

关于中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划 法律文件变更提示公告

尊敬的委托人：

感谢您长期以来对中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划（“本集合计划”）的支持。经与托管人中国工商银行股份有限公司广州协商一致，管理人中国国际金融股份有限公司拟对《中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称《管理合同》）、《中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）及《中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书》（以下简称《风险揭示书》）的有关内容进行变更（以下简称“本次变更”），现征询委托人意见。

本次变更的详细内容请见附件，《说明书》《风险揭示书》的变更内容同《管理合同》变更内容。

委托人不同意本次变更的，应在 2024 年 8 月 30 日提交退出申请，管理人将按照《管理合同》的规定为其办理集合计划份额退出；委托人在上述期限内未回复意见或未提出退出申请的（包括书面回复不同意合同变更但未提出退出申请的），视为委托人同意本次变更。

本次变更将于 2024 年 8 月 31 日起生效。届时，管理人将通过管理人网站公告变更后的《管理合同》。同意本次变更的委托人无需就本次变更与管理人、托管人另行签署变更后的《管理合同》，经管理人公告的本次法律文件变更内容自本次变更生效时起自动成为变更后合同的组成部分。

中金公司将就本次法律文件变更及时发布后续公告，敬请关注。为使您及时获取相关信息，如您在购买网点留存的联系电话、通讯地址不完整或发生变更，请及时致电我们变更您的客户资料。

感谢您的支持与配合！如有疑问，可咨询中金集合计划客服热线：

8008108802（固话免费） 010-65050105（直线）

特此公告。

附件：《管理合同》变更明细表

中国国际金融股份有限公司
2024 年 8 月 29 日

附件：《中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》变更明细表：

变更前	变更后
封面	
中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划 资产管理合同 合同编号：中金资管集合 2022-ZJFR-01 管理人：中国国际金融股份有限公司 托管人：中国工商银行股份有限公司广州分行 二〇二二年七月	中金福睿 1 号 FOF 集合资产管理计划 资产管理合同 合同编号：中金资管集合 2022-ZJFR-02 管理人：中国国际金融股份有限公司 托管人：中国工商银行股份有限公司广州分行 二〇二四年四月
三、集合资产管理合同当事人	
管理人：中国国际金融股份有限公司 注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 联系地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 法定代表人：沈如军 邮政编码：100004 联系电话：010-65051166	管理人：中国国际金融股份有限公司 注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 联系地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层 法定代表人：陈亮 邮政编码：100004 联系电话：010-65051166
四、集合计划的基本情况 （五）投资范围和投资比例	
1、投资范围 （1）金融产品（以下或简称“金融产品”或“子产品”）：包括公募证券投资基金（含 QDII 基金、ETF）、基金公司及其子公司资产管理计划、证券公司集合资产管理计划（含比照公募基金管理的集合资产管理产品）、期货公司资产管理计划、保险资产管理计划、证券投资集合资金信托计划（前述资管计划及信托计划须由托管人或保管人托管或保管）、中国证券投资基金业协会备案的并由具有基金托管业务资质或综合托管业务资质的托管人进行托管的私募证券投资基金（若本计划认购处于募集期的私募证券投资基金，可不受事前备案之限但应在该私募证券投资基金募集完毕后向基金业协会备案。）等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会认可的其他投资品种。本计划所投资金融产品不得投资除公募证券投资基金以外的资产管理产品。 （2）现金类资产：包括货币市场基金、	1、投资范围 （1）金融产品（以下或简称“金融产品”或“子产品”）：包括公募证券投资基金（含 QDII 基金、ETF）、基金公司及其子公司资产管理计划、证券公司集合资产管理计划（含比照公募基金管理的集合资产管理产品）、期货公司资产管理计划、保险资产管理计划、证券投资集合资金信托计划（前述资管计划及信托计划须由托管人或保管人托管或保管）、中国证券投资基金业协会备案的并由具有基金托管业务资质或综合托管业务资质的托管人进行托管的私募证券投资基金（若本计划认购处于募集期的私募证券投资基金，可不受事前备案之限但应在该私募证券投资基金募集完毕后向基金业协会备案。）等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会认可的其他投资品种。本计划所投资金融产品不得投资除公募证券投资基金以外的资产管理产品。 （2）现金类资产：包括货币市场基金、

