

## 首創證券創贏增利 2 號集合資產管理計劃

### 變更合同條款說明五

我司近期擬對《首創證券創贏增利 2 號集合資產管理計劃資產管理合同》(以下合併簡稱“資產管理合同”)中的部分條款進行更改,產品條款更改涉及如下:

#### 一、資產管理合同全文中:

“委託資產”, 變更為“受託資產”;

“委託財產”, 變更為“受託財產”。

#### 二、資產管理合同“一、前言”中:

原:

“(一) 訂立本合同的依據是《中華人民共和國民法典》(以下簡稱《民法典》)、《中華人民共和國證券投資基金法》(以下簡稱《基金法》)、《關於規範金融機構資產管理業務的指導意見》(以下簡稱《指導意見》)、《證券期貨經營機構私募資產管理業務管理辦法》(以下簡稱《管理辦法》)、《證券期貨經營機構私募資產管理計劃運作管理規定》(以下簡稱《運作規定》)、《集合資產管理計劃資產管理合同內容與格式指引(試行)》(以下簡稱“合同指引”)、《中華人民共和國個人信息保護法》(以下簡稱《個人信息保護法》)等法律法規、中國證監會和中國證券投資基金業協會的有關規定。

(二) 訂立本合同的目的是規範首創證券創贏增利 2 號集合資產管理計劃(以下簡稱“本集合計劃”)運作, 明確《首創證券創贏增利 2 號集合資產管理計劃資產管理合同》當事人的權利與義務, 保護集合計劃委託人的合法權益。

(三) 訂立本合同的原則是平等自願、誠實信用、充分保護集合計劃委託人的合法權益。

本合同是規定當事人之間基本權利義務的法律文件, 當事人按照《指導意見》《管理辦法》《運作規定》《個人信息保護法》《首創證券創贏增利 2 號集合資產管理計劃說明書》(以下簡稱《說明書》)、本合同及其他有關規定享有權利、承擔義務, 託管協議中如有與本合同表述不一致之處, 以本合同約定為準。

管理人應當對資產管理計劃的設立、變更、展期、終止、清算等行為按現行有效的法律法規規定、金融管理部門以及中國證券投資基金業協會的要求進行備案、報送。證券投資基金業協會辦理資產管理計劃備案不作為對資產管理計劃財產安全和投資者收益的保證, 也不表明證券投資基金業協會對備案材料的真實性、準確性、完整性作出保證。投資者應當充分了解資產管理計劃的投資範圍、投資策略和風險收益等信息, 根據自身風險承擔能力審慎選擇資產管理計劃, 自主判斷投資價值, 自行承擔投資風險。”

變更為:

"(一)订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》(以下简称《民法典》)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《中华人民共和国证券法》(以下简称《证券法》)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《中华人民共和国期货和衍生品法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作规定》)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》(以下简称“合同指引”)、《中华人民共和国个人信息保护法》(以下简称《个人信息保护法》)等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定。

(二)订立本合同的目的是规范首创证券创赢增利2号集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)运作,明确《首创证券创赢增利2号集合资产管理计划资产管理合同》当事人的权利与义务,保护集合计划委托人的合法权益。

订立本合同的原则是平等自愿、公平、诚实信用,充分保护集合计划委托人的合法权益。

本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。当事人按照《指导意见》《管理办法》《运作规定》《个人信息保护法》《首创证券创赢增利2号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务,托管协议中如有与本合同表述不一致之处,以本合同约定为准。

管理人应当按照规定向协会办理资产管理计划的设立、变更备案,并及时报送资产管理计划的运行情况、风险情况以及终止清算报告等信息。协会办理资产管理计划备案不代表协会对资产管理计划的合规性、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资产管理计划的投资范围、投资策略和风险收益等信息,根据自身风险承担能力审慎选择资产管理计划,自主判断投资价值,自行承担投资风险。

### 三、资产管理合同"二、释义"中:

原:

"合同指引:指2019年3月29日中国证券投资基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》;

委托人:指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本集合计划的投资者,包括个人投资者、机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买资产管理计划的其他投资者;"

变更为:

"合同指引:指2023年12月15日中国证券投资基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》;

委托人/投资者：指依据集合资产管理合同和集合计划说明书参与本集合计划的投资者，包括个人投资者、机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买资产管理计划的其他投资者；”

#### 四、资产管理合同“三、承诺与声明”中：

原：

”（一）管理人承诺

（二）托管人承诺

2、根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

3、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定召集份额持有人大会（如有），维护投资者权益。

（三）投资者声明

1、符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

3、已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本集合计划将自行承担投资风险。”

变更为：

”（一）管理人承诺与声明

（二）托管人承诺与声明

2、根据法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或者清算指令等进行监督。

3、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律、行政法规以及合同约定召集份额持有人大会（如有），维护投资者权益。

（三）投资者承诺与声明

1、符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或者销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

3、已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规以及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人以及相关机构不应对资

产管理计划的收益状况或者本金不受损失作出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本集合计划将自行承担投资风险。”

#### 五、资产管理合同“四、当事人及权利义务”中：

原：

“本集合计划设定为均等份额。除本合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益。

##### （一）委托人

##### 1、委托人简况

##### 【个人填写】

姓名：

证件类型：

证件号码：

住所：

通信地址：

邮政编码：

联系电话：

移动电话：

电子信箱：

其他：

##### 【机构填写】

机构名称：

法定代表人：

住所：

通信地址：

邮政编码：

代理人姓名：

身份证号码：

联系电话：

其他：

委托人的详细情况在电子签名合同数据中列示。

## 2、委托人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，委托人的权利包括但不限于：

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；
- (3) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (4) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- (5) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- (6) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- (7) 因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
- (8) 投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，投资者可向管理人提出关于撤回同意处理个人信息授权的书面申请。投资者撤回同意，不影响撤回前基于个人同意已进行的个人信息处理活动的效力；
- (9) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。

## 3、委托人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，委托人的义务包括但不限于：

- (1) 委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；
- (2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- (3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；
- (4) 认真阅读并签署风险揭示书；
- (5) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；
- (6) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；



(7) 向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

(8) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

(9) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；

(10) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

(11) 不得违规或违反本合同约定转让其所拥有的计划份额；

(12) 本集合计划如采用电子签名合同，委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料。委托人应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

(13) 除非在本合同规定的开放退出期或终止日，不得要求提前终止委托资产管理关系；

(14) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

## (二) 管理人

### 1、管理人简况

机构名称：首创证券股份有限公司

法定代表人：毕劲松

住所及通信地址：北京市朝阳区安定路5号院13号楼A座11-21层

邮政编码：100029

联系人：孙艺桐

联系电话：010-81152158

### 2、管理人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

(1) 按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

(3) 按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；

(4) 根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；

(5) 自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；

(6) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

(7) 按照本合同及《说明书》的约定，暂停办理集合计划份额的参与、退出事宜；

(8) 根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；

(9) 集合计划资产受到损害时，以管理人名义向有关责任人追究法律责任；

(10) 法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

### 3、管理人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；

(2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；

(3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；

(4) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；

(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；

(7) 建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；

(8) 除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产；

(9) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；

(10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；

(11) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；

(12) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；

(13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(14) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划单位净值；

(15) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；

(16) 对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

(17) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

(18) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；

(19) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(20) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送；

(21) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(22) 建立并保存投资者名单；

(23) 组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(24) 按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(25) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；

(26) 按照有关合同和规定行使资产管理计划财产投资权利而应承担的义务，包括但不限于选择经纪商及投资标的等；

(27) 依法对托管人、销售机构的行为进行监督，如发现托管人、销售机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反本合同、代理销售协议的，应当予以制止；



(28) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项；

(29) 在本集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；

(30) 因管理人违反本合同导致集合计划财产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(31) 除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传；

(32) 遵守《个人信息保护法》的要求，遵守保密义务，采取必要的措施保障投资者个人信息的安全，并采取合理措施告知投资者其执行的个人信息保护政策；

(33) 管理人向其他个人信息处理者提供其处理的个人信息的，应当向个人告知接收方的名称或者姓名、联系方式、处理目的、处理方式和个人信息的种类，并取得个人的单独同意。受托个人信息处理者为国家机关或者法律、法规授权的具有管理公共事务职能的组织，且法律、行政法规规定应当保密或者不需要告知的情形的，管理人可以不向个人告知且无需经投资者单独同意；

(34) 按照我国有关反洗钱法律、行政法规，履行客户身份识别反洗钱义务，识别、核实资产委托人的身份及资产管理计划的受益所有人，并按监管规定保存相关身份信息、资料；在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分，对高风险的客户采取适当的风控措施；在法律允许范围内，配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作，并提供必要客户信息、资料等；履行大额交易和可疑交易报告义务，并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规，要求资产委托人积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序。

(35) 采取了适当的措施，确保资产管理计划的委托人、受益所有人等不得为我国公安部等有权部门发布的恐怖活动组织及恐怖活动人员名单，不得为联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的反洗钱和反恐怖融资名单，或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单。

(36) 资产管理计划的投资行为不得违反我国、联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的有关经济制裁或反洗钱法律法规，或用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途。

(37) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。

### （三）托管人

#### 1、托管人简况

名称：广发银行股份有限公司

地址：北京市东城区东长安街甲 2 号广发银行大厦

法定代表人或负责人：王凯

邮政邮编：100731

业务联系人：李萌

联系电话：010-65169086

传真：010-65169555

## 2、托管人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

(1) 按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；

(3) 按照托管协议的约定监督管理人集合计划的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反托管协议之附件《交易监控合规表》对投资范围及投资比例约定的，如指令未生效，有权予以制止。如指令已生效，则按指令划款后，有权要求管理人纠正；

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 托管协议与本合同、说明书约定不一致的，托管人具体职责以托管协议为准，其余内容以本合同约定为准。

(6) 托管人的职责不包含：

①投资者的适当性管理；

②审核项目及交易信息真实性；

③审查保管产品以及委托资产资金来源的合法合规性；

④对委托资产本金及收益提供保证或承诺；

⑤对已划出保管账户以及处于托管人实际控制之外的资产的保管责任；

⑥对未兑付保管产品后续资金的追偿；

⑦管理人方未接受保管人的复核意见进行信息披露产生的相应责任；

⑧因不可抗力，以及由于第三方(包括但不限于证券交易所、期货交易所、中国证券登记结算公司、中国期货市场监控中心等)发送或提供的数据错误及合理信赖上述信息操作给保管资产造成的损失；

⑨提供保证或其他形式的担保；

⑩自身应尽职责之外的连带责任，包括对管理人的行为的连带责任。

(7) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

### 3、托管人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，托管人的义务（职责）包括但不限于：

- （1）安全保管资产管理计划财产；
- （2）除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；
- （3）对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；
- （4）公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- （5）按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；
- （6）复核资产管理计划资产净值和份额净值；
- （7）办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；
- （8）根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见；
- （9）编制私募资产管理业务托管年度报告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送
- （10）按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- （11）保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；
- （12）根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；
- （13）监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构；
- （14）依照法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自用或处分集合计划资产；
- （15）在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管集合计划的资产，确保集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；
- （16）定期核对资产管理业务资产情况；
- （17）建立与管理人的对账机制，复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值和资产管理计划参与、退出价格；

(18) 保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前予以保密，不向他人泄露（法律法规、中国证监会另有规定或有权机关要求的除外）；

(19) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

(20) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人；

(21) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(22) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的，由托管人召集份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外；

