券投资基金的总资产，且按照穿透原则合并计算投资同类资产的金额需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资公开募集证券投资基金披露投资组合的频率，更新计算计划所投资资产的金额或比例。</p>
5	<p>“十一、资产管理计划的投资”</p> <p>“（六）资产管理计划的投资策略”</p> <p>“3、管理人投资</p>	<p>.....</p> <p>（4）国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合久期、流动性和风险水平。管理人将结合对宏观经济形势和政策趋势判断，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动</p>	<p>.....</p> <p>（4）现金及准现金类资产投资策略</p> <p>现金及准现金类资产包含货币市场基金、银行存款、现金、到期日在1年内（含1年）的国债、到期日在1年内（含1年）的央行票据、到</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
	管理的方 法和标 准”	<p>水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。在最大限度维护本计划资产安全的基础上，力求实现本计划资产的增值。</p> <p>(5) 现金及准现金类资产投资策略</p> <p>现金及准现金类资产包含货币市场基金、银行存款、现金、到期日在1年内(含1年)的国债、到期日在1年内(含1年)的央行票据、到期日在1年内(含1年)的政府债券、不超过7天(含7天)的债券逆回购等。</p> <p>本集合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、债券逆回购的预期收益率来确定现金类资产的配置，并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。</p> <p>(6) 债券型公募基金投资策略</p> <p>在债券型公募基金的选择上，出于稳健性考虑，从控制信用风险角度，持仓上选择主要配置利率债、高等级国企信用债、高等级平台债、同业存单的债券型基金，同时，将考虑各类资产的性价比，择机在久期结构、资产配置方向上，灵活选择进行配置或交易。</p> <p>以上内容为管理人对于本计划全</p>	<p>期日在1年内(含1年)的政府债券、不超过7天(含7天)的债券逆回购等。</p> <p>本集合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、债券逆回购的预期收益率来确定现金类资产的配置，并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。</p> <p>(5) 债券型公募基金投资策略</p> <p>在债券型公募基金的选择上，出于稳健性考虑，从控制信用风险角度，持仓上选择主要配置利率债、高等级国企信用债、高等级平台债、同业存单的债券型基金，同时，将考虑各类资产的性价比，择机在久期结构、资产配置方向上，灵活选择进行配置或交易。</p> <p>以上内容为管理人对于本计划全部或部分投资品种相应投资策略的阐述，不构成对于本计划投资范围、投资比例及限制的补充，也不构成管理人的承诺。</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		部或部分投资品种相应投资策略的阐述，不构成对于本计划投资范围、投资比例及限制的补充，也不构成管理人的承诺。	
6	“十七、投资指令的发送、确认和执行”	<p>(一) 交易清算授权</p> <p>1、管理人应指定专人向托管人发送指令。</p> <p>2、管理人应向托管人提供书面授权文件（已出具统一授权书的除外），该文件应加盖公章。文件内容包括被授权人名单、预留印鉴及被授权人签字样本，授权文件应注明被授权人相应的权限及有效时限。</p> <p>3、授权文件即在授权文件载明的时点生效。</p> <p>4、管理人和托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄漏；但法律法规规定或有权机关要求的除外。</p> <p>.....</p>	<p>(一) 投资指令的授权</p> <p>1、管理人应指定专人向托管人发送指令。</p> <p>2、管理人应向托管人提供书面授权文件（已出具统一授权书的除外），该文件应加盖公章。文件内容包括被授权人名单、预留印鉴及被授权人签字样本，授权文件应注明被授权人相应的权限及有效时限。</p> <p>3、授权文件即在授权文件载明的时点生效。</p> <p>4、管理人和托管人对授权文件负有保密义务，其内容不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄漏；但法律法规规定或有权机关要求的除外。</p> <p>.....</p>
7	“十八、交易及交收清算安排”	<p>一、选择证券、期货经纪机构的程序</p> <p>(一) 资产管理人担任本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构。</p> <p>(二) 资产管理人应及时将本资产管理计划财产证券交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时</p>	<p>(一) 选择证券、期货经纪机构的程序</p> <p>1、资产管理人担任本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构。</p> <p>2、资产管理人应及时将本资产管理计划财产证券交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知资产托管人。</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>以书面形式通知资产托管人。</p> <p>（三）资产管理人与资产托管人配合完成交易单元的合并清算事宜，资产管理人在交易前应确认相关合并清算事宜已办结。若资产管理人在合并清算办结前交易，则相关的交收责任由资产托管人承担。</p> <p>二、投资证券后的清算交收安排</p> <p>（一）关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：</p> <p>1. 资产托管人、资产管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本款规定的内容。资产管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定，并遵守资产托管人为履行特别结算参与人的义务所制定的业务规则 with 规定。</p> <p>2. 资产托管人代理资产管理计划与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由资产托管人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于资产管理人原因造成资产托管人无法正常完成结算业务，资产托管人发现后应立即通知资产管理人，由资产托管人负</p>	<p>3、资产管理人与资产托管人配合完成交易单元的合并清算事宜，资产管理人在交易前应确认相关合并清算事宜已办结。若资产管理人在合并清算办结前交易，则相关的交收责任由资产托管人承担。</p> <p>（二）投资证券后的清算交收安排</p> <p>1、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：</p> <p>（1）资产托管人、资产管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本款规定的内容。资产管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定，并遵守资产托管人为履行特别结算参与人的义务所制定的业务规则 with 规定。</p> <p>（2）资产托管人代理资产管理计划与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由资产托管人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于资产管理人原因造成资产托管人无法正常完成结算业务，资产托管人发现后应立即通知资产管理人，由资</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>责解决，由此造成资产托管人无法按时向中国证券登记公司支付证券清算款的责任以及由此给资产托管人所托管的其他财产造成的损失由资产管理人承担。</p> <p>3. 资产管理人签署本合同/协议，即视为同意资产管理人在构成资金交收违约且未能按时指定相关证券作为交收履约担保物时，资产托管人可自行向结算公司申请由结算公司协助冻结资产管理人证券账户内相应证券，无需资产管理人另行出具书面确认文件。</p> <p>4. 资产托管人遵照中登公司上海分公司和中登公司深圳分公司备付金、保证金管理办法有关规定，确定和调整该委托财产最低结算备付金、证券结算保证金限额，资产管理人应存放于中登公司的最低备付金、结算保证金日末余额不得低于资产托管人根据中登公司上海和深圳分公司备付金、保证金管理办法规定的限额。资产托管人根据中登公司上海和深圳分公司规定向委托财产支付利息。</p> <p>5. 根据中登公司托管行集中清算规则，如委托财产 T 日进行了中登公司深圳分公司 T+1DVP 卖出交易，资产管理人不能将该笔资金作为 T+1 日的可用头寸，即该笔资金在 T+1 日不可</p>	<p>产管理人负责解决，由此造成资产托管人无法按时向中国证券登记公司支付证券清算款的责任以及由此给资产托管人所托管的其他财产造成的损失由资产管理人承担。</p> <p>(3) 资产管理人签署本合同/协议，即视为同意资产管理人在构成资金交收违约且未能按时指定相关证券作为交收履约担保物时，资产托管人可自行向结算公司申请由结算公司协助冻结资产管理人证券账户内相应证券，无需资产管理人另行出具书面确认文件。</p> <p>(4) 资产托管人遵照中登公司上海分公司和中登公司深圳分公司备付金、保证金管理办法有关规定，确定和调整该委托财产最低结算备付金、证券结算保证金限额，资产管理人应存放于中登公司的最低备付金、结算保证金日末余额不得低于资产托管人根据中登公司上海和深圳分公司备付金、保证金管理办法规定的限额。资产托管人根据中登公司上海和深圳分公司规定向委托财产支付利息。</p> <p>(5) 根据中登公司托管行集中清算规则，如委托财产 T 日进行了中登公司深圳分公司 T+1DVP 卖出交易，资产管理人不能将该笔资金作为</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>用也不可提，该笔资金在 T+2 日才能划拨至托管账户。</p> <p>6. 根据中国证券登记结算有限责任公司的规定，结算备付金账户内的最低备付金、交易保证金账户内的资金按月调整按季结息，因此，资产管理合同终止时，资产管理计划可能有尚存放于结算公司的最低备付金、交易保证金以及结算公司尚未支付的利息等款项。对上述款项，资产托管人将于结算公司支付该等款项时扣除相应银行汇划费用后划付至本计划托管账户。资产管理合同终止后，中登根据结算规则，调增计划的结算备付以及交易保证金，资产管理人应配合资产托管人，向资产托管人及时划付调增款项，以便资产托管人履行交收职责。</p> <p>(二) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+0 非担保结算要求的证券交易：</p> <p>1. 对于在沪深交易所交易的采用 T+0 非担保交收的交易品种(如中小企业私募债、股票质押式回购、债券质押式协议回购、资产支持证券等，根据中登公司业务规则适时调整)，资产管理人需在交易当日不晚于 14:00 向资产托管人发送交易应付资金投资指令，同时将相关交易证明文件传真至资产托管人，并与资产托管人进行电话确</p>	<p>T+1 日的可用头寸，即该笔资金在 T+1 日不可用也不可提，该笔资金在 T+2 日才能划拨至托管账户。</p> <p>(6) 根据中国证券登记结算有限责任公司的规定，结算备付金账户内的最低备付金、交易保证金账户内的资金按月调整按季结息，因此，资产管理合同终止时，资产管理计划可能有尚存放于结算公司的最低备付金、交易保证金以及结算公司尚未支付的利息等款项。对上述款项，资产托管人将于结算公司支付该等款项时扣除相应银行汇划费用后划付至本计划托管账户。资产管理合同终止后，中登根据结算规则，调增计划的结算备付以及交易保证金，资产管理人应配合资产托管人，向资产托管人及时划付调增款项，以便资产托管人履行交收职责。</p> <p>2、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+0 非担保结算要求的证券交易：</p> <p>(1) 对于在沪深交易所交易的采用 T+0 非担保交收的交易品种(如中小企业私募债、股票质押式回购、债券质押式协议回购、资产支持证券等，根据中登公司业务规则适时调整)，资产管理人需在交易当日不晚于 14:00 向资产托管人发送交易应</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>认，以保证当日交易资金交收的顺利进行，中登业务规则允许采用 RTGS 交收的，在计划非担保交收账户可用资金充足的情况下，托管人将进行勾单处理。对于资产管理人在 14:00 后出具的投资指令，特别是需要资产托管人进行“勾单”确认的交易，资产托管人本着勤勉尽责的原则积极处理，但不保证支付/勾单成功。</p> <p>2. 资产管理人一旦出现交易后无法履约的情况，应在第一时间通知资产托管人。对于中国结算公司允许资产托管人指定不履约的交易品种，资产管理人应向资产托管人出具书面的取消交收指令，另，鉴于中登公司对取消交收（指定不履约）申报时间有限，资产托管人有权在电话通知资产管理人后，先行完成取消交收操作，资产管理人承诺日终前补出具书面的取消交收指令。</p> <p>3. 