同业存单、债券逆回购、银行存款和现金； (3) 在证券交易所或银行间市场交易的债券、资产支持证券（票据）优先级、非公开定向债务融资工具（PPN）、交易所非公开发行债券及交易所和银行间债券正回购； (4) A 股股票（含科创板股票）、港股通标的的股票； (5) 股指期货、国债期货、场内股票期权和商品期货。 本计划可能参与债券正回购。 涉及期权，ETF、LOF 基金（除总行清算模式下二级市场买卖以外的交易行为）投资，需经托管人确认后才能进行相关交易。 2、资产配置比例 因证券市场波动、投资对象合并、集合资产管理计划规模变动等非管理人主观因素致使集合资产管理计划的组合投资不符合《集合资产管理合同》约定的，管理人将在超标品种可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整至符合要求。委托人知悉并认可，托管人在其交易监督系统可监测范围内进行投资监督，托管人的交易监督义务以法律法规、《投资交易监督事项表》（模板见附件一）为准。资产管理人、资产托管人应以邮件、函件等各方认可的方式确定《投资交易监督事项表》（模板见附件一），且达成一致意见，如拟调整托管人投资监督的范围，管理人与托管人协议一致后更改。《投资交易监督事项表》启用或变更的前 3 个工作日内，由资产管理人将《投资交易监督事项表》以邮件、函件等各方认可的方式发送至托管人，管理人以邮件、公告等形式告知全体委托人。	同业存单、债券逆回购、银行存款和现金； (3) 在证券交易所或银行间市场交易的债券、资产支持证券（票据）优先级、非公开定向债务融资工具（PPN）、交易所非公开发行债券及交易所和银行间债券正回购； (4) A 股股票（含科创板股票）、港股通标的的股票； (5) 股指期货、国债期货、场内股票期权和商品期货。 本计划可能参与债券正回购。 2、资产配置比例 因证券市场波动、投资对象合并、集合资产管理计划规模变动等非管理人主观因素致使集合资产管理计划的组合投资不符合《集合资产管理合同》约定的，管理人将在超标品种可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合要求。委托人知悉并认可，托管人在其交易监督系统可监测范围内进行投资监督，托管人的交易监督义务以法律法规、《投资交易监督事项表》（模板见附件一）为准。资产管理人、资产托管人应以邮件、函件等各方认可的方式确定《投资交易监督事项表》（模板见附件一），且达成一致意见，如拟调整托管人投资监督的范围，管理人与托管人协议一致后更改。《投资交易监督事项表》启用或变更的前 3 个工作日内，由资产管理人将《投资交易监督事项表》以邮件、函件等各方认可的方式发送至托管人，管理人以邮件、公告等形式告知全体委托人。
六、管理人以自有资金参与本集合计划	
管理人有权以自有资金参与本集合计划，但管理人并无义务以自有资金参与本集合计划。管理人自有资金参与份额（如有）与其他份额享有同等权益、承担同等风险。管理人自有资金参与份额（如有）不承担任何风险补偿责任，与其他份额持有人持有的集合计划份额享有同等权益、承担同等风险。 1、自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定。	管理人有权以自有资金参与本集合计划，但管理人并无义务以自有资金参与本集合计划。管理人自有资金参与份额（如有）与其他份额享有同等权益、承担同等风险。管理人自有资金参与份额（如有）不承担任何风险补偿责任，与其他份额持有人持有的同类集合计划份额享有同等权益、承担同等风险。 1、自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