(24) 投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；

(25) 国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。"

**变更为：**

"本集合计划设定为均等份额。除本合同另有约定外，每份份额享有同等权益，承担同等风险。

(一) 委托人

1、委托人简况

**【个人填写】**

姓名：

证件类型：

证件号码：

住所：

通信地址：

邮政编码：

联系电话：

移动电话：

电子信箱：

其他：

**【机构填写】**

机构名称：

法定代表人：

住所：

通信地址：

邮政编码：

代理人姓名：

身份证号码：

联系电话：

其他：

委托人的详细情况在电子签名合同数据中列示。

## 2、委托人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，委托人的权利包括但不限于：

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 通过管理人网站查询等方式查询有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；
- (3) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (4) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- (5) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- (6) 监督管理人、托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- (7) 因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
- (8) 投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，投资者可向管理人提出关于撤回同意处理个人信息的书面申请。投资者撤回同意，不影响撤回前基于个人同意已进行的个人信息处理活动的效力；
- (9) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和本合同约定的其他权利。

## 3、委托人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，委托人的义务包括但不限于：

- (1) 委托人应认真阅读并遵守本合同及《说明书》，承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；



(2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；

(3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应当向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；

(4) 按照规定向管理人或者资产管理计划销售机构提供信息资料以及身份证明文件，配合管理人或者其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

(5) 认真阅读并签署风险揭示书；

(6) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

(7) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；

(8) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

(9) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；

(10) 不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

(11) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；

(12) 不得违规或违反本合同约定转让其所拥有的计划份额；

(13) 本集合计划如采用电子签名合同，委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料。委托人应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

(14) 除非在本合同规定的开放退出期或终止日，不得要求提前终止信托法律关系；

(15) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

## (二) 管理人

### 1、管理人简况

机构名称：首创证券股份有限公司

法定代表人：毕劲松

住所及通信地址：北京市朝阳区安定路5号院13号楼A座11-21层

邮政编码：100029

联系人：孙艺桐

联系电话：010-81152158

## 2、管理人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

- (1) 按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；
- (2) 按照资产管理合同约定及时、足额获得管理人管理费用和业绩报酬（如有）；
- (3) 按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；
- (4) 自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认可的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；
- (5) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；
- (6) 按照本合同及《说明书》的约定，暂停办理集合计划份额的参与、退出事宜；
- (7) 根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；
- (8) 集合计划资产受到损害时，以管理人名义向有关责任人追究法律责任；
- (9) 法律、行政法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定和本合同约定的其他权利。

## 3、管理人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；
- (2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；
- (3) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向合格投资者非公开募集资金；
- (4) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；
- (5) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；

(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；

(7) 建立健全内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同资产管理计划的受托财产分别管理，分别记账，进行投资；

(8) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；

(9) 召集资产管理计划份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外；

(10) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合相关要求以及合同的约定；

(11) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；

(12) 对《管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

(13) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

(14) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；

(15) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(16) 编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告；

(17) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(18) 组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(20) 对于托管人违反法律、行政法规规定或者资产管理合同，对资产管理计划财产以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；

(21) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产以及其他当事人利益的活动；不得向管理人以及任何第三人输送利益；不得委托第三人运作资产管理计划财产；

(22) 不得利用资产管理计划，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，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；

(23) 建立并保存投资者名单；

(24) 保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(25) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；

(26) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；

(27) 按照有关合同和规定行使资产管理计划财产投资权利而应承担的义务，包括但不限于选择经纪商及投资标的等；

(28) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项；

(29) 在本集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；

(30) 因管理人违反本合同导致集合计划财产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(31) 除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传。

(32) 遵守《个人信息保护法》的要求，遵守保密义务，采取必要的措施保障投资者个人信息的安全，并采取合理措施告知投资者其执行的个人信息保护政策；

(33) 管理人向其他个人信息处理者提供其处理的个人信息的，应当向个人告知接收方的名称或者姓名、联系方式、处理目的、处理方式和个人信息的种类，并取得个人的单独同意。受托个人信息处理者为国家机关或者法律、法规授权的具有管理公共事务职能的组织，且法律、行政法规规定应当保密或者不需要告知的情形的，管理人可以不向个人告知且无需经投资者单独同意；

(34) 管理人应按照我国有关反洗钱法律、行政法规，通过各项安排履行客户身份识别反洗钱义务，识别、核实资产委托人的身份及资产管理计划的受益所有人，并按监管规定、保存相关身份信息、资料；通过各项安排在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分，对高风险的客户采取适当的风控措施；在法律允许范围内，协调各方必要时配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作，并协调提供必要客户信息、资料等；通过各项安排确保资产委托人及资产管理计划的受益所有人不涉及洗钱、恐怖融资、扩散融资、逃税、制裁等风险，按照监管要求或通过各项安排履行大额交易和可疑交易报告义务，并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规，通过各项安排要求资产委托人积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序。

(35) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。

### (三) 托管人

## 1、托管人简况

名称：广发银行股份有限公司

地址：北京市东城区东长安街甲2号广发银行大厦

法定代表人或负责人：王凯

邮政邮编：100731

业务联系人：李萌

联系电话：010-65169086

传真：010-65169555

## 2、托管人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

(1) 按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；

(3) 按照本协议的约定监督管理人集合计划的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反本协议之附件《交易监控合规表》对投资范围及投资比例约定的，如指令未生效，有权予以制止。如指令已生效，则按指令划款后，有权要求管理人纠正；

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 托管协议与本合同、说明书约定不一致的，托管人的托管职责以本合同的约定为准；

(6) 托管人的职责不包含：

①投资者的适当性管理；

②审核项目及交易信息真实性；

③审查保管产品以及受托资产资金来源的合法合规性；

④对受托资产本金及收益提供保证或承诺；

⑤对未兑付保管产品后续资金的追偿；

⑥管理人方未接受保管人的复核意见进行信息披露产生的相应责任；

⑦因不可抗力，以及由于第三方(包括但不限于证券交易所、期货交易所、中国证券登记结算公司、中国期货市场监控中心等)发送或提供的数据错误及合理信赖上述信息操作给保管资产造成的损失；

⑧提供保证或其他形式的担保；

⑨自身应尽职责之外的连带责任，包括对管理人的行为的连带责任。



(7) 业务存续期间，资产托管人有权对资产委托人、资产管理人进行客户身份识别（包括持续识别、重新识别、受益所有人识别等）和尽职调查，如资产委托人、资产管理人不予以配合，或资产托管人采取有效措施仍无法进行客户身份识别和尽职调查，或资产托管人经评估发现超过资产托管人风险管理能力且经托管书面通知无法在合理期限内整改完毕的，资产委托人、资产管理人同意资产托管人有权中止交易，直至终止本协议。

(8) 资产托管人有权根据反洗钱、反恐怖融资和反扩散融资等法律法规和监管规定，针对出现洗钱、恐怖融资和扩散融资、制裁等非法活动或相关可疑情形，收集、使用相关信息，采取暂停或终止资产委托人、资产管理人相关业务等措施。

(9) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他权利。

### 3、托管人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 安全保管资产管理计划财产，托管人自委托资金进入托管账户之日起履行托管职责；

(2) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；

(4) 按照资产管理合同的约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(5) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；

(6) 向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息；

(7) 投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产，监督管理人投资运作等职责；

(8) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或者清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构；

(9) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；

(10) 对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具意见；

(11) 编制托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构；

(12) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的，由托管人召集份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外；

(13) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产以及其他当事人利益的活动；

(14) 不得为托管人以及任何第三人输送利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；

(15) 保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(16) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；

(17) 定期核对资产管理业务资产情况；

(18) 建立与管理人的对账机制，复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值和资产管理计划参与、退出价格；

(19) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

(20) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人；

(21) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(22) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。”

## 六、资产管理合同“五、资产管理计划的基本情况”中：

原：

”（五）资产管理计划投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

### 2、主要投资方向

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等标准化债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。

（1）固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债、金融机构次级债）、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和银保监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型公募基金。

（2）现金类资产：包括货币市场基金、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。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别（若无主体评级则取债项评级，若无债项评级则取主体评级）。短期融资券、超短期融资券发行人主体评级不得低于 AA，短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于 A-1。资产支持证券债项评级不得低于 AA，仅能投资资产支持证券优先级，且不得投资于将资管产品或其收益权/受益权作为底层资产的资产支持证券，投向非公开定向债务融资工具及资产支持证券占计划上一日资产总值的合计比例不得高于 40%。

(3) 本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。

### 3、投资比例

(1) 固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的 80%-100%。

.....

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超过本资产管理计划资产净值的 20%。

本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。

(六) 资产管理计划管理期限

本集合计划管理期限为 10 年固定期限。"

**变更为：**

"(五) 资产管理计划投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

#### 2、主要投资方向

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购、债券借贷业务。

(1) 固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、二级资本债、次级债、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和其他金融监督管理部门主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、优先级资产支持票据等投资品种、超过 7 天的债券逆回购。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别（若无主体评级则取债项评级，若无债项评级则取主体评级）。短期融资券、超短期融资券发行人主体评级不得低于 AA，短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于 A-1。资产支持证券债项评级不得低于 AA。

(2) 现金类资产：包括货币市场基金、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。

(3) 衍生品类资产：信用联结票据。

(4) 本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。

### 3、投资比例

(1) 固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的 80%-100%；衍生品类资产占本集合计划资产总值的 0-20%。

.....

本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。

### (六) 资产管理计划的存续期限

本集合计划管理期限为 10 年固定期限。"

#### 新增：

#### "(十一) 资产管理计划的费用

##### 1、认购费/参与费

本集合计划参与费/认购费为 0.00%。

##### 2、托管费

本集合计划托管费为 0.030%/年。

##### 3、管理费

本集合计划管理费为 0.700%/年。

##### 4、退出费

本集合计划退出费为 0.00%。

##### 5、业绩报酬

对年化收益率超过业绩报酬计提基准以上的部分提取 60%作为管理人的业绩报酬，剩余部分作为超额收益分配给委托人。

##### 6、其他费用

包括但不限于证券交易费用、审计费、本集合计划成立后的证券账户开户费、信息披露费用、会计师费、律师费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用。"

### 七、资产管理合同"六、资产管理计划的募集"中：

#### 原：

"(一) 资产管理计划的募集对象、募集方式和募集期限

### 3、募集期限

本集合计划的募集期限由管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 天。管理人有权根据本集合计划销售的实际情况按照相关程序延长或缩短初始销售期，此类变更适用于所有募集机构。延长或缩短募集期的相关信息将及时发布通知，即视为履行完毕延长或缩短募集期的程序。

#### (二) 资产管理计划的认购事项

#### 4、初始销售期间投资者资金的管理及利息处理方式

销售机构应当将计划初始销售期间投资者的资金存入募集结算资金专用账户，在计划初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。本集合计划成立前，认购款在募集结算资金专用账户产生的利息将折算为计划份额归委托人所有，利息金额以实际账户结息利率计息。利息金额在募集结算资金专用账户实际结息后折算为计划份额归委托人所有。"

#### 变更为：

" (一) 资产管理计划的募集对象、募集方式和募集期限

### 3、募集期限

本集合计划的募集期限由管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 个自然日。管理人有权根据本集合计划销售的实际情况按照相关程序延长或缩短初始销售期，此类变更适用于所有募集机构。延长或缩短募集期的相关信息将及时发布通知，即视为履行完毕延长或缩短募集期的程序。