若资产管理人未及时出具交易应付资金投资指令，或资产管理人在托管产品资金托管账户头寸不足的情况下交易，资产托管人有权在中登公司取消交收截止时点前半个小时内主动对该笔交易进行取消交收申报，所有损失由资产管理人承担。</p> <p>4. 对于根据结算规则不能取消交收的交易品种，如出现前述第 2、3 项</p>	<p>付资金投资指令，同时将相关交易证明文件传真至资产托管人，并与资产托管人进行电话确认，以保证当日交易资金交收的顺利进行，中登业务规则允许采用 RTGS 交收的，在计划非担保交收账户可用资金充足的情况下，托管人将进行勾单处理。对于资产管理人在 14:00 后出具的投资指令，特别是需要资产托管人进行“勾单”确认的交易，资产托管人本着勤勉尽责的原则积极处理，但不保证支付/勾单成功。</p> <p>(2) 资产管理人一旦出现交易后无法履约的情况，应在第一时间通知资产托管人。对于中国结算公司允许资产托管人指定不履约的交易品种，资产管理人应向资产托管人出具书面的取消交收指令，另，鉴于中登公司对取消交收（指定不履约）申报时间有限，资产托管人有权在电话通知资产管理人后，先行完成取消交收操作，资产管理人承诺日终前补出具书面的取消交收指令。</p> <p>(3) 若资产管理人未及时出具交易应付资金投资指令，或资产管理人在托管产品资金托管账户头寸不足的情况下交易，资产托管人有权在中登公司取消交收截止时点前半个小时内主动对该笔交易进行取消交收</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>所述情形的，资产管理人知悉并同意资产托管人有权(但并非确保)仅根据中国结算公司的清算交收数据，主动将托管产品资金托管账户中的资金划入中国结算公司用以完成当日 T+0 非担保交收交易品种的交收，资产管理人承诺在日终前向资产托管人补出具资金投资指令。</p> <p>5. 发生以下因资产管理人原因所造成的情形，资产管理人应承担相应责任：</p> <p>(1) 资产管理人所托管的产品资金不足导致其自身产品交收失败，由资产管理人承担交易失败的风险，资产托管人无义务为该产品垫付交收款项；</p> <p>(2) 因资产管理人未在合同约定的时间前向资产托管人提交有效投资指令，导致资产托管人无法及时完成支付结算操作而使其自身产品交收失败的，由资产管理人自行承担交易失败的风险；</p> <p>(3) 因资产管理人所托管的产品资金不足，且占用托管行最低备付金交收成功，造成托管行损失，则应承担赔偿责任，且资产托管人保留根据上海银行间市场同业拆借利率向资产管理人追索利息的权利；</p> <p>(4) 因资产管理人所托管的产品</p>	<p>申报，所有损失由资产管理人承担。</p> <p>(4) 对于根据结算规则不能取消交收的交易品种，如出现前述第2、3项所述情形的，资产管理人知悉并同意资产托管人有权(但并非确保)仅根据中国结算公司的清算交收数据，主动将托管产品资金托管账户中的资金划入中国结算公司用以完成当日 T+0 非担保交收交易品种的交收，资产管理人承诺在日终前向资产托管人补出具资金投资指令。</p> <p>(5) 发生以下因资产管理人原因所造成的情形，资产管理人应承担相应责任：</p> <p>A. 资产管理人所托管的产品资金不足导致其自身产品交收失败，由资产管理人承担交易失败的风险，资产托管人无义务为该产品垫付交收款项；</p> <p>B. 因资产管理人未在合同约定的时间前向资产托管人提交有效投资指令，导致资产托管人无法及时完成支付结算操作而使其自身产品交收失败的，由资产管理人自行承担交易失败的风险；</p> <p>C. 因资产管理人所托管的产品资金不足，且占用托管行最低备付金交收成功，造成托管行损失，则应承担赔偿责任，且资产托管人保留根据</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>资金不足或资产管理人未在规定时间内向资产托管人提交投资指令，且有证据证明其直接造成资产托管人托管的其他产品交收失败和损失的，资产管理人应负赔偿责任。</p> <p>6. 资产管理人已充分了解托管行结算模式下可能存在的交收风险。如因资产托管人的过错进而导致资产管理人管理的产品交收失败的，则资产托管人应承担赔偿责任。</p> <p>7. 对于托管产品采用 T+0 非担保交收下实时结算(RTGS)方式完成实时交收的收款业务，管理人可根据需要在交易交收后，深圳 T+0 不晚于交收当日 14: 00、上海 T+0 不晚于交收当日 15: 00 向托管人发送交易应收资金收款指令，同时将相关交易证明文件传真至托管人，并与托管人进行电话确认，以便托管人将交收金额提回至托管产品资金托管账户。</p> <p>(三) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+N 非担保结算要求的证券交易</p> <p>资产管理人知悉并同意资产托管人仅根据中国结算公司的清算交收数据主动完成托管产品资金清算交收。若资产管理人出现交易后无法履约的情况，并且中国结算公司的业务规则允许资产托管人对相关交易可以取消</p>	<p>上海银行间市场同业拆借利率向资产管理人追索利息的权利；</p> <p>D. 因资产管理人所托管的产品资金不足或资产管理人未在规定时间内向资产托管人提交投资指令，且有证据证明其直接造成资产托管人托管的其他产品交收失败和损失的，资产管理人应负赔偿责任。</p> <p>(6) 资产管理人已充分了解托管行结算模式下可能存在的交收风险。如因资产托管人的过错进而导致资产管理人管理的产品交收失败的，则资产托管人应承担赔偿责任。</p> <p>(7) 对于托管产品采用 T+0 非担保交收下实时结算 (RTGS) 方式完成实时交收的收款业务，管理人可根据需要在交易交收后，深圳 T+0 不晚于交收当日 14: 00、上海 T+0 不晚于交收当日 15: 00 向托管人发送交易应收资金收款指令，同时将相关交易证明文件传真至托管人，并与托管人进行电话确认，以便托管人将交收金额提回至托管产品资金托管账户。</p> <p>3、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+N 非担保结算要求的证券交易</p> <p>资产管理人知悉并同意资产托管人仅根据中国结算公司的清算交收数据主动完成托管产品资金清算</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>交办的，资产管理人应于交收日前一工作日向资产托管人出具书面的取消交收指令，并与资产托管人进行电话确认。</p> <p>三、开放式基金投资的清算交收安排</p> <p>(一) 开放式基金申购(认购)相应的资金划拨由托管人依据管理人的投资指令逐笔划付。管理人申购(认购)开放式基金时，应将投资指令连同基金申购(认购)申请单一并传真至托管人。托管人审核无误后，应及时将投资指令交付执行。管理人应实时调整当日可用资金余额。管理人在收到基金申购(认购)确认回单后，应立即传真至托管人。</p> <p>(二) 管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时将赎回申请书传真至托管人；管理人在收到赎回确认回单后，应及时传真至托管人。</p> <p>(三) 为确保本计划财产会计核算及估值的及时处理，管理人应于开放式基金交易(包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红等)的确认日及时获取确认单等单据的传真件，要求并督促基金管理公司于当日传真给管理人，管理人收到后应立即传真至托管人。</p>	<p>交收。若资产管理人出现交易后无法履约的情况，并且中国结算公司的业务规则允许资产托管人对相关交易可以取消交收的，资产管理人应于交收日前一工作日向资产托管人出具书面的取消交收指令，并与资产托管人进行电话确认。</p> <p>(三) 开放式基金投资的清算交收安排</p> <p>1、开放式基金申购(认购)相应的资金划拨由托管人依据管理人的投资指令逐笔划付。管理人申购(认购)开放式基金时，应将投资指令连同基金申购(认购)申请单一并传真至托管人。托管人审核无误后，应及时将投资指令交付执行。管理人应实时调整当日可用资金余额。管理人在收到基金申购(认购)确认回单后，应立即传真至托管人。</p> <p>2、管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时将赎回申请书传真至托管人；管理人在收到赎回确认回单后，应及时传真至托管人。</p> <p>3、为确保本计划财产会计核算及估值的及时处理，管理人应于开放式基金交易(包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红等)</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>四、银行间交易资金结算安排</p> <p>(一) 管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并负责解决因交易对手不履行合同或不及时履行合同而造成的纠纷及损失。</p> <p>(二) 管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单加盖印章后及时传真给托管人,并电话确认(签订了免成交单协议的除外)。如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交易需要取消或终止,管理人应书面通知托管人。</p> <p>(三) 银行间交易结算方式采用券款对付的,托管账户与本计划在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨,除了登记结算机构系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管账户之外,应当由管理人出具资金投资指令,托管人审核无误后执行。由于管理人未及时出具指令导致本计划在托管账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足导致的损失,由过错方承担责任。</p> <p>五、投资银行存款的特别约定</p> <p>(一) 本计划投资银行存款前,应与存款银行签署投资银行定期存款协议。</p>	<p>的确认日及时获取确认单等单据的传真件,要求并督促基金管理公司于当日传真给管理人,管理人收到后应立即传真至托管人。</p> <p>(四) 银行间交易资金结算安排</p> <p>1、管理人负责对交易对手的资信控制,按银行间债券市场的交易规则进行交易,并负责解决因交易对手不履行合同或不及时履行合同而造成的纠纷及损失。</p> <p>2、管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单加盖印章后及时传真给托管人,并电话确认(签订了免成交单协议的除外)。如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交易需要取消或终止,管理人应书面通知托管人。</p> <p>3、银行间交易结算方式采用券款对付的,托管账户与本计划在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨,除了登记结算机构系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管账户之外,应当由管理人出具资金投资指令,托管人审核无误后执行。由于管理人未及时出具指令导致本计划在托管账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足导致的损失,由过错方承担责任。</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>(二)本计划投资银行存款,必须采用管理人和托管人认可的方式办理。</p> <p>(三)管理人投资银行存款或办理存款支取时,应提前书面通知托管人,以便托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。</p> <p>六、期货投资的清算交收安排</p> <p>本计划相关期货投资的具体操作按照管理人、托管人及期货经纪机构签署的《期货投资操作备忘录》(以实际名称为准)的约定执行。</p> <p>七、其他场外交易资金结算</p> <p>(一)管理人负责场外交易的实施,托管人负责根据管理人投资指令和相关投资文件进行场外交易资金的划付。管理人应将投资指令连同相关交易文件一并传真至托管人,托管人根据本合同第十七部分约定审核后及时执行投资指令。</p> <p>(二)相关交易文件中约定的其他转让或划款条件由管理人负责审核,托管人审核投资指令和交易文件对应要素(如有)的一致性。管理人同时应以书面形式通知托管人相关收款账户名、账号、交易费率等。投资或收益分配资金必须回流到本计划托管账户内,不得划入其他账户。</p> <p>八、资金、证券账目及交易记录的</p>	<p>(五)投资银行存款的特别约定</p> <p>1、本计划投资银行存款前,应与存款银行签署投资银行定期存款协议。</p> <p>2、本计划投资银行存款,必须采用管理人和托管人认可的方式办理。</p> <p>3、管理人投资银行存款或办理存款支取时,应提前书面通知托管人,以便托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。</p> <p>(六)期货投资的清算交收安排</p> <p>本计划相关期货投资的具体操作按照管理人、托管人及期货经纪机构签署的《期货投资操作备忘录》(以实际名称为准)的约定执行。</p> <p>(七)其他场外交易资金结算</p> <p>1、管理人负责场外交易的实施,托管人负责根据管理人投资指令和相关投资文件进行场外交易资金的划付。管理人应将投资指令连同相关交易文件一并传真至托管人,托管人根据本合同第十七部分约定审核后及时执行投资指令。</p> <p>2、相关交易文件中约定的其他转让或划款条件由管理人负责审核,托管人审核投资指令和交易文件对应要素(如有)的一致性。管理人同时应以书面形式通知托管人相关收</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>核对</p> <p>管理人和托管人应于每个估值日交易结束后对账。</p> <p>对计划财产的资金账目，以管理人与托管人约定方式核对，确保相关各方账账相符。</p> <p>对计划财产的证券账目，由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。</p> <p>对计划财产的交易记录，管理人与托管人核对估值结果之前，应保证所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致，如果实际交易记录与会计账簿记录不一致，造成会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由管理人承担。</p>	<p>款账户名、账号、交易费率等。投资或收益分配资金必须回流到本计划托管账户内，不得划入其他账户。</p> <p>(八) 资金、证券账目及交易记录的核对</p> <p>管理人和托管人应于每个估值日交易结束后对账。</p> <p>对计划财产的资金账目，以管理人与托管人约定方式核对，确保相关各方账账相符。</p> <p>对计划财产的证券账目，由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。</p> <p>对计划财产的交易记录，管理人与托管人核对估值结果之前，应保证所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致，如果实际交易记录与会计账簿记录不一致，造成会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由过错方承担。</p>