2、自有资金的参与方式：管理人在初始募集期和存续期均可以自有资金参与本集合计划。 3、自有资金参与的金额和比例：管理人自有资金参与本集合计划份额不超过本集合计划总份额的 16%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本集合计划总份额的 50%。因集合计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与本集合计划份额被动超过集合计划总份额的 16%，或管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计超过本集合计划总份额的 50%时，管理人有权为自有资金退出设置临时开放期，按照自有资金或其自有资金和附属机构自有资金份额的超额情况，退出或督促其附属机构退出超过上述限制部分的参与份额。 4、自有资金退出的条件：除本合同另有约定外，管理人自有资金参与份额（如有）与其他份额同样办理退出业务。 5、集合计划存续期内，管理人自有资金参与份额（如有）的持有期限不得少于 6 个月，但发生上述第 3 项约定的管理人及其附属机构自有资金参与份额比例被动超额导致退出的情况除外。管理人有多笔自有资金参与的，按照“先进先出”原则计算管理人自有资金参与份额的持有期限。除本合同另有约定外，管理人以自有资金在集合计划存续期内参与、退出时应当提前 5 个工作日告知份额持有人和托管人。为应对集合计划巨额退出以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，管理人自有资金参与、退出可不受上述第 3 条及本条限制，但应当及时告知份额持有人和托管人，并向相关派出机构及基金业协会报告。	2、自有资金的参与方式：在满足法规规定的条件下，管理人在初始募集期和存续期均可以自有资金参与本集合计划。 3、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份额不超过本集合计划总份额的 16%。管理人及其关联机构（关联机构可能包括管理人的子公司、孙公司、母公司、母公司控制的其他子公司，具体范围以监管要求为准）以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本集合计划总份额的 50%。 因集合计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与本集合计划份额被动超过集合计划总份额的 16%，或管理人及其关联机构以自有资金参与本集合计划的份额合计超过本集合计划总份额的 50%时，管理人有权按照其自有资金或关联机构自有资金份额的超额情况，退出或督促其关联机构退出超过上述限制部分的参与份额。 4、自有资金退出的条件：除本合同另有约定外，管理人自有资金参与份额（如有）与其他份额同样办理退出业务。 5、集合计划存续期内，管理人自有资金参与份额（如有）的持有期限不得少于 6 个月。但发生本部分第 3 项约定的自有资金参与份额比例被动超额导致退出及第 7 项约定的为应对集合计划巨额退出以解决流动性风险而退出等的情况除外。管理人有多笔自有资金参与的，按照“先进先出”原则计算管理人自有资金参与份额的持有期限。 6、在本集合计划初始募集期，管理人及其关联机构可能以自有资金参与本集合计划，投资者、托管人签署本合同即视为同意管理人及其关联机构可以以自有资金在募集期参与，管理人将以募集公告或其他约定披露方式提前告知份额持有人和托管人；在本集合计划存续期，管理人及其关联机构以自有资金参与或退出的，管理人与托管人可以首先就该等事项达成一致，并至少提前 5 个工作日以管理人网站公告或其他约定披露方式向份额持有人披露相关信息，如份额持有人对该等事项有异议，可以在管理人设置的临时开放期申请退出集合计划份额，但不因此影响自有资金参与或退出的效力。份额持有
--	---

	人未在临时开放期退出本集合计划的，即视为同意相关安排。 发生本部分第 3 项约定的自有资金参与份额比例被动超额导致退出及第 7 项约定的为应对集合计划巨额退出以解决流动性风险而参与或退出的情况，可不受本条约定限制，但应在自有资金参与或退出后及时告知份额持有人及托管人。 7、为应对集合计划巨额退出以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，管理人及其关联机构自有资金参与、退出可不受上述第 3 条、第 5 条及第 6 条限制，但应当及时告知份额持有人和托管人，并向中国证监会相关派出机构等有权机构报告。
十、集合计划账户与资产	
(一) 集合计划帐户的开立 … … 托管人为本集合计划开立证券账户，证券账户名称以实际开立账户名称为准。证券账户由托管人开户的，管理人需协助提供证券开户费划款凭证截图和相关开户资料。销户时，由托管人办理证券账户销户的，管理人协助提供证券账户销户相关资料。定期存单应由托管人保管，要留托管人预留印鉴，托管人保管定期存单，定期存单当面移交，到期后资金必须划回托管账户。存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押、并不得用于背书转让。	(一) 集合计划帐户的开立 … … 管理人为本集合计划开立证券账户，证券账户名称以实际开立账户名称为准。定期存单应由托管人保管，要留托管人预留印鉴，托管人保管定期存单，定期存单当面移交，到期后资金必须划回托管账户。存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押、并不得用于背书转让。
十二、集合计划的资产估值	
(六) 估值日 本集合计划成立后，存续期内每个沪、深交易所交易日日为估值日，T+1 日计算 T 日净值。 (七) 估值方法 下文列示出所有产品的估值方法，并非表示本计划将必然进行该类产品投资。本计	(六) 估值日 估值日是指资产管理计划份额净值和资产管理计划累计净值的归属日，本资产管理计划的估值日为相关证券交易场所的交易日以及国家法律法规规定需要对外披露本资产管理计划净值的非交易日。管理人于本资产管理计划成立后的每个估值日(T 日)后第一个工作日(T+1 日)对该估值日(T 日)的资产管理计划财产进行估值，管理人与托管人于 T+1 日进行核对，但管理人根据法律法规的规定或本合同约定暂停估值时除外。 (七) 估值方法 下文列示出所有产品的估值方法，并非表示本计划将必然进行该类产品投资。本计