#### (二) 资产管理计划的认购事项

#### 4、初始销售期间投资者资金的管理及利息处理方式

销售机构应当将计划初始销售期间投资者的资金存入募集结算资金专用账户，在计划初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。本集合计划成立前，认购款在募集结算资金专用账户产生的利息将折算为计划份额归委托人所有，利息金额以银行同期活期存款利率计息。利息金额在募集结算资金专用账户实际结息后折算为计划份额归委托人所有。"

### 八、资产管理合同"七、资产管理计划的成立与备案"中：

#### 原：

" (一) 资产管理计划成立的条件

本集合计划的募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定，初始募集规模（不含认购费）不低于 1000.00 万元，投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人。本集合计划的募集金额全部划入本集合计划托管账户后，管理人应在十个工作日内公告资产管理计划成立。"



**变更为：**

"（一）资产管理计划成立的条件

本集合计划的募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定，初始募集规模（不含认购费）不低于 1000.00 万元，投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人。管理人应当自资产管理计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，公告资产管理计划成立。"

**新增：**

"本集合计划若无法完成备案，管理人应当及时告知投资者，并按照合同约定履行终止清算程序。"

**九、资产管理合同"八、资产管理计划的参与、退出与转让"中：**

**原：**

"（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认

③退出款项划付

投资者的退出申请确认后，退出款项将在 T+5 日内从托管账户划出，T+8 个交易日日内到账。

（十六）自有资金参与集合计划

2、自有资金参与的金额和比例

管理人以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 20%，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超过本集合计划总份额的 50%。为应对巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合资产管理计划可以在履行内部审批程序并符合证监会其他规定的情况下，适当提高自有资金参与比例，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。具体参与比例以管理人公告为准。"

**变更为：**

"（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认

③退出款项划付

投资者的退出申请确认后，退出款项将在 T+5 日内从托管账户划出，T+8 个交易日日内到账。

本集合计划向投资者支付的受托资金及收益应当返回其参与本集合计划时使用的结算账户或者同名账户。

（十六）自有资金参与集合计划

## 2、自有资金参与的金额和比例

管理人以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 20%，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超过本集合计划总份额的 50%。为应对本集合计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出本集合计划可不受“1、自有资金参与及退出的条件”和“2、自有资金参与的金额和比例”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报告。”

## 十、资产管理合同“十一、资产管理计划的投资”中：

原：

### ”（二）投资范围及比例

#### 1、投资范围

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等标准化债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。

（1）固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债、金融机构次级债）、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和银保监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型公募基金。

（2）现金类资产：包括货币市场基金、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。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别（若无主体评级则取债项评级，若无债项评级则取主体评级）。短期融资券、超短期融资券发行人主体评级不得低于 AA，短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于 A-1。资产支持证券债项评级不得低于 AA，仅能投资资产支持证券优先级，且不得投资于将资管产品或其收益权/受益权作为底层资产的资产支持证券，投向非公开定向债务融资工具及资产支持证券占计划上一日资产总值的合计比例不得高于 40%。

（3）本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。

#### 2、资产配置比例及限制

（1）固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的 80%-100%。”

.....

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超过本资产管理计划资产净值的 20%。

本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。”

**变更为：**

”（二）投资范围及比例

1、投资范围

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购、债券借贷业务。

（1）固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、二级资本债、次级债、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和其他金融监督管理部门主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、优先级资产支持票据等投资品种、超过 7 天的债券逆回购。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别（若无主体评级则取债项评级，若无债项评级则取主体评级）。短期融资券、超短期融资券发行人主体评级不得低于 AA，短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于 A-1。资产支持证券债项评级不得低于 AA。

（2）现金类资产：包括货币市场基金、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。

（3）衍生品类资产：信用联结票据。

（4）本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。

2、资产配置比例及限制

（1）固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的 80%-100%；衍生品类资产占本集合计划资产总值的 0-20%。

.....

本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。”

**新增：**

”（5）信用衍生品投资策略

本计划按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。本计划将审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时，

本计划将加强投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理。”

#### 十一、资产管理合同“十四、利益冲突及关联交易”中：

原：

“②资产管理产品的重大关联交易包括：

a、投资交易对手或投资标的为产品关联方，且单笔结算金额达到 2000（不含）万元人民币以上，且占该资产管理计划上一日资产净值的比例达到 20%（不含）以上的，构成重大关联交易。前述交易不包括以下情形：”

变更为：

“②资产管理产品的重大关联交易包括：

投资交易对手或投资标的为产品关联方，且单笔结算金额占该资产管理计划上一日资产净值的比例达到 20%（不含）以上的，构成重大关联交易。”

#### 十二、资产管理合同“十五、投资经理的指定与变更”中：

投资经理由：

“姚佳，首创证券资产管理事业部固定收益投资部投资经理、总经理助理，精算学学士。偏向挖掘价值洼地与捕捉交易性机会相结合，具有丰富的投资交易经验。2015 年加入国融证券股份有限公司，历任债券交易员、投资总监助理、投资顾问授权代表，2019 年加入首创证券股份有限公司，担任资产管理事业部固定收益投资部投资经理，负责资管产品的资产配置、流动性管理和投后跟踪工作。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

李苏航，首创证券资产管理事业部固定收益投资部副总经理（主持工作）、投资经理，英国朴茨茅斯大学学士，英国兰卡斯特大学金融硕士，CFA Level III Candidates。擅长把握个券投资机会，对量化分析及大类资产配置有较为深入认识。2018 年加入首创证券资产管理事业部历任职固定收益交易员、投资经理助理，负责资管产品的资产配置、流动性管理。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

唐慧宏，首创证券资产管理事业部固定收益投资部投资经理，中国人民大学经济学硕士。2020 年加入首创证券资产管理事业部，历任资产管理事业部固定收益投资部交易员、投资经理助理，现任资产管理事业部固定收益投资部投资经理。擅长在市场上挖掘固定收益投资机会，具有丰富的固定收益产品投资配置、流动性管理经验。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。”

**变更为：**

"姚佳，首创证券资产管理事业部固定收益投资部投资经理、总经理助理，精算学学士。偏向挖掘价值洼地与捕捉交易性机会相结合，具有丰富的投资交易经验。2015年加入国融证券股份有限公司，历任债券交易员、投资总监助理、投资顾问授权代表，2019年加入首创证券股份有限公司，担任资产管理事业部固定收益投资部投资经理，负责资管产品的资产配置、流动性管理和投后跟踪工作。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。"

李苏航，首创证券资产管理事业部固定收益投资部总经理、投资经理，英国朴茨茅斯大学学士，英国兰卡斯特大学金融硕士，CFA Level III Candidates。擅长把握个券投资机会，对量化分析及大类资产配置有较为深入认识。2018年加入首创证券资产管理事业部，负责资管产品的资产配置、流动性管理。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。"

**十三、资产管理合同"十六、资产管理计划的财产"中：**

**原：**

"（一）集合计划财产的保管与处分

1、集合计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

2、集合计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人和托管人不得将集合计划财产归入其固有财产。

3、集合计划管理人、托管人因集合计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入集合计划财产。

4、集合计划管理人、托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对集合计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，集合计划财产不属于其清算财产。

5、集合计划财产产生的债权不得与不属于集合计划财产本身的债务相互抵销。非因集合计划财产本身承担的债务，集合计划管理人、集合计划托管人不得主张其债权人对集合计划财产强制执行。上述债权人对集合计划财产主张权利时，集合计划管理人、集合计划托管人应明确告知集合计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

（二）集合计划财产相关账户的开立和管理



1、集合计划管理人或托管人按照规定开立集合计划财产的托管资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。证券账户和期货账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。开立的上述集合计划财产账户与集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划代销机构和集合计划份额登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。

2、集合计划托管人以本集合计划的名义在商业银行开立集合计划的托管资金账户。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付集合计划收益，均需通过本集合计划的托管资金账户进行。本托管资金账户仅限于本集合计划使用，仅限于满足开展本集合计划业务的需要。

3、证券账户、期货账户以及集合计划投资运作有关的其他账户由集合计划管理人与集合计划托管人协商后办理。集合计划管理人和集合计划托管人不得随意假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户。如集合计划投资运作有关的其他账户是由集合计划管理人负责开立的，集合计划管理人应保证该账户专款专用，并聘请资金监管机构对该账户的资金划付进行监管。相应的投资回款及收益，也由集合计划管理人负责及时原路划回托管资金账户，已聘请资金监管机构的，集合计划管理人应配合资金监管机构完成投资回款的划付。集合计划管理人开立此类账户后需及时通知集合计划托管人。

托管人按照规定开立集合计划财产的托管账户及其他投资所需账户，管理人应给予必要的配合。 ”

#### **变更为：**

##### **”（一）资产管理计划财产的保管与处分**

1、本集合计划财产为信托财产，其债务由资产管理计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。

2、本集合计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人和托管人不得将本集合计划财产归入其固有财产。因为管理人投资产生的存放或存管在托管人以外机构的受托财产，由相应的保管机构承担保管职责，管理人应审慎选择保管机构。

3、管理人、托管人因本集合计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入本集合计划财产。

4、管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，本集合计划财产不属于其清算财产。

5、管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对本集合计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

6、本集合计划财产产生的债权不得与不属于本集合计划财产本身的债务相互抵销。非因本集合计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对本集合计划财产强制执行。上述债权人对本集合计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知本集合计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

7、资产托管人对在其开立的资金账户内的资金负有保管职责。因资产管理人投资运作注册登记在中国结算和银行间市场登记结算机构以外机构的证券,以及在资产托管人以外开立的银行账户内的资金,由资产托管人保管资产管理人提供的相关凭证,资产管理人对该凭证的真实性、合法性、有效性、完整性负责;实际存管在交易对手、中介机构等其他机构的证券和存放在资产托管人以外银行账户内的资金,对该等证券或资金的任何损失,资产管理人承担相关责任。

8、资产托管人未经资产管理人的指令,不得自行运用、处分、分配资产管理计划财产的任何资产(不包含资产托管人依据中国结算数据完成场内交易交收、托管资产开户银行或交易/登记结算机构扣收交易费、结算费和账户维护费等费用)。

9、对于因为资产管理计划财产投资产生的应收资产,应由资产管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知资产托管人,到账日应收资产没有到达本集合计划的,资产托管人应及时通知资产管理人采取措施进行催收,由此给资产管理计划财产造成损失的,资产管理人应负责向有关当事人追偿损失。

## (二) 资产管理计划财产相关账户的开立和管理

资产托管人按照有关规定开立资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户,投资者和资产管理人应当在开户过程中给予必要的配合,并提供所需资料。

### 1、托管资金账户

账户的开设与管理由资产托管人根据管理人的书面委托,按照相关法律、法规规定和有关业务规则办理。托管资金账户名称应为本资产管理计划的名称,账户预留印鉴为“广发银行股份有限公司资产托管业务专用章”以及资产管理人法人或授权人名章1枚。资产托管人应及时将有关托管资金账户的开通信息通知管理人。本合同终止日起,托管人应协助管理人尽快办理托管账户等账户的销户事宜。管理人不得将托管账户挪作他用。

### 2、交易所证券账户

资产托管人或资产管理人根据中国结算的规定为本资产管理计划开设证券账户。证券账户的开户费由资产管理人在本资产管理计划起始运作后,向资产托管人发送划款指令。账户注销时,在遵守中国结算的相关规定下,由资产管理人和资产托管人协商确认主要办理人,由其负责注销本计划项下的证券账户。账户注销期间,主要办理人如需另一方提供配合的,另一方应予以配合。