8	<p>“十九、越权交易的界定”</p> <p>“(二) 越权交易的处理程序”</p>	<p>1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为</p> <p>托管人对于越权交易，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行并立即要求管理人改正；未能改正或者造成本计划财产损失的，托管人有权及时通知管理人并报告管理人住所地中国证监会派出机构，具体以监</p>	<p>1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为</p> <p>托管人对于越权交易，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行并立即要求管理人改正；未能改正或者造成本计划财产损失的，托管人有权及时通知管理人并报告中国证监会派出机构，具体以监管机构的要</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>管机构的要求为准。</p> <p>根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人应当立即通知管理人，管理人在收到通知后应当及时核对或纠正。</p> <p>管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，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，托管人有权报告管理人住所地中国证监会派出机构，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>……</p>	<p>求为准。</p> <p>根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人应当立即通知管理人，管理人在收到通知后应当及时核对或纠正。</p> <p>管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，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派出机构，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>……</p>
9	<p>“十九、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、对本合同约定的投资范围按照如下标准进行监督：</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的固定收益类资产、现金类资产、期货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种等标准化资产：</p> <p>(1) 现金类资产：现金、各类银行存款（不含结构性存款）、货币市场基金等；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国债、地方政府债、政府支持机构债、企业债券、公司债券（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债券</p>	<p>1、对本合同约定的投资范围按照如下标准进行监督：</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的固定收益类资产、现金类资产及中国证监会认可的其他投资品种等标准化资产：</p> <p>(1) 现金类资产：现金、各类银行存款（不含结构性存款）、货币市场基金等；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国债、地方政府债、政府支持机构债、企业债券、公司债券（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>(含可分离交易的可转债, 不可转股)、可交换债(含可交换私募债, 不可换股)、资产支持证券(不含劣后级)、债券型公募基金, 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, 包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持票据(ABN, 不含劣后级)、非公开定向债务融资工具(PPN)等, 债券逆回购;</p> <p>(3)期货和衍生品类资产: 国债期货。</p> <p>(4) 本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>2、对本计划以下投资比例和投资限制进行监督:</p> <p>投资比例:</p> <p>(1) 固定收益类资产(含现金类资产)的投资比例不低于资产总值的80%;</p> <p>(2)任一交易日日终【(国债期货空头合约价值-国债期货多头合约价值-固定收益类证券市值)/集合资产管理计划资产净值】≤20%, 固定收益类证券市值计算不包括同业存单、可转债、可交债, 期货和衍生品类资产的持仓合约价值(按衍生品的多头合约价值与空头合约价值之和计算)为资产总值的0%(含)-80%(不含);</p> <p>(3)参与证券正回购融入资金余</p>	<p>换债券(含可分离交易的可转债, 不可转股)、可交换债(含可交换私募债, 不可换股)、资产支持证券(不含劣后级)、债券型公募基金, 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, 包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持票据(ABN, 不含劣后级)、非公开定向债务融资工具(PPN)等, 债券逆回购;</p> <p>(3)本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>2、对本计划以下投资比例和投资限制进行监督:</p> <p>投资比例:</p> <p>(1) 固定收益类资产(含现金类资产)的投资比例不低于资产总值的80%;</p> <p>(2) 参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的100%, 中国证监会另有规定的除外。</p> <p>.....</p> <p>3、托管人仅根据管理人提供的名单对资产管理计划买卖关联方发行的或者承销期内承销的证券进行关联交易监督。管理人应于合同生效前提供本计划的关联方名单, 并在合同期限内根据变化及时更新本计划</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>……</p> <p>2、托管人对管理人运用本计划财产进行投资管理的监督和检查自本合同生效之日起开始。托管人在本合同约定范围内，对本计划的直接投资履行监督职能。</p> <p>3、托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息，托管人对上述数据信息的真实性、准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示。</p> <p>4、管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责的，由过错方承担相应的责任。</p> <p>5、如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的，各方除履行必要的合同变更流程外，还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。</p>	<p>的关联方名单。若管理人没有及时提供关联方信息，导致托管人无法及时对关联方证券等进行监督的，由过错方承担相应的责任。</p> <p>4、托管人对管理人运用本计划财产进行投资管理的监督和检查自本合同生效之日起开始。托管人在本合同约定范围内，对本计划的投资履行监督职能。</p> <p>5、托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息，托管人对上述数据信息的真实性、准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示。</p> <p>6、管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责的，由过错方承担相应的责任。</p> <p>7、如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的，各方除履行必要的合同变更流程外，还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。</p>
10	“二十、资产管理计划财产的估值和会计核算” “（一）	<p>……</p> <p>（3）金融衍生品的估值方法</p> <p>交易所交易的金融衍生品（具体为以下品种：国债期货）按估值日交易所公布的当日结算价估值；估值日没</p>	<p>……</p> <p>（3）银行定期存款或通知存款估值方法</p> <p>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</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
	<p>资产管理计划财产的估值”“3、估值方法”</p>	<p>有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的结算价估值；如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结算价及重大变化因素，调整确定公允价格。</p> <p>(4) 银行定期存款或通知存款估值方法</p> <p>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。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。</p> <p>(5) 如有新增事项或变更事项，按法律法规、监管规定有关最新规定估值。</p>	<p>利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。</p> <p>(4) 如有新增事项或变更事项，按法律法规、监管规定有关最新规定估值。</p>
11	<p>“二十一、资产管理计划的费用与税收”</p> <p>“(四) 管理人的业绩报酬(浮动管理费)”</p>	<p>1、管理人收取业绩报酬的原则：</p> <p>(1) 同一委托人不同时间多次参与本计划的，对委托人每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；</p> <p>(2) 在委托人退出日及计划终止日，对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬；</p> <p>(3) 在委托人退出日及本计划终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；</p> <p>(4) 委托人申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的</p>	<p>1、管理人收取业绩报酬的原则：</p> <p>(1) 同一投资者不同时间多次参与本计划的，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；</p> <p>(2) 在投资者退出日及计划终止日，对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬；</p> <p>(3) 在投资者退出日及本计划终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；</p> <p>(4) 投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。</p> <p>委托人知悉并同意，委托人为管理人自身管理的基金中基金（FOF）型资产管理计划的，其持有的份额不收取业绩报酬。</p> <p>.....</p>	<p>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、提取退出份额对应的业绩报酬。</p> <p>投资者知悉并同意，投资者为管理人自身管理的基金中基金（FOF）型资产管理计划或由管理人担任投资顾问的其他资产管理产品的，其持有的份额不收取业绩报酬。</p> <p>.....</p>