划的投资范围以“四、集合计划的基本情况”“（四）投资范围和投资比例”“1、投资范围”为准。 1、银行存款和债券回购以成本估值并按其商定利率在持有期内逐日计提利息。 2、对于投资的基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司资产管理计划、期货资产管理计划、保险资产管理计划、信托计划、私募基金等金融产品以最近公布的单位份额净值估值。如果该产品不公布单位份额净值，则以基金管理人和基金托管人协商一致的方法进行估值。 3、非上市基金： 非货币市场基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF））以估值日基金份额净值估值，估值日基金份额净值未公布的，以前最近一个交易日基金份额净值估值。 货币市场基金按基金管理公司公布的前一估值日至估值日期间（含节假日）的每万份收益计提每日货币基金收益。 4、场内的基金以估值日该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近一日收盘价计算。 5、上市流通股票的估值 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。 港股通股票估值方法按照交易所、登记公司、监管机构公布准则执行，估值汇率使用人行汇率中间价。 6、未上市股票的估值 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的	划的投资范围以“四、集合计划的基本情况”“（四）投资范围和投资比例”“1、投资范围”为准。 1、银行存款和债券回购以成本列示并按其商定利率在持有期内逐日计提利息。 2、私募证券投资基金、资产管理计划的估值 （1）定期提供份额净值的私募证券投资基金、资产管理计划 A.对于合同约定不收取业绩报酬的私募证券投资基金、资产管理计划，按估值日的产品份额净值进行估值，估值日的产品份额净值于估值日后第一个工作日 17:30 前仍未提供的，以前最近一个估值日份额净值估值。 B.对于合同约定收取业绩报酬的私募证券投资基金、资产管理计划，如果私募证券投资基金、资产管理计划的管理人或授权第三方机构可提供虚拟份额净值（即剔除业绩报酬后的份额净值），则按估值日的产品虚拟份额净值进行估值，估值日的产品虚拟份额净值于估值日后第一个工作日 17:30 前仍未提供的，以前最近一个估值日虚拟份额净值估值。如果私募证券投资基金、资产管理计划的管理人或授权第三方机构不提供虚拟份额净值、只提供份额净值的，按估值日的产品份额净值进行估值，估值日的产品份额净值于估值日后第一个工作日 17:30 前仍未提供的，以前最近一个估值日份额净值估值。 C.由于上述私募证券投资基金、资产管理计划的管理人或授权第三方机构提供的份额净值（含虚拟份额净值）不准确等原因造成的估值错误，损失由本集合计划财产承担，本计划管理人和托管人予以免责。 （2）不提供份额净值的私募证券投资基金、资产管理计划 A. 第三方估值机构提供估值价格的，选取第三方估值机构提供的估值价格进行估值。 B. 第三方估值机构未提供估值价格的，采用估值技术确定公允价值。 （3）针对私募证券投资基金、资产管理计划的认购、申购、赎回、份额强增强减、分红除权、计提业绩报酬等行为，应根据私募证券投资基金、资产管理计划的管理人或授权
---	--

情况下,按成本估值。

发行时明确一定期限限售期的股票(包括但不限于非公开发行有明确锁定期的股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售部分、通过大宗交易取得的带限售期的股票等)按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

7、债券估值

A、对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种(本合同另有规定的除外),选取第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的相应品种当日的估值净价进行估值;交易所上市或挂牌转让的实行全价交易的债券,选取第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的相应品种当日估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。交易所公开发行上市交易的可转换债券除外。

B、交易所公开发行上市交易的可转换债券,按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,选取最近交易日债券收盘价;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

C、首次公开发行未上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

D、全国银行间市场交易的固定收益品种,选取第三方估值机构(中债金融估值中心有限公司)提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市,且第三方估值机构(中债金融估值中心有限公司)未提供估值价格的债券,采用估值技术确定其公允价值。

E、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

8、上市流通衍生品(如股指期货、国债期货和商品期货合约,以及交易所交易的期权等)以交易所估值日公布的结算价确定公

第三方机构提供的确认单及时进行确认。如私募证券投资基金、资产管理计划的基金管理人或授权第三方机构于估值日后第一个工作日 17:30 前仍未提供确认日为估值日的确认单,则在其提供确认单时进行确认,并不再追溯调整估值日的会计处理。若由此造成估值错误,损失由本集合计划财产承担,本计划管理人和托管人予以免责。3、公开募集证券投资基金的估值