### 3、银行间市场相关账户

《资产管理合同》生效后,资产管理人负责以资产管理计划的名义申请并取得进入全国银行间同业拆借市场的交易资格,并代表资产管理计划进行交易;资产托管人根据中国人民银行、银行间市场登记结算机构的有关规定,在银行间市场登记结算机构开立债券账户和资金结算账户,并代表资产管理计划进行银行间市场债券的结算。

### 4、场外开放式基金账户

场外开放式基金账户由资产管理人根据基金公司要求填写相关资料后开立。资产管理人应指定托管资金账户作为开放式基金交易及回款的唯一结算账户。资产管理人应及时将开放式基金账户的信息发送资产托管人。

5、资产管理人投资期货之前，应与资产托管人、期货公司三方共同就期货开户、清算、估值、交收、费用等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。

#### 6、其他事项

以上相关账户的开立和使用，仅限于满足本资产管理计划投资需要，资产管理人、资产托管人两方均不得出借和转让，亦不得使用上述账户从事本合同规定以外的活动。

其它暂未涉及的账户之管理参照上述规定，未尽事宜届时另行商处。

集合计划账户、专用交易单元应由集合计划管理人报证券交易所、证券登记结算机构备案，管理人将按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。”

### 十四、资产管理合同"十七、投资指令的发送、确认和执行"中：

原：

#### "（一）交易清算授权

1、计划管理人应当事先向计划托管人发出书面授权通知，向计划托管人提供指令的预留印鉴样本和签字样本，并在授权通知上载明计划管理人有权发送指令的人员名单及联系方式。计划管理人应指定至少两名以上的有权发送指令人员。

2、计划管理人向计划托管人发出的授权通知应加盖公章。计划托管人在收到授权通知后以约定方式确认。授权通知在托管人确认后才可生效。

3、计划管理人和计划托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向有权发送指令人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

#### （二）投资指令的内容

1、指令包括计划管理人在运作计划资产时，向计划托管人发出的书面划款指令或其他双方一致认可形式的划款指令，包括付款指令（含退出、收益分配付款指令）及其他资金划拨指令等。

2、计划管理人发给计划托管人的指令应写明款项事由、支付时间、收款人开户银行、金额、收款人账户名称、账号等要素信息，加盖预留印鉴并由被授权人签字。

#### （三）投资指令的发送、确认和执行

##### 1、指令的发送

（1）指令需有授权通知确定的预留印鉴和签字，并由有权发送指令人员在指令上签字后，代表计划管理人用深证通或托管网银电子指令方式向托管人发送，

传真和邮件为备份方式。管理人以上述方式发送指令后需及时与托管人进行电话或其他双方一致认可的方式确认。

(2) 计划托管人应指定专人接收计划管理人的指令，并预先通知计划管理人接收人名单和联系方式。

## 2、指令的确认

(1) 计划托管人在接收指令时，应对指令是否由有权发送指令人员发送、指令的要素是否齐全、指令印鉴与签字是否与预留的授权文件内容相符进行审慎验证，查验后以电话形式或其他双方一致认可的方式向发送指令人员确认，如发现问题，应及时通知管理人。经确认的指令，计划管理人不得否认其效力，但如果计划管理人已经撤销或更改对有权签署、发送指令人员的授权，并且通知计划托管人，经托管人确认，则对于此后该类相关人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，计划管理人不承担责任。

(2) 计划托管人可以要求计划管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保计划托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

(3) 计划托管人收到划款指令后，应根据本协议约定，审核计划管理人的划款指令。计划托管人对划款指令以及计划管理人提交的与划款指令相关的所有材料进行审核。

计划托管人应对下列内容进行审核：

一是划款指令要素、印鉴和签名是否正确完整；

二是划款指令金额与指令附件投资协议等证明文件中约定的投资金额一致。

三是划款指令中的收款账户信息与指令附件投资协议等证明文件中约定的收款账户信息一致（若有）。若指令附件投资协议未约定收款账户信息的，划款指令中的收款户名应与本协议约定的投资方向一致。

(4) 计划管理人向计划托管人出具投资指令时，须提供相关投资证明材料。上述材料应加盖计划管理人印章。

计划管理人应保证以上所提供的作为划款依据的文件资料的真实、有效、完整、准确、合法，没有任何重大遗漏或误导；计划托管人对指令及文件资料的真实性和有效性不作实质性判断。

## 3、指令的执行

(1) 计划托管人确认指令有效后，方可执行指令。

(2) 计划托管人在复核后应在规定期限内执行适当的指令，不得延误。指令执行完毕后，计划托管人应通知计划管理人。计划托管人发现计划管理人的指令违反法律法规规定或者集合资产管理合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并向证券公司住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。



(3) 相关登记结算机构向计划托管人发送的结算通知视为计划管理人向计划托管人发出的有效指令，计划托管人应予以执行。

#### 4、执行中相关问题的处理方法

(1) 计划管理人下达的指令必须要素齐全，词语准确，计划管理人下达的指令要素不全或语意模糊的，计划托管人有权附注相应的说明后立即将指令退还给计划管理人，要求其重新下达有效的指令。

(2) 计划托管人因故意或重大过失错误执行指令或未及时执行指令，致使本计划资产的利益受到损害，应负赔偿责任。

(3) 计划管理人在发送指令时，应为计划托管人执行指令留出执行指令时所必需的时间。管理人每日的场外投资付款指令应尽力于T-1日传真至托管人。如管理人要求当天某一时点到账，则交易结算指令及其证明材料最迟需提前2个工作小时发送并与托管人进行电话确认。

由于通过上交所固定收益证券综合电子平台达成的私募债券转让，中国证券登记结算公司上海分公司根据证券交易所发送的转让成交结果办理实时逐笔全额结算（RTGS）。RTGS的最终交收时点为T日的16:00分，为保证RTGS交易成功，管理人应于交易T日的15:30之前，将买入私募债券的指令传至托管人。（非担保交收业务联系人）

由于通过深圳综合协议平台的公司债、私募债，结算方式为逐笔全额非担保交收，最终交收时点为T日16:00，因此管理人应于T日15:30分之前向托管人发送非担保交收债券的买入指令。指令及其证明材料传输不及时，未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行，所造成的损失由计划管理人承担。

(4) 对非金融衍生品，计划管理人应确保计划的银行存款账户有足够的资金余额，确保计划的证券账户有足够的证券余额；对金融衍生品，通过操作备忘录的形式另行协商。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指令，托管人可不予执行，由此造成的损失，由计划管理人负责赔偿。

#### (四) 更换投资指令被授权人的程序；

1、计划管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于有权发送指令人员的名单、联系方式的修改，指令上预留印鉴和签字样本的修改等），应当至少提前1个工作日通知计划托管人；修改授权通知的文件应为变更后的完整授权，且由计划管理人加盖公章。计划管理人对变更后的完整授权应当以传真的形式或其他双方一致认可的方式发送给计划托管人，同时电话通知计划托管人。计划管理人对授权通知的内容的修改自计划托管人电话确认后生效，计划管理人在应在此后三个工作日内将对授权通知修改的文件原件送交计划托管人。

2、计划托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式，应至少提前1个工作日以传真方式或其他双方一致认可的方式发送计划管理人。计划托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式自计划管理人电话确认后生效。

#### (五) 投资指令的保管

投资指令由管理人保存20年以上。”



变更为：

#### ”（一）交易清算授权

本合同签署生效后，资产管理人应向资产托管人提供《授权代表签字与印鉴样本通知书》（以下简称“授权文件”），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，并规定资产管理人向资产托管人发送指令时资产托管人确认被授权人身份的方法，授权文件应加盖单位公章。

资产托管人在收到授权文件原件并经资产管理人电话或其他双方认可的方式确认后，授权文件即生效。如果授权文件中载明具体生效时间的，该生效时间不得早于资产托管人收到授权文件并经电话确认的时点。如早于，则以资产托管人收到授权文件并经电话或其他双方认可的方式确认的时点为授权文件的生效时间。

资产管理人和资产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必要操作人员以外的任何人泄露。但法律法规规定或有权机关要求的除外。

#### （二）投资指令的内容

投资指令是资产管理人在运用资产管理计划财产时，向资产托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。资产管理人发给资产托管人的指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、收付款账户信息等，按授权文件加盖预留印鉴并由被授权人签字。

#### （三）投资指令的发送、确认及执行时间与程序

指令由被授权人代表资产管理人用传真的方式或其他资产托管人和资产管理人协商一致的方式向资产托管人发送。资产管理人有义务在发送指令后及时与资产托管人进行电话确认，对于因资产管理人未能及时与资产托管人进行指令确认，致使资金未能及时划拨所造成的损失，资产管理人承担责任。资产托管人依照授权文件规定的方法确认指令有效后，方可执行指令。对于被授权人发出的指令，资产管理人不得否认其效力。资产管理人应按照有关法律法规和本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，被授权人应按照其授权权限发送划款指令。

资产管理人尽量于划款前1个工作日向资产托管人发送指令并确认。对于要求当天到账的指令，必须在当天15:30前向资产托管人发送，15:30之后发送的，资产托管人尽力执行，但不能保证划账成功。如果要求当天某一时点到账的指令，则指令需要至少提前2个工作小时发送，并且相关付款条件已经具备，资产托管人视付款条件具备时为指令送达时间。对新股申购网下发行业务，资产管理人应在网下申购缴款日（T日）的前一工作日下午下班前将指令发送给资产托管人，指令发送时间最迟不应晚于T日上午10:00。对于中国结算实行T+0非担保交收的业务，资产管理人应在交易日14:00前将划款指令发送至资产托管人。因资产管理人指令传输不及时，致使资金未能及时划入中国结算指定交收账户所造成的损失由资产管理人承担。包括赔偿在该市场引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用结算参与人最低备付金带来的利息损失。资产管理人应确保资产托管人在执行指

令时，托管资金账户有足够的资金余额，在资金头寸充足的情况下，资产托管人对资产管理人符合法律法规、本合同要求的指令不得拖延或拒绝执行。

资产托管人收到资产管理人发送的指令后，应立即审慎验证指令的要素是否齐全，并将指令所载签字和印鉴与授权通知进行相符性检查及权限范围核对。资产管理人的划款指令应与相关合同或文件一起交付给资产托管人，资产托管人仅对划款指令及相关合同或文件按照以下方式进行审核：

①划款指令要素（限于日期、金额、收付款账户名称、账号、用途）是否齐全；

②划款指令上加盖的印鉴（包括电子印鉴）名称和被授权人签字（或印章）（如有）的名称与授权书中的预留印鉴名称和被授权人签字（或印章）（如有）的名称是否一致；

③划款指令及相关合同或文件指向的交易内容符合本合同的约定。

资产托管人按照以上内容复核无误后应在规定期限内执行，不得延误。

（四）资产托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序；

若资产托管人发现资产管理人的指令违反本合同约定的，有权拒绝执行，立即通知资产管理人。

（五）资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

资产管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息，指令中重要信息模糊不清或不全等。

资产托管人发现资产管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知资产管理人改正。如需撤销指令，资产管理人应按照托管人认可的方式进行撤销。