12	<p>“二十四、风险揭示”</p> <p>“（一）特殊风险揭示”</p> <p>“5、其他特殊风险”</p>	<p>.....</p> <p>（6）投资国债期货的风险</p> <p>1）信用风险，是指因交易对手无力履行合约义务而产生的风险。在国债期货合约中，即使敞口头寸没有市场风险，它仍有可能包含信用风险。信用风险包括交割前风险和交割风险。交割前风险即在合约到期前由于国债期货价格变动或者其他原因致使交易者蒙受较大亏损而无力履行合约义务风险；交割风险即在合约到期日交易方履行了合约，交易对手却未能履约的风险。</p> <p>2）市场风险，指国债期货产品价值对交易者产生不利影响的风险，即国债期货的交割发生逆向不利变动而带来价值损失的可能性。</p> <p>3）操作风险，指因计算机系统不完善，内控制度不够健全和人员操作失误等原因，业务处理不能圆满进行</p>	<p>.....</p> <p>删除第（6）点投资国债期货的风险</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>的风险，以及由于没有建立灾害等紧急情况下的事务处理机制而导致业务停止的风险。对于国债期货这类衍生工具来说，由于其支付和价值计算过程都十分复杂，因此操作风险所导致的损失可能会严重。</p> <p>4) 强制平仓风险或爆仓风险。国债期货实行当时无负债结算制度，当市场朝不利方向波动时需要追加保证金，特别是当出现极端不利行情时，基差也可能出现不利变动，此时需要的保证金数额很可能超出正常值，如果不能及时采取措施增加保证金，期货头寸将被强行平仓，而相应对冲策略也可能被迫终止，因此，本集合计划将面临由于市场波动导致追加保证金的风险，也面临着由于系统故障等原因不能及时追加保证金导致策略提前结束的风险，从而使得预期盈利不能兑现甚至导致不必要的净值损失。</p>	
13	<p>“二十四、风险揭示” “(二) 一般风险揭示”</p>	<p>.....</p> <p>8、投资金融衍生品的风险</p> <p>(1) 市场风险</p> <p>由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利情形时，标的证券微小的变动就可能使委托人权益遭受较大损失；场内期权实行当日无负债结算制度，对资金管理要求非常高。价格波动剧烈的时候可能面临追加保证金的问</p>	<p>.....</p> <p>8、税收风险</p> <p>本计划作为契约型产品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，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。</p> <p>9、本计划提前终止的风险</p> <p>本计划运作期间，当本计划投资</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>题，如果没有在规定时间内补足保证金，按规定将面临平仓的风险。</p> <p>(2) 信用风险</p> <p>对于衍生品交易而言，信用风险发生的概率极小，原因是在进行衍生产品交易时，交易所有一套独特的交易体系，如设立一系列的保证金制度，最低资金要求，逐日盯市结算措施及强行平仓制度等，使整个市场的信用风险下降。但这种由结算公司充当所有投资者的交易对手，并承担履约责任，一旦结算公司出现风险暴露，由于其风险过度集中，在重大风险事件发生时，或风险监控制度不完善时也会发生信用风险。</p> <p>(3) 杠杆风险</p> <p>金融衍生品投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本计划可能承受超出保证金甚至本计划财产本金的损失。</p> <p>9、税收风险</p> <p>本计划作为契约型产品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，委托人收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。</p> <p>10、本计划提前终止的风险</p> <p>本计划运作期间，当本计划委托人少于 2 人或者其他本计划约定的提</p>	<p>者少于 2 人或者其他本计划约定的提前终止情形出现时，导致集合计划提前终止的风险。管理人也有权根据产品的运作情况决定提前终止本计划。</p> <p>10、合同变更风险</p> <p>管理人就合同变更征求投资者意见期间，未明确提出异议的投资者、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的投资者均视为同意修改或变更合同和说明书。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果投资者因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。</p> <p>11、投资者可能无法参与的风险</p> <p>由于本计划可能设定规模上限，管理人将根据合同的约定对规模上限进行控制，因此投资者可能面临着因上述原因而无法参与本计划的风险。</p> <p>12、投资者部分退出的风险</p> <p>投资者部分退出本计划份额时，如其该笔退出受理后投资者持有的剩余集合计划份额的资产净值低于人民币 300,000 元，投资者面临剩余份额强制退出的风险。</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>前终止情形出现时，导致集合计划提前终止的风险。管理人也有权根据产品的运作情况决定提前终止本计划。</p> <p>11、合同变更风险</p> <p>管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的委托人均视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。</p> <p>12、委托人可能无法参与的风险</p> <p>由于本计划可能设定规模上限，管理人将根据合同的约定对规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本计划的风险。</p> <p>13、委托人部分退出的风险</p> <p>委托人部分退出本计划份额时，如其该笔退出受理后委托人持有的剩余集合计划份额的资产净值低于人民币 300,000 元，委托人面临剩余份额强制退出的风险。</p> <p>14、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险</p> <p>当本计划发生巨额赎回情形且管</p>	<p>13、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险</p> <p>当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，届时赎回净值可能发生变动，投资者退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异，将直接影响到投资者的投资收益。举例如下：</p> <p>假设本计划退出申请日单位净值为 A（净值精度调整前），投资者退出份额为 X，则退出申请日单位净值精度误差最高为±0.00005 元（即四舍五入小数点后第 5 位最大误差），由此计算的单位净值 A 调整精度后对投资者退出总金额的最大影响为±X*0.00005 元。</p> <p>14、退出费的计算存在影响投资者投资收益的风险</p> <p>本计划根据投资者持有期限设置了不同的业绩报酬计提基准以及退出费率，投资者务必在参与和退出本计划前自行前往管理人官网查询相应的退出费率及业绩报酬计提基准。投资者的参与和退出视为投资者以自己的行动表明已充分知悉退出时点对应的退出费率及业绩报酬计提基准。退出费关系到投资者退出金额的计算，从而影响投资者的投资收益。</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>理人决定采取净值精度应急调整机制,届时赎回净值可能发生变动,委托人退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异,将直接影响到委托人的投资收益。举例如下:</p> <p>假设本计划退出申请日单位净值为 A (净值精度调整前), 委托人退出份额为 X, 则退出申请日单位净值精度误差最高为 ±0.00005 元(即四舍五入小数点后第 5 位最大误差), 由此计算的单位净值 A 调整精度后对委托人退出总金额的最大影响为 ±X*0.00005 元。</p> <p>15、退出费的计算存在影响委托人投资收益的风险</p> <p>本计划根据委托人持有期限设置了不同的业绩报酬计提基准以及退出费率, 委托人务必在参与和退出本计划前自行前往管理人官网查询相应的退出费率及业绩报酬计提基准。委托人的参与和退出视为投资者以自己的行动表明已充分知悉退出时点对应的退出费率及业绩报酬计提基准。退出费关系到委托人退出金额的计算, 从而影响委托人的投资收益。</p> <p>退出费举例说明:</p> <p>假设委托人在本计划存续期首次参与本计划 2,000,000 元, 根据本合同约定, 该委托人适用的参与费率为</p>	<p>退出费举例说明:</p> <p>假设投资者在本计划存续期首次参与本计划 2,000,000 元, 根据本合同约定, 该投资者适用的参与费率为 0, 参与申请当日本计划单位净值为 1.0000 (<math>P_0^*</math>)、本计划单位累计净值为 1.0000 (<math>P_0</math>), 注册登记机关确认参与份额 2,000,000 份。假设该投资者在持有的第 30 天提出退出申请, 根据本计划的退出费率及业绩报酬计提基准安排, 业绩报酬计提比例为 30%, 且该投资者适用的退出费率为 0.8, 假设适用的业绩报酬计提基准为 4%; 假设退出申请当日本计划单位净值为 1.0100、本计划单位累计净值为 1.0100 (<math>P_1</math>)。</p> <p>则投资者退出费计算如下:</p> <p>年化收益率 (R) = (1.0100 - 1.0000) / 1.0000 × 365/30 × 100% = 12.17%</p> <p>超额收益 (Y) = 2,000,000 × (12.17% - 4%) × 30/365 = 13,430.14</p> <p>管理人业绩报酬 = 13,430.14 × 30% = 4,029.04</p> <p>剩余超额收益 = 13,430.14 - 4,029.04 = 9,401.10</p> <p>退出费 = 9,401.10 × 0.8 = 7520.88 (小于退出费收取上限)</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>0, 参与申请当日本计划单位净值为 1.0000 (<math>P_0^*</math>)、本计划单位累计净值为 1.0000 (<math>P_0</math>), 注册登记机构确认参与份额 2,000,000 份。假设该委托人在持有的第 30 天提出退出申请, 根据本计划的退出费率及业绩报酬计提基准安排, 业绩报酬计提比例为 30%, 且该委托人适用的退出费率为 0.8, 假设适用的业绩报酬计提基准为 4%; 假设退出申请当日本计划单位净值为 1.0100、本计划单位累计净值为 1.0100 (<math>P_1</math>)。</p> <p>则委托人退出费计算如下:</p> <p>年化收益率 (<math>R</math>) = (1.0100 - 1.0000) / 1.0000 × 365/30 × 100% = 12.17%</p> <p>超额收益 (<math>Y</math>) = 2,000,000 × (12.17% - 4%) × 30/365 = 13,430.14</p> <p>管理人业绩报酬 = 13,430.14 × 30% = 4,029.04</p> <p>剩余超额收益 = 13,430.14 - 4,029.04 = 9,401.10</p> <p>退出费 = 9,401.10 × 0.8 = 7520.88 (小于退出费收取上限)</p> <p>退出费的收取上限 = 1.0100 * 2,000,000 * 3% = 60600</p> <p>16、通过第三方销售平台投资开放式基金的风险</p>	<p>退出费的收取上限 = 1.0100 * 2,000,000 * 3% = 60600</p> <p>15、通过第三方销售平台投资开放式基金的风险</p> <p>(1) 认(申)购基金时资金被挪用的风险。通过第三方销售平台购买开放式基金, 托管人需根据划款指令将认(申)购资金划入第三方销售平台设立的收款账户, 存在第三方销售平台未将认(申)购资金及时或全额划付至基金管理公司销售账户、未用于购买管理人指定投资的基金的风险。</p> <p>(2) 基金赎回(现金分红)资金被挪用的风险。通过第三方销售平台提交基金赎回(现金分红)回款银行账户信息, 如第三方销售平台擅自变更回款银行账户信息, 存在赎回(分红)资金未能及时全额划付至托管账户的风险。</p> <p>(3) 认(申)购的基金份额核算不准确的风险。通过第三方销售平台购买基金, 存在第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资人持有基金份额不准确的风险。同时, 因实际认(申)购成功的基金份额受限于第三方销售平台提供的数据, 在管理人与托管人对委托财产进行估值时无法保证准确性, 存在基金份额核算不</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>(1) 认(申)购基金时资金被挪用的风险。通过第三方销售平台购买开放式基金, 托管人需根据划款指令将认(申)购资金划入第三方销售平台设立的收款账户, 存在第三方销售平台未将认(申)购资金及时或全额划付至基金管理公司销售账户、未用于购买管理人指定投资的基金的风险。</p> <p>(2) 基金赎回(现金分红)资金被挪用的风险。