(1)非上市基金,如所投资基金披露份额净值,则按所投资基金估值日的份额净值估值;如所投资基金披露万份(百份)收益,则按所投资基金前一估值日至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益。

(2)交易所上市基金的估值。

A.交易所上市的基金(上市开放式基金(LOF)除外)以估值日该证券收盘价估值。

B.上市开放式基金(LOF),按所投资基金估值日的份额净值估值。

(3)如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况,根据以下原则进行估值:以所投资基金的基金份额净值估值的,若所投资基金未公布估值日基金份额净值,按其最近公布的基金份额净值为基础估值;以所投资基金的收盘价估值的,若估值日无交易,且最近交易日后市场环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后市场环境发生了重大变化的,由管理人和托管人协商确定公允价值;如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分,应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。4、上市流通股票的估值

上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

港股通股票估值方法按照交易所、登记公司、监管机构公布准则执行,估值汇率使用

允价值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,以最近交易日的结算价估值。

9、未尽事项参照相关规定或者行业惯例进行。

10、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的,管理人可根据具体情况,在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上,在与托管人商议后,按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。管理人应在新的估值方法实施前3个工作日在管理人网站通告委托人。

11、如有新增事项或变更事项,按国家最新规定估值。

12、暂停估值的情形:集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其他原因暂停营业,或集合计划所投资的金融产品暂停估值或估值出现错误或重大问题,或占投资组合较大比例的投资品种暂停估值或估值出现错误或重大问题致使集合计划管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值,或当前一估值日占本集合计划资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性并经与托管人协商确认,或因其他任何不可抗力致使管理人无法准确评估集合计划资产价值时,可暂停估值。但估值条件恢复时,管理人必须按规定完成估值工作。

人行汇率中间价。

5、未上市股票的估值

送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在交易所挂牌的同一股票的收盘价估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

首次发行未上市的股票,如果发行日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用发行价作为公允价值的最佳估计;已发生影响公允价值计量重大事件的,应采用估值技术确定公允价值。发行时明确一定期限限售期的股票(包括但不限于非公开发行有明确锁定期的股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售部分、通过大宗交易取得的带限售期的股票等)按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

6、债券估值

A、对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种(本合同另有规定的除外),选取第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的相应品种当日的估值净价进行估值;交易所上市或挂牌转让的实行全价交易的债券,选取第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的相应品种当日估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。交易所公开发行上市交易的可转换债券除外。

B、交易所公开发行上市交易的可转换债券,按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,选取最近交易日债券收盘价;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

C、首次发行未上市,且第三方估值机构(中证指数有限公司)未提供估值价格的交

	易所债券,采用发行价格估值,已发生影响公允价值计量重大事件的,应采用估值技术确定其公允价值。 D、全国银行间市场交易的固定收益品种,选取第三方估值机构(中债金融估值中心有限公司)提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市,且第三方估值机构(中债金融估值中心有限公司)未提供估值价格的债券,采用估值技术确定其公允价值。 E、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。 7、上市流通衍生品(如股指期货、国债期货和商品期货合约,以及交易所交易的期权等)以交易所估值日公布的结算价确定公允价值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,以最近交易日的结算价估值。 8、未尽事项参照相关规定或者行业惯例进行。 9、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的,管理人可根据具体情况,在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上,在与托管人商议后,按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。管理人应在新的估值方法实施前3个工作日在管理人网站通告委托人。 10、如有新增事项或变更事项,按国家最新规定估值。 11、暂停估值的情形:集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其他原因暂停营业,或集合计划所投资的金融产品暂停估值或估值出现错误或重大问题,或占投资组合较大比例的投资品种暂停估值或估值出现错误或重大问题致使集合计划管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值,或当前一估值日占本集合计划资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性并经与托管人协商确认,或因其他任何不可抗力致使管理人无法准确评估集合计划资产价值时,可暂停估值。但估值条件恢复时,管理人必须按规定完成估值工作。
--	---