（六）更换投资指令被授权人的程序

资产管理人更换被授权人、更改或终止对被授权人的授权，应立即将新的授权文件以传真或电子邮件方式通知资产托管人，并经资产管理人电话或其他双方认可的方式确认后生效，原授权文件同时废止。新的授权文件在传真或电子邮件发出后五个工作日内送达文件正本。新的授权文件生效之后，正本送达之前，资产托管人按照新的授权文件传真件或电子邮件内容执行有关业务，如果新的授权文件正本与传真件或电子邮件内容不同，由此产生的责任由资产管理人承担。资产托管人更换接受资产管理人指令的人员，应提前通过电话或其他双方认可的方式通知资产管理人。

（七）投资指令的保管

投资指令原件由资产管理人负责保管；资产托管人保管已收到的投资指令传真件或电子邮件。若原件与传真件或电子邮件不一致，以资产托管人收到的传真件或电子邮件为准，由此产生的责任由资产管理人承担。

（八）其他事项

资产管理人应在银行间交易成交后，及时将通知单、相关文件及划款指令加盖印章后发至资产托管人并电话确认，由资产托管人完成后台交易匹配及资金交收事宜。如果银行间结算系统已经生成的交易需要取消或终止，资产管理人要书面通知资产托管人。经资产管理人与资产托管人协商一致，且由资产管理人出具书面委托后，资产管理人可授权资产托管人根据外汇交易中心发送的成交数据，在中债综合业务平台或上海清算所综合业务系统自行完成交易确认操作。

本计划财产在证券交易所场内交易的资金清算交割，由资产托管人通过中国结算上海分公司/深圳分公司/北京分公司及清算代理银行办理。资产托管人视中国结算向其发送的清算数据为有效指令，无须资产管理人向资产托管人另行出具划款指令。

本计划财产参与未上市债券，资产管理人应代表本计划财产与对手方签署相关合同或协议，明确约定债券过户具体事宜。否则，资产管理人需对所参与债券的过户事宜承担相应责任。

本计划财产资金账户发生的银行结算费用等银行费用，由资产托管人直接从资金账户中扣划，无须资产管理人出具划款指令。"

## 十五、资产管理合同"十九、资产管理计划的估值和会计核算"中：

原：

### "7、估值方法

#### (1) 证券投资基金估值方法

持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的每万份收益计算。

持有的场内债券型公募基金，按交易所的收盘价估值；持有的场外债券型公募基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的单位净值计算。

在任何情况下，资产管理人如采用本项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

.....

(5) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，管理人可根据具体情况制定估值方法，并将估值方法提供给托管人进行估值。如管理人认为上述估值方法不合适，可就相关估值方法进行修改，并将修改后的方法提前通知托管人进行估值。

#### (二) 集合计划的会计政策

5、本集合计划独立建账、独立核算；"

变更为：

## "7、估值方法及其调整

### (1) 证券投资基金估值方法

持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的每万份收益计算。

在任何情况下，资产管理人如采用本项规定的方法对受托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项规定的方法对受托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

.....

⑤债券借贷按实际借贷费率在借贷期限内逐日计提应收或应付借贷费用，对于通过债券借贷交易融出的标的债券，融出期间标的债券按该债券原有估值方法进行估值。

(5) 对证券交易所或银行间市场上交易的凭证类信用衍生品，对于存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应当对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应当采用估值技术确定其公允价值。

(6) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，管理人可与托管人商议后根据具体情况制定估值方法，并将估值方法提供给托管人进行估值。如管理人认为上述估值方法不合适，与托管人商议后可就相关估值方法进行修改，并将修改后的方法提前通知托管人进行估值。

### (二) 集合计划的会计政策

5、本集合计划单独建账、单独核算；"

## 十六、资产管理合同"二十、资产管理计划的费用与税收"中：

原：

"(二) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

### 1、管理人管理费计提和支付

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费率为0.70%/年。计算方法如下：

### 3、业绩报酬的计提和支付

#### (1) 管理人收取业绩报酬的原则

①本集合计划对投资者持有的集合计划份额进行业绩报酬计提；

②同一投资者不同时间多次参与集合计划，本集合计划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；



③在符合业绩报酬计提条件时，在集合计划分红日、投资者退出日和集合计划终止日计提业绩报酬；管理人从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次；

④在集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除，在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

⑤集合计划分红时，业绩报酬按投资者集合计划分红时持有的份额进行核算。

⑥投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或集合计划终止时持有份额进行核算。

⑦管理人有权于集合计划份额发行前公告业绩报酬计提基准等规则。

⑧业绩报酬提取原则：

1) 当集合计划份额年化收益率  $R \leq$  业绩报酬计提基准  $r$  时，则管理人不得提取业绩报酬；

2) 当集合计划份额年化收益率  $R >$  业绩报酬计提基准  $r$  时，管理人对年化收益率超过业绩报酬计提基准的收益部分收取 60% 作为业绩报酬；

$$F = \max \{ (R - r) \times 60\% \times C \times (N / 365), 0 \}$$

其中：

$$R = [ (PA - PC) / PC* ] \times (365 / N) \times 100\%$$

F：投资者每笔认购/存续期参与集合计划份额应提取的业绩报酬；

R：该笔认购/存续期参与份额的年化收益率；

r：业绩报酬计提基准

PA：本次发生业绩报酬计提日单位累计净值；

PC：上一个发生业绩报酬计提日的单位累计净值；

PC\*：上一个发生业绩报酬计提日的单位净值；

C：投资者每笔认购/存续期参与的集合计划份额在上一个发生业绩报酬计提日的资产净值总额；

N：上一个发生业绩报酬计提日到本次发生业绩报酬计提日的天数。

业绩报酬计提日为本集合计划分红确认日、退出确认日和计划终止确认日。业绩报酬的计提，以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准。上一个业绩报酬计提基准日，如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提，认购所得的份额，以本集合计划成立日份额面值为准；追加所得的份额，以追加申请对应日份额净值为准；委托人退出时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔认购/追加应收的管理人业绩报酬。

## (2) 业绩报酬的支付

每个自然季度起 10 个工作日内或产品终止时，管理人有权全额提取当期计提的业绩报酬（如有），具体以管理人安排和计算为准。支付时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时，支付日期顺延。

业绩报酬的计算和复核由管理人完成。托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。

管理人有权修改业绩报酬计提基准，管理人应于新的业绩报酬计提基准启用前至少三个工作日在管理人指定网站公告。新的业绩报酬计提基准生效后，所有投资者退出时均按照退出时点对应的业绩报酬计提基准，计算整个持有期的业绩



报酬，不同意业绩报酬计提基准变更的投资者可在基准变更生效前的（临时）开放日按原业绩报酬计提基准申请退出。业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的计算使用，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。”

变更为：

”（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

#### 1、管理人管理费计提和支付

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费率为0.700%/年，管理人可通过公告形式下调管理费率。计算方法如下：

#### 3、业绩报酬的计提和支付

##### （1）管理人核算业绩报酬的原则

①本集合计划对投资者持有的集合计划份额进行业绩报酬计提；

②同一投资者不同时间多次参与集合计划，本集合计划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；

③在符合业绩报酬计提条件时，管理人有权在集合计划收益分配日（以管理人公告为准）、投资者退出日和集合计划终止日计提业绩报酬；

④在集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除，在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除；

⑤集合计划分红时，业绩报酬按投资者集合计划分红时持有的份额进行核算；

⑥投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或集合计划终止时持有份额进行核算；

⑦管理人业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，但因投资者退出集合计划提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制；

⑧管理人有权于集合计划份额发行前公告业绩报酬计提基准等规则。

##### （2）业绩报酬的计提方法：

在收益分配基准日和计划终止日，对集合计划中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬；在委托人退出申请日，仅对退出份额中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬。

每笔参与份额以上一业绩报酬核算日到本次业绩报酬核算日的年化收益率，作为计提业绩报酬的依据。若委托人持有计划份额期间，发生业绩报酬计提基准或业绩报酬计提比例调整，需分别计算调整前后不同核算期内的产品年化收益率，并加总计算管理人业绩报酬。

核算期产品年化收益率的计算公式如下：

$$R=(P1-P0) \div P0 \div D \times 365 \times 100\%$$

P1: 本次业绩报酬核算日的累计单位净值;

P0: 上一个业绩报酬核算日的累计单位净值;

P0\*: 上一个业绩报酬核算日的单位净值;

D: 上一个业绩报酬核算日至本次业绩报酬核算日的天数;

R: 年化收益率。

业绩报酬具体计算方法如下:

$$F = \max \{ (R - r) \times N \times C \times (D / 365), 0 \}$$

其中:

F: 针对投资者每笔参与份额核算期内应提取的业绩报酬;

r: 核算期区间对应的业绩报酬计提基准;

C: 投资者每笔参与份额在上一业绩报酬核算日的资产净值总额;

N: 管理人业绩报酬提取比例为 60%;

如上一个业绩报酬核算日不存在, 则为份额注册登记日。

上述管理人业绩报酬计入管理费。

### (3) 业绩报酬的支付

每个自然季度起 10 个工作日内或产品终止时, 管理人有权全额提取当期计提的业绩报酬(如有), 具体以管理人安排和计算为准。支付时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令, 托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时, 支付日期顺延。业绩报酬的计算和复核由管理人完成, 托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。

管理人有权修改业绩报酬计提基准, 管理人应于新的业绩报酬计提基准启用前至少三个工作日在管理人指定网站公告。业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的计算使用, 并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。”

## 十七、资产管理合同“二十一、资产管理计划的收益分配”中:

原:

### “(一) 收益的构成

收益包括本集合计划投资所得债券利息、红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。本集合计划的净收益为本集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。

### (二) 可供分配利润

截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### （三）收益分配原则

1、每一集合计划份额享有同等的收益分配权，若收益分配基准日可供分配利润大于0，管理人可以视情况选择进行收益分配；

2、在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，本集合计划将在开放日进行收益分配，分配比例不超过分配基准日全部可分配收益的100%；

3、集合计划收益分配日的每份额净值减去每份额分红金额后不能低于集合计划份额面值；

4、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案的确定与通知

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，由管理人报告委托人。管理人应在指定网站提前公告收益分配方案。

### （五）收益分配的执行方式

本集合计划分红方式为现金分红。委托人同意遵守登记结算机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制定的规则）。

现金分红形成的收益分配金额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额计入本集合计划资产的损益。”

### 变更为：

#### ”（一）可供分配利润的构成

可供分配利润的构成包括本集合计划投资所得债券利息、红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。本集合计划的净收益为本集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。

#### （二）可供分配利润

截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### （三）收益分配原则

#### 1、收益分配的执行方式

本集合计划分红方式为现金分红。委托人同意遵守登记结算机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制定的规则）。

现金分红形成的收益分配金额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额计入本集合计划资产的损益。

2、每一集合计划份额享有同等的收益分配权，若收益分配基准日可供分配利润大于0，管理人可以视情况选择进行收益分配，收益分配的具体方案以管理人公告为准。

3、在符合有关本集合计划收益分配条件的前提下，由管理人拟定分红方案进行收益分配，分配比例不超过分配基准日全部可分配收益的100%。

4、本集合计划收益分配日的每份额净值减去每份额分红金额后不能低于集合计划份额面值。

5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担。

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### （四）收益分配方案的确定、通知和实施

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，由管理人报告委托人。管理人应在指定网站提前公告收益分配方案。管理人应在收益分配日根据收益分配方案实施收益分配。”

### 十八、资产管理合同“二十二、信息披露与报告”中：

原：

”（三）其他信息披露事项

如发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起五个工作日内向投资者披露。”