通过第三方销售平台提交基金赎回(现金分红)回款银行账户信息, 如第三方销售平台擅自变更回款银行账户信息, 存在赎回(分红)资金未能及时全额划付至托管账户的风险。</p> <p>(3) 认(申)购的基金份额核算不准确的风险。通过第三方销售平台购买基金, 存在第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资人持有基金份额不准确的风险。同时, 因实际认(申)购成功的基金份额受限于第三方销售平台提供的数据, 在管理人与托管人对委托财产进行估值时无法保证准确性, 存在基金份额核算不准确的风险。</p> <p>(4) 超出委托财产投资范围及投资限制的风险。如认(申)购基金的委托财产未能用于购买指定基金, 可能出现委托财产投向违反有关法律法规</p>	<p>准确的风险。</p> <p>(4) 超出委托财产投资范围及投资限制的风险。如认(申)购基金的委托财产未能用于购买指定基金, 可能出现委托财产投向违反有关法律法规和本合同约定的投资范围及投资限制的风险。</p> <p>(5) 第三方基金销售平台无基金销售资质的风险。通过第三方销售平台申赎开放式基金时, 管理人应核实拟合作的第三方销售平台确已经取得基金销售业务资格且有效存续, 存在拟合作的第三方销售平台基金销售业务资格被取消或核实不及时的风险。</p> <p>16、其他风险</p> <p>(1) 从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险</p> <p>按照资产管理合同约定, 管理人在本计划存续期内可运用本计划财产从事关联交易, 关联交易包括一般关联交易和重大关联交易。</p> <p>管理人制定了关联交易内部控制管理制度, 明确了关联交易的类型和范围、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并严格执行, 但按照上述标准及机制进行关联交易管理时, 需按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查, 存在</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>和本合同约定的投资范围及投资限制的风险。</p> <p>(5) 第三方基金销售平台无基金销售资质的风险。通过第三方销售平台申赎开放式基金时，管理人应核实拟合作的第三方销售平台确已经取得基金销售业务资格且有效存续，存在拟合作的第三方销售平台基金销售业务资格被取消或核实不及时的风险。</p> <p>17、其他风险</p> <p>(1) 关联交易的风险：管理人可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易，管理人制定的划分标准、管控机制包括：</p> <p>1) 关联方范围</p> <p>本计划所称关联方包括：</p> <p>A、本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方(含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司)；</p> <p>B、本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>C、本计划的投资顾问(如有)、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>D、与管理人、本计划的托管人、投资顾问(如有)有其他重大利害关系的机构；</p>	<p>无法监控全部关联交易类型的风险；同时，本计划进行关联交易时虽然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、防范利益输送，但仍可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时，管理人无法确保选择进行交易的实际交易结果(就投资完成后的实际损益情况而言)比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，或者关联交易行为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，从而可能影响受托资产的投资收益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。</p> <p>管理人从事一般关联交易的，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事一般关联交易。该等事先约定同意、事后统一披露的方式可能造成投资者无法及时知悉本计划从事一般关联交易并采取措施，投资者愿承担由此造成的参与财产损失。</p> <p>管理人从事重大关联交易的，可能因为重大关联交易金额或比例较高对本计划的投资运作产生较大影响。此外，对于重大关联交易，管理</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>E、监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行；</p> <p>上述第（1）项为管理人全部资产管理计划的关联方；第（2）（3）项为本计划的关联方。</p> <p>2）关联交易范围</p> <p>本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p> <p>A、本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）发行或者承销期内承销的证券；</p> <p>B、本计划财产投资于本计划托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>C、本计划财产投资于其投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>D、本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>E、本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；</p>	<p>人将事先取得投资者同意，若投资者未及时更新有效联系方式，可能影响管理人征求意见的效率，进而可能影响本计划的投资策略实施。</p> <p>（2）操作与技术风险：相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等导致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。</p> <p>在本计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为IT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、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。</p> <p>（3）发生不可抗力事件的风险：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，可能导致本计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致投资者利益受损。</p> <p>对上述风险的具体描述请见《第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划风险揭示书》。</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>F、本计划财产投资于投资顾问（如有）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>G、本计划财产以本计划关联方或者以本条第 D、E、F 项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款、逆回购交易等）；</p> <p>H、本计划财产以本计划关联方或者以本条第 D、E、F 项规定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产交易；</p> <p>I、本计划财产开展逆回购交易，质押券为管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）发行的证券；</p> <p>J、监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p> <p>3) 一般关联交易和重大关联交易</p> <p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易是指投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品的（本计划为 FOF 产品，或本计</p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>划投资于货币基金，或关联产品为公募基金、投资金额不超过该资管产品净值 10%且不超过公募基金份额 10%的除外)、与关联方及关联方产品为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20%或金额超过 2 亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10%或金额超过 3000 万元）的询价交易、以管理人及其关联方发行证券作为质押券开展的金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20%或金额超过 2 亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10%或金额超过 3000 万元）的逆回购交易等需强化审批、披露、报告的关联交易；一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监管机构和基金业协会的相关要求为准。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于一般关联交易。管理人将本计划财产投资于一般关联交易的，应在交易完成后，定期书面告知委托人和托管人并向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体</p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>以监管机构的要求为准。</p> <p>管理人将本计划财产投资于重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，逐笔通过公告或其他方式提前通知委托人，委托人约定时间内未提出异议的视为同意。委托人提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确。同时，管理人应事后及时告知委托人和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>4) 关联交易的内控机制</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。公司制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。</p> <p>5) 关联方名单披露方式</p> <p>本计划的关联方名单信息将通过公告的形式在管理人指定网站上披露或其他适当的方式通知委托人。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>6) 其他</p> <p>除将本计划财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券外，管理人不得将本计划财产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、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提供或者变相提供融资。全部委托人均符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者为私募资产管理产品的，穿透认定该私募资产管理产品的投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于1000万元）且单个委托人投资金额不低于1000万元，并且事先取得委托人同意的除外。</p> <p>(2) 操作与技术风险：相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等导致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。</p> <p>在本计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为IT系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导</p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>致委托人的利益受到影响，这种技术风险可能来自管理人、托管人、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券登记结算机构等。</p> <p>(3) 发生不可抗力事件的风险：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，可能导致本计划资产的损失。金融危机、行业竞争、代理机构违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致委托人利益受损。</p> <p>对上述风险的具体描述请见《第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划风险揭示书》。</p>	