十三、集合计划费用和税收	
(二)费用计提标准、计提方法和支付方式 8、集合计划的税收 本集合计划运作过程中，各类纳税主体依照国家法律法规的规定履行纳税义务。 根据相关法律法规的要求，自 2018 年 1 月 1 日或税务主管机关确定的其他日期起，资产管理产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资产管理产品管理人为增值税纳税义务人。委托人应承担本计划运营过程中由于上述原因产生的增值税及附加税费，以及因税款未及时划付至管理人账户导致管理人未能在规定纳税期限内足额缴纳税款而产生的滞纳金、罚款等支出。 如本合同确定的托管费为含税价格，在合同履行期间，如遇国家税率调整，资产托管人有权根据国家税率变化调整本合同约定价格，但应按照本合同约定的合同变更流程执行。	(二)费用计提标准、计提方法和支付方式 8、集合计划的税收 本集合计划运作过程中，各类纳税主体依照国家法律法规的规定履行纳税义务。 根据相关法律法规的要求，自 2018 年 1 月 1 日或税务主管机关确定的其他日期起，资产管理产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资产管理产品管理人为增值税纳税义务人。委托人应承担本计划运营过程中由于上述原因产生的增值税及附加税费，以及因税款未及时划付至管理人账户导致管理人未能在规定纳税期限内足额缴纳税款而产生的滞纳金、罚款等支出。 如本合同确定的托管费为含税价格，在合同履行期间，如遇国家税率调整，资产托管人有权根据国家税率变化调整本合同约定价格，但应按照本合同约定的合同变更流程执行。如果管理人以固有财产先行垫付上述增值税等税费的，管理人有权优先从委托财产中划扣抵偿。本计划清算后若管理人被税务机关要求补缴应由委托财产承担的上述税费的，则管理人有权向投资者就补缴金额进行追偿。
十四、集合计划的收益分配	
(四)收益分配原则 3、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；	(四)收益分配原则 (删除)
十七、投资指令的发送、确认和执行	
(三)指令的发送、确认及执行 2、管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，管理人应提前两小时向托管人发送指令时，为托管人留出执行指令所必需的时间。因管理人指令传输不及时，致使指令未能及时执行或资金未能及时划入中登公司所造成的直接损失由管理人承担，包括赔偿在深圳市场引起其他托管客户交易失败、赔偿因占用中登深圳公司最低备付金带来的利息损失。	(三)指令的发送、确认及执行 2、管理人应按照相关法律法规以及本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，管理人应提前两小时向托管人发送指令时，为托管人留出执行指令所必需的时间。因管理人指令传输不及时，致使指令未能及时执行或资金未能及时划入中登公司所造成的直接损失由管理人承担。
十八、投资限制及禁止行为	
(一)投资限制 4、按市值计算，本集合计划投资于同一	(一)投资限制 4、按市值计算，本集合计划投资于同一

资产的资金不得超过本集合计划资产净值的25%，银行活期存款、国债、中央银行票据、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；	资产的资金不得超过本集合计划资产净值的25%，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%；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；
十九、利益冲突及关联交易	
(一) 本集合计划存在或可能存在的利益冲突情形 1、全体份额持有人充分知悉并认可，管理人可能运用集合计划财产进行关联交易，包括但不限于： (1) 运用集合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承销期内承销的证券。 (2) 运用集合计划财产与管理人及子公司、管理人及子公司设立或担任投资顾问的金融产品进行对手方交易（包括但不限于现券交易、回购交易等）。 (3) 投资于管理人及其关联方发行、担任管理人或担任投资顾问或代理销售或提供托管（或综合托管）和/或基金业务外包服务业务的或提供其他服务的金融产品。 全体份额持有人知悉并确认，虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的关联交易风险，进而可能影响份额持有人的利益。份额持有人知悉并接受关联交易风险。全体份额持有人特此同意并授权管理人在管理运用本集合计划财产时可进行上述投资交易，管理人根据上述授权进行投资交易时，无需事先取得份额持有人的同意。 2、全体份额持有人充分知悉并理解，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能仍会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其	(一) 本集合计划存在或可能存在的利益冲突情形 1、关联方的范围 管理人或托管人的关联方，是指管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人、与其有重大利害关系的公司或其他关联方。管理人的关联方以最近一期上市公司披露年报为基础，结合《公司法》和《企业会计准则》的规定确定，托管人的关联方名单以托管人定期披露或最近一期年报公布的关联方名单为准。 2、关联交易 关联交易是指本计划与关联方进行的交易，包括但不限于：运用本计划资产投资于管理人、托管人及其关联方发行的证券或承销期内承销的证券；运用本计划资产投资于管理人及其关联方设立的金融产品，或管理人担任投资顾问的金融产品，或通过管理人及其关联方代销渠道认购/申购金融产品；运用本计划资产与管理人及其关联方、管理人及其关联方设立的金融产品，或管理人担任投资顾问的金融产品进行对手方交易；本计划接受管理人及其关联方发行的债券作为债券逆回购的质押券；本计划与管理人及其关联方作为交易对手进行债券逆回购交易；以及其他导致本计划与关联方之间利益转移的活动。 其中： (1) 重大关联交易是指至少符合如下情形之一的关联交易：1) 将本计划委托财产投资于管理人、托管人及其关联方发行的或承销期内承销的证券；2) 关联交易单笔交易金额达到或超过本计划净资产的5%。 (2) 一般关联交易是指除上述重大关联交易以外的其他关联交易。 上述关联交易范围与最新法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求不一