变更为：

”（三）其他信息披露事项

如发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起5日内向投资者披露。”

### 十九、资产管理合同“二十三、风险揭示”中：

原：

”（一）本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，但不保证本集合计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本集合计划属于R2投资品种，适合风险识别、评估、承受能力C2及以上的合格投资者。

若销售机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

## （二）市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

### 1、政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

### 2、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

### 3、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

### 4、证券发行公司经营风险

证券发行公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

### 5、购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

### 6、再投资风险

再投资风险是债券持有者在持有期得到的利息收入、到期时得到的本息、出售时得到的资本收益等，用它们来再投资所能实现的报酬可能会低于当初购买该债券的收益率的风险。

## （三）管理风险

在集合资产管理计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不全、对投资工具使用不当等影响集合资产管理计划的收益水平，从而产生风险。

## （四）流动性风险



因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括由于本集合计划在开放期出现投资者大额或巨额退出，致使本集合计划没有足够的现金应付集合计划退出支付的要求所导致的风险。

#### （五）信用风险

集合计划在交易过程中发生交收违约，或者集合计划所投资债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降，造成集合计划资产损失的风险。

#### （六）其他风险

1、管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；

2、管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，可能导致委托资产的损失，从而带来风险；

3、参与失败风险。委托人参与本集合计划，必须足额交款，销售机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到参与申请。如果委托人资金在规定时间内未全额到账，无论到账金额高于、等于或低于本集合计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回委托人账户；

4、设立失败风险。初始募集期结束时，本集合计划受市场环境等影响，募集规模可能未达到法律、法规规定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险；

管理人的责任承担方式：

①以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

②在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

5、突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

（1）本集合计划终止时，资产无法变现的情形；

（2）相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；

（3）交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；

（4）无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

6、金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；

7、操作风险

操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险；

#### 8、技术风险

技术风险是指在集合资产管理各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自证券公司、注册登记机构、证券交易所、托管机构等；

9、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，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

#### 10、税收政策相关风险

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。委托人必须自行缴纳的税收由委托人负责，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。如依据相关法律法规或税务机关的认定，就本集合计划运营过程中发生的增值税等应税行为，管理人需要承担相应纳税义务的，除本集合计划已列明的资产管理业务费用产生的管理费、托管费、业绩报酬等税费由各收款方自行缴纳外，管理人有权以计划财产予以缴纳，且无需事先征得委托人的同意；管理人在向委托人交付相关收益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，委托人应按照管理人通知要求进行缴纳；委托人不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。

#### 11、投资者风险承受能力与本集合计划风险等级不匹配的风险

委托人应按照管理人或者销售机构的要求，真实、准确、完整的提供信息、资料，包括但不限于委托人身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险承受能力、诚信记录和投资偏好等信息，若委托人提供的信息、资料存在虚假、不完整、不准确情形或者上述信息发生变化定期更新不及时，可能导致委托人风险承受能力等级与本集合计划不匹配，最终委托人可能遭受超出其承受能力或被强制退出的风险。

#### 12、反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》《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》《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息，委托人无权知悉，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

#### 13、非居民金融账户涉税信息报送安排相关风险

根据《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送相关信息，管理人、销售机构无义务告知委托人报送安排及报送内容，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

#### 14、关联交易的风险

(1) 对于重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，逐笔征求意见或公告确认的方式征询投资者，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(2) 对于一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的划分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐笔征询并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

15、基于本产品固有风险及管理人的业务或者财产状况的不确定性，存在可能直接导致本金亏损及超过原始本金损失的风险。

16、因管理人的业务或者财产状况具有不确定性，存在影响委托人的判断并进而给委托人带来收益甚至本金亏损等风险。

17、投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，但投资者撤回同意，存在可能导致管理人无法为投资者提供相关产品或服务的风 险。

18、投资者已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险。

19、集合计划的持仓债券存在信用等级波动而使得委托人参与集合计划时集合计划所持仓债券信用评级不符合合同约定信用等级的风险，管理人将按本合同约定及时调整持仓债券，但存在因市场状况或其他原因无法及时调整完毕造成集合计划资产损失的风险。

#### (七) 本集合计划特有风险

##### 1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本集合计划资产管理合同在不违反相关法律法规、不违反《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》和证券投资基金业协会的合同指引及其他有关规定的情况下，根据本集合计划的具体交易安排及实际情况，在投资者利益最大化的原则下，对合同指引规定的内容做了部分更加具体细化的约定，对合同指引规定以外的内容做了部分约定，且对合同指引部分不完全适用于本资管计划的规定做了必要调整（或有），但相关内容的调整（如有）均以不损害投资者利益为基础。投资者应仔细阅读本合同的各项条款，因此产生的或有风险特提示投资者注意。

##### 2、委托人可能无法参与的风险

由于本集合计划设定了初始募集期及存续期的规模上限，管理人将根据合同的约定对本集合计划的规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

##### 3、资产管理计划委托募集所涉风险

本集合计划可能委托除管理人之外的外部销售机构销售，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，但仍可能存在因外部销售机构自身的违法违规行、违反合同约定的操作、技术系统故障或操作差错等原因而损害投资者权益的风险，请投资者知晓。

4、资产管理计划未在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

集合计划成立后，管理人将按照相关法律法规的要求向证券投资基金业协会申请办理计划备案手续，但不能保证一定能办理成功。如本集合计划最终未能在证券投资基金业协会完成备案手续或被不予备案的，本集合计划将按照本合同约定终止清算，由此将影响投资者参与本集合计划的投资目的。

5、合同变更风险

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或委托人疏于及时查看销售机构发布的公告，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集合计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

6、本集合计划公布收益分配方案后，可能存在本集合计划净值浮动等原因导致收益分配日可供实际分配的资金少于收益分配方案公布的分配金额，届时管理人有权对实际分红金额进行适当调整，则委托人存在实际收到的分红金额与收益分配方案不完全相同的风险。

7、本集合计划有一定的封闭期，封闭期内委托人无法退出集合计划；且本集合计划不在交易所上市，委托人无法通过交易所市场公开交易。

8、使用电子签名合同的风险（如有）

如本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。

9、份额转让时可能面临的风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，在条件允许的情况下，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。在办理转让业务时可能出现的风险至少包括：

（1）操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些原因出现故障，从而影响转让业务办理。

（2）折溢价风险

在份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

10、债券正回购投资风险



组合在进行正回购操作时，可能由于回购利率大于债券投资收益以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行正回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对组合造成损失的可能性也就越大。

#### （八）特别提示

本集合计划依法设立，投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件，并确保理解相关条款和业务规则，包括但不限于：

##### 1、提前终止条款

存续期内，持续五个工作日投资者少于二人，导致本集合计划提前终止。

##### 2、强制退出条款

集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30.00 万元。若某笔退出导致该委托人持有的集合计划资产净值低于 30.00 万元，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

##### 3、电子签名信息保护

如委托人签署电子签名合同进行交易的，应积极采取安全措施，加强账户、密码的保护。

##### 4、巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生委托人大量甚至巨额退出集合计划的情形，若出现合同约定的巨额退出，将可能导致集合计划面临流动性风险，增加集合计划所持有证券的变现成本，造成计划资产损失。对于委托人而言，在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。"

#### 变更为：

##### "（一）特殊风险揭示

##### 1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本集合计划资产管理合同在不违反相关法律法规、不违反《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》和证券投资基金业协会的合同指引及其他有关规定的情况下，根据本集合计划的具体交易安排及实际情况，在投资者利益最大化的原则下，对合同指引规定的内容做了部分更加具体细化的约定，对合同指引规定以外的内容做了部分约定，且对合同指引部分不完全适用于本资管计划的规定做了必要调整（或有），但相关内容的调整（如有）均以不损害投资者利益为基础。投资者应仔细阅读本合同的各项条款，因此产生的或有风险特提示投资者注意。

##### 2、委托人可能无法参与的风险



由于本集合计划设定了初始募集期及存续期的规模上限，管理人将根据合同的约定对本集合计划的规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

### 3、资产管理计划委托募集所涉风险

本集合计划可能委托除管理人之外的外部销售机构销售，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，但仍可能存在因外部销售机构自身的违法违规行为、违反合同约定的操作、技术系统故障或操作差错等原因而损害投资者权益的风险，请投资者知晓。

### 4、资产管理计划未在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

集合计划成立后，管理人将按照相关法律法规的要求向证券投资基金业协会申请办理计划备案手续，但不能保证一定能办理成功。如本集合计划最终未能在证券投资基金业协会完成备案手续或被不予备案的，本集合计划将按照本合同约定终止清算，由此将影响投资者参与本集合计划的投资目的。

### 5、合同变更风险

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或委托人疏于及时查看销售机构发布的公告，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集合计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

6、本集合计划公布收益分配方案后，可能存在本集合计划净值浮动等原因导致收益分配日可供实际分配的资金少于收益分配方案公布的分配金额，届时管理人有权对实际分红金额进行适当调整，则委托人存在实际收到的分红金额与收益分配方案不完全相同的风险。

7、本集合计划有一定的封闭期，封闭期内委托人无法退出集合计划；且本集合计划不在交易所上市，委托人无法通过交易所市场公开交易。

### 8、使用电子签名合同的风险（如有）

如本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。

### 9、份额转让时可能面临的风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，在条件允许的情况下，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。在办理转让业务时可能出现的风险至少包括：

#### （1）操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些原因出现故障，从而影响转让业务办理。

## (2) 折溢价风险

在份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

### 10、债券正回购投资风险

组合在进行正回购操作时，可能由于回购利率大于债券投资收益以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行正回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对组合造成损失的可能性也就越大。

### 11、信用联结票据(Credit-Linked Note, CLN)风险

信用联结票据是一种衍生金融工具，它的价值与某个参考信用实体的信用状况挂钩。CLN 允许投资者通过对冲信用风险来获得收益，但也伴随着一系列风险。以下是信用联结票据的一些主要风险：

**信用风险:**CLN 的价值与参考实体的信用状况紧密相关。如果参考实体发生信用事件(如违约)，CLN 的持有人可能会遭受损失。

**市场风险:**CLN 的价格会随着市场对参考实体信用评级的变动而波动。如果市场对某个公司的信用状况信心下降，即使该公司没有发生实际的信用事件，CLN 的价值也可能下降。

**利率风险:**CLN 通常具有固定的利率，因此它们的持有人会受到利率变动的影响。利率上升可能会降低 CLN 的吸引力，因为它们提供的收益率相对于新的投资机会可能会降低。

**流动性风险:**CLN 市场可能不如其他金融工具(如股票或债券)那样活跃，这可能导致投资者在需要时难以以公平的价格买卖 CLN。

**信用利差波动风险:**CLN 的收益依赖于参考实体的信用利差。如果信用利差波动较大，CLN 的价值也会相应波动，这可能导致投资者面临不确定的回报。

**对手方风险:**在一些 CLN 产品中，可能涉及与第三方(如投资银行或对冲基金)的信用交易。如果该对手方违约，投资者可能会遭受损失。

**法律和合规风险:**CIN 的结构可能复杂，涉及多个法律实体和管辖权。这可能导致在某些司法管辖区面临法律挑战或监管问题。

**赎回风险:**一些 CLN 产品可能包含赎回条款，允许发行方在特定条件下提前偿还本金。

这可能会限制投资者的流动性，或者在赎回时提供较低的回报。

### 12、债券借贷的特别风险

债券借贷是指债券借贷双方自主协商约定，由债券借入方以一定数量的债券设定质押。从债券借出方借入标的债券，同时约定在未来特定日期归还标的债券

和支付债券借贷费用，并解除出质债券质押登记的行为。存在除债券投资以外的如下特别风险：

(1) 信用风险或交易对手方风险：在债券借贷中，作为出借方面临的主要风险是借入方无法按时归还借入债券或足额支付借贷费用，尤其是在借入方质押债券突然价格下滑且无法迅速置换质押券时，以及出借方由于持有的质押券过于集中，在信用及不同期限利率风险的冲击下，对手方违约风险将骤然增加。如果借入方违约，出借方将面临标的债券和资金损失。