附件 2：第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划说明书变更对照表

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
1	计划说明书全文	原计划说明书中“委托人”表述	统一修改为“投资者”
2	“基本信息”“投资范围及比例”	<p>1、投资范围</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的固定收益类资产、现金类资产、期货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>(1) 现金类资产：现金、各类银行存款（不含结构性存款）、货币市场基金等；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国债、地</p>	<p>1、投资范围</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的固定收益类资产、现金类资产、期货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>(1) 现金类资产：现金、各类银行存款（不含结构性存款）、货币市场基金等；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国债、地方</p>

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
		<p>方政府债、政府支持机构债、企业债券、公司债券（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债券（含可分离交易的可转债，不可转股）、可交换债（含可交换私募债，不可换股）、资产支持证券（不含劣后级）、债券型公募基金，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，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持票据（ABN，不含劣后级）、非公开定向债务融资工具（PPN）等，债券逆回购；</p> <p>（3）期货和衍生品类资产：国债期货。</p> <p>（4）本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>（1）固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例不低于资产总值的 80%；</p> <p>（2）任一交易日日终【（国债期货空头合约价值－国债期货多头合约价值－固定收益类证券市值）/集合资产管理计划资产净值】≤20%，固定收益类证券市值计算不包括同业存单、可转债、可交债，期货和衍生品类资产的持仓合约价值（按衍生</p>	<p>政府债、政府支持机构债、企业债券、公司债券（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债券（含可分离交易的可转债，不可转股）、可交换债（含可交换私募债，不可换股）、资产支持证券（不含劣后级）、债券型公募基金，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，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持票据（ABN，不含劣后级）、非公开定向债务融资工具（PPN）等，债券逆回购；</p> <p>（3）本计划可参与债券正回购交易。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>（1）固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例不低于资产总值的 80%；</p> <p>（2）参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>本计划投资于公开募集证券投资基金的，计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资公开募集证券投资基金的总资产，且按照穿透原则合并计算投资同类资产的金额需符合本计</p>

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
		<p>品的多头合约价值与空头合约价值之和计算)为资产总值的0%(含)-80%(不含);</p> <p>(3)参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的100%,中国证监会另有规定的除外。</p> <p>本计划投资于公开募集证券投资基金的,计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资公开募集证券投资基金的总资产,且按照穿透原则合并计算投资同类资产金额需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资公开募集证券投资基金披露投资组合的频率,更新计算计划所投资资产的金额或比例。</p>	<p>划资产配置比例的要求。本计划按照所投资公开募集证券投资基金披露投资组合的频率,更新计算计划所投资资产的金额或比例。</p>
3	“基本信息”“投资策略”	<p>.....</p> <p>(4)国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合久期、流动性和风险水平。管理人将结合对宏观经济形势和政策趋势判断,对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控。在最大限度维护本计划资产安全的基础上,力求实现本计划资产的增值。</p> <p>(5)现金及准现金类资产投资策略</p>	<p>.....</p> <p>(4)现金及准现金类资产投资策略</p> <p>现金及准现金类资产包含货币市场基金、银行存款、现金、到期日在1年内(含1年)的国债、到期日在1年内(含1年)的央行票据、到期日在1年内(含1年)的政府债券、不超过7天(含7天)的债券逆回购等。</p> <p>本集合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、债券逆回购的预</p>

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
		<p>现金及准现金类资产包含货币市场基金、银行存款、现金、到期日在1年内(含1年)的国债、到期日在1年内(含1年)的央行票据、到期日在1年内(含1年)的政府债券、不超过7天(含7天)的债券逆回购等。</p> <p>本集合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、债券逆回购的预期收益率来确定现金类资产的配置,并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。</p> <p>(6) 债券型公募基金投资策略</p> <p>在债券型公募基金的选择上,出于稳健性考虑,从控制信用风险角度,持仓上选择主要配置利率债、高等级国企信用债、高等级平台债、同业存单的债券型基金,同时,将考虑各类资产的性价比,择机在久期结构、资产配置方向上,灵活选择进行配置或交易。</p> <p>以上内容为管理人对于本计划全部或部分投资品种相应投资策略的阐述,不构成对于本计划投资范围、投资比例及限制的补充,也不构成管理人的承诺。</p>	<p>期收益率来确定现金类资产的配置,并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。</p> <p>(5) 债券型公募基金投资策略</p> <p>在债券型公募基金的选择上,出于稳健性考虑,从控制信用风险角度,持仓上选择主要配置利率债、高等级国企信用债、高等级平台债、同业存单的债券型基金,同时,将考虑各类资产的性价比,择机在久期结构、资产配置方向上,灵活选择进行配置或交易。</p> <p>以上内容为管理人对于本计划全部或部分投资品种相应投资策略的阐述,不构成对于本计划投资范围、投资比例及限制的补充,也不构成管理人的承诺。</p>

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书												
4	<p>“集合计划的参与和退出”</p> <p>“参与和退出的费用”</p>	<p>(1) 参与费用</p> <p>本计划无参与费,即参与费率为0。(2) 退出费用</p> <p>本计划按照委托人持有份额的期限设置不同的退出费用。</p> <table border="1" data-bbox="437 546 879 768"> <tr> <td>持有期限(单位:自然日)</td> <td>退出费率</td> </tr> <tr> <td>持有期限&lt;85</td> <td>0.8</td> </tr> <tr> <td>85≤持有期限</td> <td>0</td> </tr> </table> <p>退出费计算公式如下:</p> <p>退出费=剩余超额收益×退出费率</p> <p>剩余超额收益=超额收益-管理人业绩报酬</p> <p>退出费的收取上限=注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值×退出份额×3%</p> <p>投资者申请退出本计划时发生的退出费列入集合计划资产,本计划终止时发生的退出费归管理人所有。</p>	持有期限(单位:自然日)	退出费率	持有期限<85	0.8	85≤持有期限	0	<p>(1) 参与费用</p> <p>本计划无参与费,即参与费率为0。(2) 退出费用</p> <p>本计划按照投资者持有份额的期限设置不同的退出费用。</p> <table border="1" data-bbox="967 546 1447 768"> <tr> <td>持有期限(单位:自然日)</td> <td>退出费率</td> </tr> <tr> <td>持有期限&lt;85</td> <td>0.8</td> </tr> <tr> <td>85≤持有期限</td> <td>0</td> </tr> </table> <p>退出费计算公式如下:</p> <p>退出费=剩余超额收益×退出费率</p> <p>剩余超额收益=超额收益-管理人业绩报酬</p> <p>退出费的收取上限=注册登记机构受理申请当日本计划的单位净值×退出份额×3%</p> <p>投资者申请退出本计划时发生的退出费列入集合计划资产,本计划终止时(含提前终止)不收取退出费。</p>	持有期限(单位:自然日)	退出费率	持有期限<85	0.8	85≤持有期限	0
持有期限(单位:自然日)	退出费率														
持有期限<85	0.8														
85≤持有期限	0														
持有期限(单位:自然日)	退出费率														
持有期限<85	0.8														
85≤持有期限	0														
5	<p>“费用、报酬”</p> <p>“业绩报酬(浮动管理费)”</p>	<p>1、管理人收取业绩报酬的原则:</p> <p>(1) 同一委托人不同时间多次参与本计划的,对委托人每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬;</p> <p>(2) 在委托人退出日及计划终止日,对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬;</p> <p>(3) 在委托人退出日及本计划</p>	<p>1、管理人收取业绩报酬的原则:</p> <p>(1) 同一投资者不同时间多次参与本计划的,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;</p> <p>(2) 在投资者退出日及计划终止日,对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬;</p> <p>(3) 在投资者退出日及本计划终止日提取业绩报酬的,业绩报酬从退出</p>												