他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划,也可能使本计划在投资运作时暂时受限,进而可能会影响收益甚至发生损失等。全体份额持有人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

此外,管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资,该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为,或者在买卖同一只证券的时间上存在先后,不排除可能影响或限制本计划的投资运作。全体份额持有人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

(二) 利益冲突的处理和披露

1、管理人运用集合计划财产进行上述第(一)款第1项所列投资交易的,应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定的投资目标、投资策略,并遵循份额持有人利益优先原则,防范利益冲突。

2、管理人运用集合计划财产进行上述第(一)款第1项所列投资交易的,交易前无需另行取得份额持有人的同意或通知份额持有人。在交易完成后的合理时间内,管理人应将交易的情况书面通知托管人,并通过管理人的网站公告或合同约定的其他方式告知份额持有人。如果法律法规、监管规定、自律组织规则及交易所规则等要求管理人就上述投资交易向监管机构、基金业协会或交易所等有权机构报告或备案,管理人按相关规定办理。

致的,以届时适用的法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求为准。

3、管理人、托管人及相关从业人员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。

4、全体份额持有人充分知悉并理解,尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合,本计划在投资和运作过程中可能仍会存在一些利益冲突情形,包括但不限于:管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突;管理人管理的其他资管产品(包括本计划投资经理管理的其他资管产品)基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为,或者在买卖同一只证券的时间上存在先后;其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划,也可能使本计划在投资运作时暂时受限,进而可能会影响收益甚至发生损失等。此外,管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资,该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为,或者在买卖同一只证券的时间上存在先后,不排除可能影响或限制本计划的投资运作。

(二) 利益冲突的处理和披露

1、管理人运用集合计划财产进行上述第(一)款第2项所列投资交易的,应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定的投资目标、投资策略,并遵循份额持有人利益优先原则,防范利益冲突。

2、管理人应当建立健全关联交易的内部审批机制和评估机制,本资产管理计划从事关联交易,管理人应事先履行公司内部审批流程,由投资经理发起申请,经投资总监审批后方可执行。

3、关联交易的处理和披露

管理人运用集合计划财产进行上述一般关联交易的,交易前无需另行取得份额持有人的同意或通知份额持有人。全体份额持有人知悉并确认,份额持有人签署本合同即视为已授权管理人可进行上述一般关联交易且无需另行征得份额持有人同意。虽然管理人

	积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定操作、积极防范利益冲突,但依然不能避免未来可能发生的关联交易风险,进而可能影响份额持有人的利益。份额持有人知悉并接受关联交易风险。在交易完成后的合理时间内,管理人应将交易的情况书面通知托管人,并通过管理人的网站公告或合同约定的其他方式告知份额持有人。 管理人运用本计划财产进行上述重大关联交易的,交易前将以公告方式向份额持有人披露具体关联交易的情况并设置临时开放期供不同意的份额持有人退出,不同意的份额持有人应在临时开放期内申请退出,如份额持有人在临时开放期内未申请退出的(包括回复不同意但未提出退出申请或未明确回复意见的)视为同意。在每笔交易完成后的合理时间内,管理人应将关联交易的情况书面通知份额持有人和托管人。 如果法律法规、监管规定、自律组织规则及交易所规则等要求管理人就上述投资交易向监管机构、基金业协会或交易所等有权机构报告或备案,管理人按相关规定办理。
二十、集合计划信息披露	
(二) 集合计划成立后信息披露的内容和时间 (1) 集合计划份额净值报告 披露时间: 本集合计划成立后,封闭期内至少每周披露一次单位净值、累计净值。如在封闭期内分红,于分红登记日的一个工作日后披露分红登记日的份额净值、累计净值。开放期内,管理人应当在【T+2】日披露集合计划T日的单位净值、累计净值。	(二) 集合计划成立后信息披露的内容和时间 (1) 集合计划份额净值报告 披露时间: 本集合计划成立后,封闭期内至少每周披露一次单位净值、累计净值。开放期内,管理人应当在【T+2】日披露集合计划T日的单位净值、累计净值。
二十六、风险揭示	
(七) 本集合计划特有风险 11、关联交易风险 本集合计划管理人有权将委托资产投资于管理人及其关联方发行或承销期内承销的证券、管理人及其关联方发行、担任管理人或担任投资顾问或代理销售或提供托管(或综合托管)和/或基金业务外包服务业务的或提供其他服务的金融产品,或进行其他重大关联交易。 虽然管理人积极遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规	(七) 本集合计划特有风险 11、关联交易风险 管理人对与托管人有关的关联交易的监控受限于托管人提供或公开披露的关联方名单及关联证券名单的真实性、准确性、全面性和及时性,如托管人未能提供或公开披露关联方名单及关联证券名单的,管理人将无法监控与托管人有关的关联交易,无法向投资者、托管人进行披露。 管理人根据资产管理合同约定从事关联交易的,虽然管理人将依照恪尽职守、诚实信