(2) 流动性风险：当债券借入方违约时，借出方通过卖出、拍卖等方式处置与该交易有关的质押债券，可能面临因质押债券流动性不足而无法及时变现的风险，或者折价变现的资金无法覆盖该笔借贷交易的全部损失。

(3) 利率风险：由于市场利率波动，借入方和出借方都可能在未来遭受因利率变化而导致的机会成本损失。

(4) 声誉风险：债券借贷双方建立了信任关系，并依靠相互合作。如果其中一方声誉受损或遭受财务危机，可能会对另一方造成负面影响

#### (5) 价格波动风险

债券借入方将借入债券进行卖空交易后，如果借入债券价格大幅提升，使得借入方不得不在借贷期限到期前以更高的价格在市场上买入从而达到还券的目的，从而承受期间的价差损失风险。当借入方将借入债券用作质押回购时，如果借入债券市场价格大幅下降，将面临被对手方要求补充质押或提前结束回购业务的情形，最终使得借入方资产流动性下降或融资目的无法达成的风险。

#### (6) 集中度风险

债券借贷业务存在持券过度集中的风险，主要表现在，如果债券借入方大量借入某支债券，如果借入方不进行回购、现券交易或其他结构化交易，则该券的市场活跃度则会受到影响，其他持券主体会受到高集中度的持有主体对该券操作的影响。同时，如果交易主体将借入债券进行市场交易，高集中度会使得融券主体交易风险过于集中，损益幅度增大。

### 13、关联交易的风险

(1) 对于重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，逐笔征求意见或公告确认的方式征询投资者，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(2) 对于一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的划分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐笔征询并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

#### (二) 一般风险揭示

## 1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，但不保证本集合计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本集合计划属于 R2 投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2 及以上的合格投资者。

若销售机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

## 2、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。市场风险主要包括：

### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

### （2）经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

### （3）利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

### （4）证券发行公司经营风险

证券发行公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

### （5）购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

### （6）再投资风险

再投资风险是债券持有者在持有期得到的利息收入、到期时得到的本息、出售时得到的资本收益等，用它们来再投资所能实现的报酬可能会低于当初购买该债券的收益率的风险。

## 3、管理风险



资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产以及投资者承担。

#### 4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或者大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

#### 5、信用风险

因债务人、交易对手或持仓金融头寸的发行人未能按时履约或者信用资质恶化，给资产管理计划带来损失的风险。

#### 6、税收风险

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

#### 7、其他风险

(1) 管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；

(2) 管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，可能导致受托资产的损失，从而带来风险；

(3) 参与失败风险。委托人参与本集合计划，必须足额交款，销售机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到参与申请。如果委托人资金在规定时间内未全额到账，无论到账金额高于、等于或低于本集合计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回委托人账户；

(4) 设立失败风险。初始募集期结束时，本集合计划受市场环境等影响，募集规模可能未达到法律、法规规定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险；

管理人的责任承担方式：

①以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

②在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

(5) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

①本集合计划终止时，资产无法变现的情形；

②相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；

③交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；



④无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

(6) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；

(7) 操作风险

操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险；

(8) 技术风险

技术风险是指在集合资产管理各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自证券公司、注册登记机构、证券交易所、托管机构等；

(9) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

(10) 投资者风险承受能力与本集合计划风险等级不匹配的风险

委托人应按照管理人或者销售机构的要求，真实、准确、完整的提供信息、资料，包括但不限于委托人身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险承受能力、诚信记录和投资偏好等信息，若委托人提供的信息、资料存在虚假、不完整、不准确情形或者上述信息发生变化定期更新不及时，可能导致委托人风险承受能力等级与本集合计划不匹配，最终委托人可能遭受超出其承受能力或被强制退出的风险。

(11) 反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》《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》《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息，委托人无权知悉，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

(12) 非居民金融账户涉税信息报送安排相关风险

根据《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送相关信息，管理人、销售机构无义务告知委托人报送安排及报送内容，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

(13) 基于本产品固有风险及管理人的业务或者财产状况的不确定性，存在可能直接导致本金亏损及超过原始本金损失的风险。

(14) 因管理人的业务或者财产状况具有不确定性，存在影响委托人的判断并进而给委托人带来收益甚至本金亏损等风险。

(15) 投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，但投资者撤回同意，存在可能导致管理人无法为投资者提供相关产品或服务的风​​险。

(16) 投资者已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险。

(17) 集合计划的持仓债券存在信用等级波动而使得委托人参与集合计划时集合计划所持仓债券信用评级不符合合同约定信用等级的风险，管理人将按本合同约定及时调整持仓债券，但存在因市场状况或其他原因无法及时调整完毕造成集合计划资产损失的风险。

## 8、特别提示

本集合计划依法设立，投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件，并确保理解相关条款和业务规则，包括但不限于：

### (1) 提前终止条款

存续期内，持续五个工作日投资者少于二人，导致本集合计划提前终止。

### (2) 强制退出条款

集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30.00 万元。若某笔退出导致该委托人持有的集合计划资产净值低于 30.00 万元，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

### (3) 电子签名信息保护

如委托人签署电子签名合同进行交易的，应积极采取安全措施，加强账户、密码的保护。

### (4) 巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生委托人大量甚至巨额退出集合计划的情形，若出现合同约定的巨额退出，将可能导致集合计划面临流动性风险，增加集合计划所持有证券的变现成本，造成计划资产损失。对于委托人而言，在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。”

## 二十、资产管理合同"二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算"中： 原：

### "（一）合同的变更

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所、基金业协会、证券业协会等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人指定网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律

法规和中国证监会的有关规定,更新或修改的内容在管理人指定网站公告时生效。委托人对更新或修改的内容有异议,可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。临时开放期内,本集合计划不接受任何参与申请。

2、由于其他原因需要变更合同的,管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。委托人不同意变更的,应在征询意见发出后按照约定的开放日或临时开放日提出退出本资产管理计划的申请;委托人未在前述时间回复意见的,视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更的,管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排:委托人不同意变更的,管理人保障其退出资产管理计划的权利;对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本资产管理计划的委托人,管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理。合同变更生效日以管理人公告为准。临时开放期内,本资产管理计划不接受任何参与申请。

委托人同意,无论其是否同意合同变更或提出退出申请,管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

其中,由于其他原因需要变更合同的情形,包括但不限于以下情形:

(1) 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,资产管理计划由其他管理人承接。

(2) 托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,资产管理计划由其他托管人承接。

3、本合同变更后,委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利,履行相应义务。管理人应按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。"

**变更为:**

"(一) 合同的变更

1、全体投资者、管理人和托管人协商一致后,可以对本集合计划合同内容进行变更,本集合计划另有约定的除外。管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的,应在征询意见发出后的下一开放日或管理人设置的合同变更临时开放期内提出退出本资产管理计划的申请;委托人未在规定时间内回复意见的,视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更的,管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排:委托人不同意变更的,管理人保障其退出资产管理计划的权利;对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本资产管理计划的委托人,管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理。合同变更生效日以管理人公告为准。临时开放期内,本资产管理计划不接受任何参与申请。

委托人同意,无论其是否同意合同变更或提出退出申请,管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

需要变更合同的情形包括但不限于以下情形:

(1) 管理人因被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等原因不能履行管理人职责,资产管理计划由其他管理人承接。

(2) 托管人因被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等原因不能履行托管人职责，资产管理计划由其他托管人承接。

2、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所、基金业协会、证券业协会等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人指定网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人指定网站公告时生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。临时开放期内，本集合计划不接受任何参与申请。

3、本合同变更后，委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。管理人应当自资产管理合同变更之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案。”

## 二十一、资产管理合同新增“附件1：交易监控合规表”：

交易监控合规表序号	项目	监控内容
1	监控范围	<p>本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购、债券借贷业务。</p> <p>(1) 固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、二级资本债、次级债、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和其他金融监督管理部门主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、优先级资产支持票据等投资品种、超过7天的债券逆回购。</p> <p>投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在AA及以上级别（若无主体评级则取债项评级，若无债项评级则取主体评级）。短期融资券、超短期融资券发行人主体评级不得低于AA，短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于A-1。资产支持证券债项评级不得低于AA。</p> <p>(2) 现金类资产：包括货币市场基金、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。</p> <p>(3) 衍生品类资产：信用联结票据。</p> <p>(4) 本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。</p>



2	监控比例及限制	<p>(1) 固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的80%-100%；衍生品类资产占本集合计划资产总值的0-20%。</p> <p>(2) 债券逆回购资金余额不超过上一日计划资产净值的100%。</p> <p>(3) 债券正回购资金余额不超过上一日计划资产净值的100%。</p> <p>(4) 本集合计划的总资产不得超过该产品净资产的200%。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，本集合计划的总资产不得超过净资产的120%。本集合计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。</p> <p>(5) 本集合计划参与债券发行申购时，本集合计划所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，本集合计划所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>(6) 本集合计划投资于单一债券的投资金额不得超过债券存续规模的25%，且投资于单一债券的金额（以市值计）不得超过本集合计划资产净值的25%；本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的25%，也不得超过该资产的25%。除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外，本集合计划管理人管理的全部集合资管计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的25%（由管理人自行监控）。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。</p>
---	---------	---

## 二十二、资产管理合同附件"风险揭示书"变更为：

"附件 2：风险揭示书

首创证券创赢增利 2 号

集合资产管理计划

风险揭示书

尊敬的客户：

投资有风险。当您/贵机构参与资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在作出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同等文件，充分认识资产管理计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。

本计划属于 R2 风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2 及以上的合格投资者。根据有关法律法规，首创证券股份有限公司及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：



## 一、管理人声明与承诺

(一) 管理人向投资者声明, 中国证券投资基金业协会(以下简称“协会”)办理资产管理计划备案不作为对资产管理计划财产安全和投资者收益的保证, 也不表明协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。

(二) 管理人保证在投资者签署资产管理合同前已(或已委托销售机构)向投资者揭示了相关风险; 已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和风险承受能力。

(三) 管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用资产管理计划财产, 不保证资产管理计划财产一定盈利, 也不保证最低收益。

## 二、风险揭示

### (一) 特殊风险揭示

#### 1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本集合计划资产管理合同在不违反相关法律法规、不违反《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》和证券投资基金业协会的合同指引及其他有关规定的情况下, 根据本集合计划的具体交易安排及实际情况, 在投资者利益最大化的原则下, 对合同指引规定的内容做了部分更加具体细化的约定, 对合同指引规定以外的内容做了部分约定, 且对合同指引部分不完全适用于本资管计划的规定做了必要调整(或有), 但相关内容的调整(如有)均以不损害投资者利益为基础。投资者应仔细阅读本合同的各项条款, 因此产生的或有风险特提示投资者注意。

#### 2、委托人可能无法参与的风险

由于本集合计划设定了初始募集期及存续期的规模上限, 管理人将根据合同的约定对本集合计划的规模上限进行控制, 因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