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
		<p>终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；</p> <p>(4) 委托人申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照委托人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、提取退出份额对应的业绩报酬。</p> <p>委托人知悉并同意，委托人为管理人自身管理的基金中基金（FOF）型资产管理计划的，其持有的份额不收取业绩报酬。</p> <p>.....</p>	<p>资金中扣除；</p> <p>(4) 投资者申请退出时，管理人按“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、提取退出份额对应的业绩报酬。</p> <p>投资者知悉并同意，投资者为管理人自身管理的基金中基金（FOF）型资产管理计划或由管理人担任投资顾问的其他资产管理产品的，其持有的份额不收取业绩报酬。</p> <p>.....</p>

附件 3：第一创业 ESG 整合债券 3 号集合资产管理计划风险揭示书变更对照表

序号	位置	原风险揭示书	变更后风险揭示书
1	<p>“二、风险揭示”</p> <p>“(一) 特殊风险揭示”“5、其他特殊风险”</p>	<p>.....</p> <p>(6) 投资国债期货的风险</p> <p>1) 信用风险，是指因交易对手无力履行合约义务而产生的风险。在国债期货合约中，即使敞口头寸没有市场风险，它仍有可能包含信用风险。信用风险包括交割前风险和交割风险。交割前风险即在合约到期前由于国债期货价格变动或者其它原因致使交易者蒙受较大亏损而无力履行合约义务风险；交割风险即在合约到期日交易方履行了合约，交易对手却未能履约的风险。</p> <p>2) 市场风险，指国债期货产品价值对交易者产生不利影响的风险，即国债期货</p>	<p>.....</p> <p>删除“(6) 投资国债期货的风险”</p>

		<p>的交割发生逆向不利变动而带来价值损失的可能性。</p> <p>3)操作风险,指因计算机系统不完善,内控制度不够健全和人员操作失误等原因,业务处理不能圆满进行的风险,以及由于没有建立灾害等紧急情况下的事务处理机制而导致业务停止的风险。对于国债期货这类衍生工具来说,由于其支付和价值计算过程都十分复杂,因此操作风险所导致的损失可能会严重。</p> <p>4)强制平仓风险或爆仓风险。国债期货实行当时无负债结算制度,当市场朝不利方向波动时需要追加保证金,特别是当出现极端不利行情时,基差也可能出现不利变动,此时需要的保证金数额很可能超出正常值,如果不能及时采取措施增加保证金,期货头寸将被强行平仓,而相应对冲策略也可能被迫终止,因此,本集合计划将面临由于市场波动导致追加保证金的风险,也面临着由于系统故障等原因不能及时追加保证金导致策略提前结束的风险,从而使得预期盈利不能兑现甚至导致不必要的净值损失。</p>	
2	风险揭示书全文	原风险揭示书中“委托人”表述	统一修改为“投资者”
3	“二、风险揭示” “(二)一般风险揭	<p>.....</p> <p>8、投资金融衍生品的风险</p> <p>(1) 市场风险</p> <p>由于保证金交易具有杠杆性,当出现</p>	<p>.....</p> <p>8、税收风险</p> <p>本计划作为契约型产品所适用的税收征管法律法规可能会由</p>

<p>示”</p>	<p>不利情形时，标的证券微小的变动就可能使委托人权益遭受较大损失；场内期权实行当日无负债结算制度，对资金管理要求非常高。价格波动剧烈的时候可能面临追加保证金的问题，如果没有在规定时间内补足保证金，按规定将面临平仓的风险。</p> <p>(2) 信用风险</p> <p>对于衍生品交易而言，信用风险发生的概率极小，原因是在进行衍生产品交易时，交易所有一套独特的交易体系，如设立一系列的保证金制度，最低资金要求，逐日盯市结算措施及强行平仓制度等，使整个市场的信用风险下降。但这种由结算公司充当所有投资者的交易对手，并承担履约责任，一旦结算公司出现风险暴露，由于其风险过度集中，在重大风险事件发生时，或风险监控制度不完善时也会发生信用风险。</p> <p>(3) 杠杆风险</p> <p>金融衍生品投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本计划可能承受超出保证金甚至本计划财产本金的损失。</p> <p>9、税收风险</p> <p>本计划作为契约型产品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，委托人收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。</p> <p>10、本计划提前终止的风险</p>	<p>于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。</p> <p>9、本计划提前终止的风险</p> <p>本计划运作期间，当本计划投资者少于 2 人或者其他本计划约定的提前终止情形出现时，导致集合计划提前终止的风险。管理人也有权根据产品的运作情况决定提前终止本计划。</p> <p>10、合同变更风险</p> <p>管理人就合同变更征求投资者意见期间，未明确提出异议的投资者、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的投资者均视为同意修改或变更合同和说明书。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果投资者因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。</p> <p>11、投资者可能无法参与的风险</p> <p>由于本计划可能设定规模上限，管理人将根据合同的约定对规模上限进行控制，因此投资者可能面临着因上述原因而无法参</p>
-----------	--	--

		<p>本计划运作期间，当本计划委托人少于 2 人或者其他本计划约定的提前终止情形出现时，导致集合计划提前终止的风险。管理人也有权根据产品的运作情况决定提前终止本计划。</p> <p>11、合同变更风险</p> <p>管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的委托人均视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。</p> <p>12、委托人可能无法参与的风险</p> <p>由于本计划可能设定规模上限，管理人将根据合同的约定对规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本计划的风险。</p> <p>13、委托人部分退出的风险</p> <p>委托人部分退出本计划份额时，如其该笔退出受理后委托人持有的剩余集合计划份额的资产净值低于人民币 300,000 元，委托人面临剩余份额强制退出的风险。</p> <p>14、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险</p> <p>当本计划发生巨额赎回情形且管理人</p>	<p>与本计划的风险。</p> <p>12、投资者部分退出的风险</p> <p>投资者部分退出本计划份额时，如其该笔退出受理后投资者持有的剩余集合计划份额的资产净值低于人民币 300,000 元，投资者面临剩余份额强制退出的风险。</p> <p>13、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险</p> <p>当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，届时赎回净值可能发生变动，投资者退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异，将直接影响到投资者的投资收益。举例如下：</p> <p>假设本计划退出申请日单位净值为 A（净值精度调整前），投资者退出份额为 X，则退出申请日单位净值精度误差最高为 ± 0.00005 元（即四舍五入小数点后第 5 位最大误差），由此计算的单位净值 A 调整精度后对投资者退出总金额的最大影响为 ± <math>X \times 0.00005</math> 元。</p> <p>14、退出费的计算存在影响投资者投资收益的风险</p> <p>本计划根据投资者持有期限</p>
--	--	---	--

	<p>决定采取净值精度应急调整机制，届时赎回净值可能发生变动，委托人退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异，将直接影响到委托人的投资收益。举例如下：</p> <p>假设本计划退出申请日单位净值为 A（净值精度调整前），委托人退出份额为 X，则退出申请日单位净值精度误差最高为 ±0.00005 元（即四舍五入小数点后第 5 位最大误差），由此计算的单位净值 A 调整精度后对委托人退出总金额的最大影响为 ±X*0.00005 元。</p> <p>15、退出费的计算存在影响委托人投资收益的风险</p> <p>本计划根据委托人持有期限设置了不同的业绩报酬计提基准以及退出费率，委托人务必在参与和退出本计划前自行前往管理人官网查询相应的退出费率及业绩报酬计提基准。委托人的参与和退出视为投资者以自己的行动表明已充分知悉退出时点对应的退出费率及业绩报酬计提基准。退出费关系到委托人退出金额的计算，从而影响委托人的投资收益。</p> <p>退出费举例说明：</p> <p>假设委托人在本计划存续期首次参与本计划 2,000,000 元，根据本合同约定，该委托人适用的参与费率为 0，参与申请当日本计划单位净值为 1.0000（ ）、本计划单位累计净值为 1.0000（ ），注册登记机构确认参与份额 2,000,000 份。假</p>	<p>设置了不同的业绩报酬计提基准以及退出费率，投资者务必在参与和退出本计划前自行前往管理人官网查询相应的退出费率及业绩报酬计提基准。投资者的参与和退出视为投资者以自己的行动表明已充分知悉退出时点对应的退出费率及业绩报酬计提基准。退出费关系到投资者退出金额的计算，从而影响投资者的投资收益。</p> <p>退出费举例说明：</p> <p>假设投资者在本计划存续期首次参与本计划 2,000,000 元，根据本合同约定，该投资者适用的参与费率为 0，参与申请当日本计划单位净值为 1.0000（ ）、本计划单位累计净值为 1.0000（ ），注册登记机构确认参与份额 2,000,000 份。假设该投资者在持有的第 30 天提出退出申请，根据本计划的退出费率及业绩报酬计提基准安排，业绩报酬计提比例为 30%，且该投资者适用的退出费率为 0.8，假设适用的业绩报酬计提基准为 4%；假设退出申请当日本计划单位净值为 1.0100、本计划单位累计净值为 1.0100（ ）。</p> <p>则投资者退出费计算如下：</p>
--	--	---

	<p>设该委托人在持有的第 30 天提出退出申请，根据本计划的退出费率及业绩报酬计提基准安排，业绩报酬计提比例为 30%，且该委托人适用的退出费率为 0.8，假设适用的业绩报酬计提基准为 4%；假设退出申请当日本计划单位净值为 1.0100、本计划单位累计净值为 1.0100（ ）。</p> <p>则委托人退出费计算如下：</p> <p>年化收益率（R）=（1.0100-1.0000）/1.0000×365/30×100%=12.17%</p> <p>超额收益（Y）=2,000,000×（12.17%-4%）×30/365=13,430.14</p> <p>管理人业绩报酬= 13,430.14 ×30%=4,029.04</p> <p>剩余超额收益 =13,430.14-4,029.04=9,401.10</p> <p>退出费=9,401.10×0.8=7520.88（小于退出费收取上限）</p> <p>退出费的收取上限 =1.0100*2,000,000*3%=60600</p> <p>16、通过第三方销售平台投资开放式基金的风险</p> <p>（1）认（申）购基金时资金被挪用的风险。通过第三方销售平台购买开放式基金，托管人需根据划款指令将认（申）购资金划入第三方销售平台设立的收款账户，存在第三方销售平台未将认（申）购资金及时或全额划付至基金管理公司销售账户、未用于购买管理人指定投资的基金</p>	<p>年化收益率（R）=（1.0100-1.0000）/1.0000×365/30×100%=12.17%</p> <p>超额收益（Y）=2,000,000×（12.17%-4%）×30/365=13,430.14</p> <p>管理人业绩报酬= 13,430.14 ×30%=4,029.04</p> <p>剩余超额收益=13,430.14-4,029.04=9,401.10</p> <p>退出费 =9,401.10 ×0.8=7520.88（小于退出费收取上限）</p> <p>退出费的收取上限 =1.0100*2,000,000*3%=60600</p> <p>15、通过第三方销售平台投资开放式基金的风险</p> <p>（1）认（申）购基金时资金被挪用的风险。通过第三方销售平台购买开放式基金，托管人需根据划款指令将认（申）购资金划入第三方销售平台设立的收款账户，存在第三方销售平台未将认（申）购资金及时或全额划付至基金管理公司销售账户、未用于购买管理人指定投资的基金的风险。</p> <p>（2）基金赎回（现金分红）资金被挪用的风险。通过第三方</p>
--	---	--

	<p>的风险。</p> <p>(2) 基金赎回(现金分红)资金被挪用的风险。通过第三方销售平台提交基金赎回(现金分红)回款银行账户信息,如第三方销售平台擅自变更回款银行账户信息,存在赎回(分红)资金未能及时全额划付至托管账户的风险。</p> <p>(3) 认(申)购的基金份额核算不准确的风险。通过第三方销售平台购买基金,存在第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资人持有基金份额不准确的风险。同时,因实际认(申)购成功的基金份额受限于第三方销售平台提供的数据,在管理人与托管人对委托财产进行估值时无法保证准确性,存在基金份额核算不准确的风险。</p> <p>(4) 超出委托财产投资范围及投资限制的风险。如认(申)购基金的委托财产未能用于购买指定基金,可能出现委托财产投向违反有关法律法规和本合同约定的投资范围及投资限制的风险。</p> <p>(5) 第三方基金销售平台无基金销售资质的风险。通过第三方销售平台申赎开放式基金时,管理人应核实拟合作的第三方销售平台确已经取得基金销售业务资格且有效存续,存在拟合作的第三方销售平台基金销售业务资格被取消或核实不及时的风险。</p> <p>17、其他风险</p>	<p>销售平台提交基金赎回(现金分红)回款银行账户信息,如第三方销售平台擅自变更回款银行账户信息,存在赎回(分红)资金未能及时全额划付至托管账户的风险。</p> <p>(3) 认(申)购的基金份额核算不准确的风险。通过第三方销售平台购买基金,存在第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资人持有基金份额不准确的风险。同时,因实际认(申)购成功的基金份额受限于第三方销售平台提供的数据,在管理人与托管人对委托财产进行估值时无法保证准确性,存在基金份额核算不准确的风险。</p> <p>(4) 超出委托财产投资范围及投资限制的风险。如认(申)购基金的委托财产未能用于购买指定基金,可能出现委托财产投向违反有关法律法规和本合同约定的投资范围及投资限制的风险。</p> <p>(5) 第三方基金销售平台无基金销售资质的风险。通过第三方销售平台申赎开放式基金时,管理人应核实拟合作的第三方销售平台确已经取得基金销售业务资格且有效存续,存在拟合作的</p>
--	--	---

	<p>(1) 关联交易的风险：管理人可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易，管理人制定的划分标准、管控机制包括：</p> <p>1) 关联方范围</p> <p>本计划所称关联方包括：</p> <p>A、本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）；</p> <p>B、本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>C、本计划的投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>D、与管理人、本计划的托管人、投资顾问（如有）有其他重大利害关系的机构；</p> <p>E、监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行；</p> <p>上述第（1）项为管理人全部资产管理计划的关联方；第（2）（3）项为本计划的关联方。</p> <p>2) 关联交易范围</p> <p>本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p> <p>A、本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）发行或者承销期内承销的证券；</p> <p>B、本计划财产投资于本计划托管人、</p>	<p>第三方销售平台基金销售业务资格被取消或核实不及时的风险。</p> <p>16、其他风险</p> <p>(1) 从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险</p> <p>按照资产管理合同约定，管理人在本计划存续期内可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易。</p> <p>管理人制定了关联交易内部控制管理制度，明确了关联交易的类型和范围、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内部控制机制并严格执行，但按照上述标准及机制进行关联交易管理时，需按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险；同时，本计划进行关联交易时虽然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、防范利益输送，但仍可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时，管理人无法确保选择进行交易的实际交易结果（就投资完成后的实际损益情</p>
--	---	---

	<p>托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>C、本计划财产投资于其投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>D、本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>E、本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；</p> <p>F、本计划财产投资于投资顾问（如有）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>G、本计划财产以本计划关联方或者以本条第D、E、F项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款、逆回购交易等）；</p> <p>H、本计划财产以本计划关联方或者以本条第D、E、F项规定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产交易；</p> <p>I、本计划财产开展逆回购交易，质押券为管理人、管理人的控股股东、实际控</p>	<p>况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，或者关联交易行为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，从而可能影响受托资产的投资收益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。</p> <p>管理人从事一般关联交易的，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事一般关联交易。该等事先约定同意、事后统一披露的方式可能造成投资者无法及时知悉本计划从事一般关联交易并采取措施，投资者愿承担由此造成的参与财产损失。</p> <p>管理人从事重大关联交易的，可能因为重大关联交易金额或比例较高对本计划的投资运作产生较大影响。此外，对于重大关联交易，管理人将事先取得投资者同意，若投资者未及时更新有效联系方式，可能影响管理人征求意见的效率，进而可能影响本计划的投资策略实施。</p> <p>……</p>
--	---	---

	<p>制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）发行的证券；</p> <p>J、监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p> <p>3) 一般关联交易和重大关联交易</p> <p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易是指投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品的（本计划为 FOF 产品，或本计划投资于货币基金，或关联产品为公募基金、投资金额不超过该资管产品净值 10%且不超过公募基金份额 10%的除外）、与关联方及关联方产品为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20%或金额超过 2 亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10%或金额超过 3000 万元）的询价交易、以管理人及其关联方发行证券作为质押券开展的金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20%或金额超过 2 亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10%或金额超过 3000 万元）的逆回购交易等需强化审批、披露、报告的关联交易；一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监</p>	
--	---	--

管机构和基金业协会的相关要求为准。

委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于一般关联交易。管理人将本计划财产投资于一般关联交易的，应在交易完成后，定期书面告知委托人和托管人并向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。

管理人将本计划财产投资于重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，逐笔通过公告或其他方式提前通知委托人，委托人约定时间内未提出异议的视为同意。委托人提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确。同时，管理人应事后及时告知委托人和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。

#### 4) 关联交易的内部控制机制

管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。公司制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。

#### 5) 关联方名单披露方式

本计划的关联方名单信息将通过公告

的形式在管理人指定网站上披露或其他适当的方式通知委托人。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。

6) 其他

除将本计划财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券外，管理人不得将本计划财产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、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提供或者变相提供融资。全部委托人均符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者为私募资产管理产品的，穿透认定该私募资产管理产品的投资者均符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元）且单个委托人投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得委托人同意的除外。

.....