#### 3、资产管理计划委托募集所涉风险

本集合计划可能委托除管理人之外的外部销售机构销售, 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, 但仍可能存在因外部销售机构自身的违法违规行为、违反合同约定的操作、技术系统故障或操作差错等原因而损害投资者权益的风险, 请投资者知晓。

#### 4、资产管理计划未在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

集合计划成立后, 管理人将按照相关法律法规的要求向证券投资基金业协会申请办理计划备案手续, 但不能保证一定能办理成功。如本集合计划最终未能在证券投资基金业协会完成备案手续或被不予备案的, 本集合计划将按照本合同约定终止清算, 由此将影响投资者参与本集合计划的投资目的。

#### 5、合同变更风险

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或委托人疏于及时查看销售机构发布的公告，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集合计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

6、本集合计划公布收益分配方案后，可能存在本集合计划净值浮动等原因导致收益分配日可供实际分配的资金少于收益分配方案公布的分配金额，届时管理人有权对实际分红金额进行适当调整，则委托人存在实际收到的分红金额与收益分配方案不完全相同的风险。

7、本集合计划有一定的封闭期，封闭期内委托人无法退出集合计划；且本集合计划不在交易所上市，委托人无法通过交易所市场公开交易。

#### 8、使用电子签名合同的风险（如有）

如本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。

#### 9、份额转让时可能面临的风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，在条件允许的情况下，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。在办理转让业务时可能出现的风险至少包括：

##### （1）操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些原因出现故障，从而影响转让业务办理。

##### （2）折溢价风险

在份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

#### 10、债券正回购投资风险

组合在进行正回购操作时，可能由于回购利率大于债券投资收益以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行正回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对组合造成损失的可能性也就越大。

#### 11、信用联结票据(Credit-Linked Note, CLN) 风险

信用联结票据是一种衍生金融工具，它的价值与某个参考信用实体的信用状况挂钩。CLN 允许投资者通过对冲信用风险来获得收益，但也伴随着一系列风险。以下是信用联结票据的一些主要风险：

信用风险:CLN 的价值与参考实体的信用状况紧密相关。如果参考实体发生信用事件(如违约)，CLN 的持有人可能会遭受损失。

市场风险:CLN 的价格会随着市场对参考实体信用评级的变动而波动。如果市场对某个公司的信用状况信心下降,即使该公司没有发生实际的信用事件,CLN 的价值也可能下降。

利率风险:CLN 通常具有固定的利率,因此它们的持有人会受到利率变动的影响。利率上升可能会降低 CLN 的吸引力,因为它们提供的收益率相对于新的投资机会可能会降低。

流动性风险:CLN 市场可能不如其他金融工具(如股票或债券)那样活跃,这可能导致投资者在需要时难以以公平的价格买卖 CLN。

信用利差波动风险:CLN 的收益依赖于参考实体的信用利差。如果信用利差波动较大,CLN 的价值也会相应波动,这可能导致投资者面临不确定的回报。

对手方风险:在一些 CLN 产品中,可能涉及与第三方(如投资银行或对冲基金)的信用交易。如果该对手方违约,投资者可能会遭受损失。

法律和合规风险:CLN 的结构可能复杂,涉及多个法律实体和管辖权。这可能导致在某些司法管辖区面临法律挑战或监管问题。

赎回风险:一些 CLN 产品可能包含赎回条款,允许发行方在特定条件下提前偿还本金。

这可能会限制投资者的流动性,或者在赎回时提供较低的回报。

## 12、债券借贷的特别风险

债券借贷是指债券借贷双方自主协商约定,由债券借入方以一定数量的债券设定质押。从债券借出方借入标的债券,同时约定在未来特定日期归还标的债券和支付债券借贷费用,并解除出质债券质押登记的行为。存在除债券投资以外的如下特别风险:

(1)信用风险或交易对手方风险:在债券借贷中,作为出借方面临的主要风险是借入方无法按时归还借入债券或足额支付借贷费用,尤其是在借入方质押债券突然价格下滑且无法迅速置换质押券时,以及出借方由于持有的质押券过于集中,在信用及不同期限利率风险的冲击下,对手方违约风险将骤然增加。如果借入方违约,出借方将面临标的债券和资金损失。

(2)流动性风险:当债券借入方违约时,借出方通过卖出、拍卖等方式处置与该交易有关的质押债券,可能面临因质押债券流动性不足而无法及时变现的风险,或者折价变现的资金无法覆盖该笔借贷交易的全部损失。

(3)利率风险:由于市场利率波动,借入方和出借方都可能在未来遭受因利率变化而导致的机会成本损失。

(4)声誉风险:债券借贷双方建立了信任关系,并依靠相互合作。如果其中一方声誉受损或遭受财务危机,可能会对另一方造成负面影响

(5)价格波动风险

债券借入方将借入债券进行卖空交易后，如果借入债券价格大幅提升，使得借入方不得不在借贷期限到期前以更高的价格在市场上买入从而达到还券的目的，从而承受期间的价差损失风险。当借入方将借入债券用作质押回购时，如果借入债券市场价格大幅下降，将面临被对手方要求补充质押或提前结束回购业务的情形，最终使得借入方资产流动性下降或融资目的无法达成的风险。

#### (6) 集中度风险

债券借贷业务存在持券过度集中的风险，主要表现在，如果债券借入方大量借入某支债券，如果借入方不进行回购、现券交易或其他结构化交易，则该券的市场活跃度则会受到影响，其他持券主体会受到高集中度的持有主体对该券操作的影响。同时，如果交易主体将借入债券进行市场交易，高集中度会使得融券主体交易风险过于集中，损益幅度增大。

### 13、关联交易的风险

(1) 对于重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，逐笔征求意见或公告确认的方式征询投资者，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(2) 对于一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的划分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐笔征询并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

#### (二) 一般风险揭示

##### 1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，但不保证本集合计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本集合计划属于 R2 投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2 及以上的合格投资者。

若销售机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

##### 2、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。市场风险主要包括：

#### (1) 政策风险



货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

#### (2) 经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

#### (3) 利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

#### (4) 证券发行公司经营风险

证券发行公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

#### (5) 购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

#### (6) 再投资风险

再投资风险是债券持有者在持有期得到的利息收入、到期时得到的本息、出售时得到的资本收益等，用它们来再投资所能实现的报酬可能会低于当初购买该债券的收益率的风险。

### 3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产以及投资者承担。

### 4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或者大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的的风险。

### 5、信用风险

因债务人、交易对手或持仓金融头寸的发行人未能按时履约或者信用资质恶化，给资产管理计划带来损失的风险。

### 6、税收风险

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

### 7、其他风险



(1) 管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；

(2) 管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，可能导致受托资产的损失，从而带来风险；

(3) 参与失败风险。委托人参与本集合计划，必须足额交款，销售机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到参与申请。如果委托人资金在规定时间内未全额到账，无论到账金额高于、等于或低于本集合计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回委托人账户；

(4) 设立失败风险。初始募集期结束时，本集合计划受市场环境等影响，募集规模可能未达到法律、法规规定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险；

管理人的责任承担方式：

①以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

②在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

(5) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

①本集合计划终止时，资产无法变现的情形；

②相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；

③交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；

④无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

(6) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；

(7) 操作风险

操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险；

(8) 技术风险

技术风险是指在集合资产管理各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自证券公司、注册登记机构、证券交易所、托管机构等；

(9) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

#### (10) 投资者风险承受能力与本集合计划风险等级不匹配的风险

委托人应按照管理人或者销售机构的要求，真实、准确、完整的提供信息、资料，包括但不限于委托人身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险承受能力、诚信记录和投资偏好等信息，若委托人提供的信息、资料存在虚假、不完整、不准确情形或者上述信息发生变化定期更新不及时，可能导致委托人风险承受能力等级与本集合计划不匹配，最终委托人可能遭受超出其承受能力或被强制退出的风险。

#### (11) 反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》《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》《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息，委托人无权知悉，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

#### (12) 非居民金融账户涉税信息报送安排相关风险

根据《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送相关信息，管理人、销售机构无义务告知委托人报送安排及报送内容，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

(13) 基于本产品固有风险及管理人的业务或者财产状况的不确定性，存在可能直接导致本金亏损及超过原始本金损失的风险。

(14) 因管理人的业务或者财产状况具有不确定性，存在影响委托人的判断并进而给委托人带来收益甚至本金亏损等风险。

(15) 投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，但投资者撤回同意，存在可能导致管理人无法为投资者提供相关产品或服务的风险。

(16) 投资者已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险。

(17) 集合计划的持仓债券存在信用等级波动而使得委托人参与集合计划时集合计划所持仓债券信用评级不符合合同约定信用等级的风险，管理人将按本合同约定及时调整持仓债券，但存在因市场状况或其他原因无法及时调整完毕造成集合计划资产损失的风险。

### 8、特别提示

本集合计划依法设立，投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件，并确保理解相关条款和业务规则，包括但不限于：

#### (1) 提前终止条款

存续期内，持续五个工作日投资者少于二人，导致本集合计划提前终止。

## (2) 强制退出条款

集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30.00 万元。若某笔退出导致该委托人持有的集合计划资产净值低于 30.00 万元，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

## (3) 电子签名信息保护

如委托人签署电子签名合同进行交易的，应积极采取安全措施，加强账户、密码的保护。

## (4) 巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生委托人大量甚至巨额退出集合计划的情形，若出现合同约定的巨额退出，将可能导致集合计划面临流动性风险，增加集合计划所持有证券的变现成本，造成计划资产损失。对于委托人而言，在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。

## 三、投资者声明与承诺

作为本计划的投资者，本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，自愿自行承担投资该计划所面临的风险。本人/机构作出以下陈述和声明，并确认（自然人投资者在每段段尾“【           】”内签名，机构投资者在本页、尾页盖章，加盖骑缝章）其内容的真实和正确：

1. 本人/机构已仔细阅读资产管理业务相关法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本计划运作方式及风险收益特征，愿意承担由上述风险引致的全部后果。【           】

2. 本人/机构知晓，管理人、销售机构、托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产的收益状况作出任何承诺或担保。【           】

3. 本人/机构符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关合格投资者的要求，并已按照管理人或销售机构的要求提供相关证明文件。【           】

4. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【           】

5. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“当事人及权利义务”章节的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【           】

6. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“资产管理计划的投资”章节的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【           】

7. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“资产管理计划的费用与税收”章节中的所有内容。【           】

8. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“争议的处理”章节中的所有内容。【           】

9. 本人/机构已经配合管理人或其销售机构提供了法律法规规定的信息资料及身份证明文件，以配合上述机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查以及反洗钱等监管规定的工作。

本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效。

【            】

10. 本人/机构知晓，中国证券投资基金业协会为资产管理计划办理备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。【            】

11. 本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构购买（参与）资产管理计划。

【            】

12. 本人/机构承诺不以非法拆分转让为目的购买资产管理计划，不会突破合格投资者标准，将资产管理计划份额或其收益权进行非法拆分转让。【            】

13. 本人/机构知悉本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。【            】

本人承诺已仔细的、完整的阅读上述所有陈述与声明，并在此签字确认：

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

管理人（盖章）：

日期：

销售机构经办人（签字）[集合资产管理计划适用]：

日期： "

若产品合同变更条款涉及到托管协议、风险揭示书和计划说明书，对应一并修改。

首创证券股份有限公司  
2024年07月22日