定进行操作、积极防范利益冲突,但仍可能因管理人运用集合计划资产从事关联交易被监管部门认为存在重大风险,且管理人无法确保选择进行关联交易的实际交易结果(就投资结束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,进而可能影响集合计划份额持有人的利益。此外,管理人运用集合计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使,进而可能影响集合计划份额持有人的利益。此外,若将来法律、行政法规及中国证监会的规定对于集合计划的关联交易做出新的监管要求的,本集合计划将按照届时最新的监管要求进行调整,该等调整可能会对集合计划的投资收益造成影响。	用、谨慎勤勉的原则按照市场公允定价进行公平交易,但仍可能存在被监管层否定的政策风险和相应的关联交易风险。此外,管理人运用集合计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使,进而可能影响集合计划份额持有人的利益。此外,若将来法律、行政法规及中国证监会及基金业协会的相关规定对于集合计划的关联交易做出新的监管要求的,本计划将参照届时最新的监管要求执行,该等操作可能会对集合计划的投资收益造成影响。 特别地,由于管理人已通过本合同取得了份额持有人对一般关联交易的概括授权,因此管理人运用集合计划财产进行本合同约定的一般关联交易的,不会在交易前逐笔取得份额持有人的同意,也不会交易前逐笔通知份额持有人,但会在交易后合理时间内将一段时间内的一般关联交易情况通知份额持有人。上述安排导致份额持有人无法在交易前获知一般关联交易的情况、也无法决定管理人是否进行某笔一般关联交易的风险。在管理人进行一般关联交易时,虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定操作、积极防范利益冲突,但依然不能避免一般关联交易可能发生的投资损失。份额持有人知悉并接受上述一般关联交易的授权模式及其风险。 管理人运用本计划财产进行上述重大关联交易的,交易前将以公告方式向份额持有人披露具体关联交易的情况并设置临时开放期供不同意的份额持有人退出,不同意的份额持有人应在临时开放期内申请退出,如份额持有人在临时开放期内未申请退出的(包括回复不同意但未提出退出申请或未明确回复意见的)视为同意。虽然管理人积极遵循份额持有人利益优先和平等自愿、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突,但该等仍可能因管理人运用集合计划资产从事关联交易被监管部门认为存在重大风险,且管理人无法确保选择进行关联交易的实际交易结果(就投资结束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,进而可能影响集合计划份额持有人
--	--

12、投资标的风险 (2) 投资于金融产品的特有风险 本集合计划投资于公募基金产品，此类产品可能由于其管理人的投资失误、买入标的市场表现不佳、风险控制失效等原因造成产品净值的下降，从而造成本资产管理计划净值的下降，最终导致委托人资产损失。此类产品的管理人的管理能力、投资水平、信用状况等因素及相关托管人的资质与信用等因素都可能影响此类产品的收益、盈亏，从而导致本计划的收益、盈亏受到影响。此类金融产品间接投资与证券市场，证券市场价格因受各种因素的影响而引起波动，从而间接影响本集合计划的业绩。包括但不限于如下风险： (无)	的利益。 12、投资标的风险 (2) 投资于金融产品的特有风险 (2) 投资于金融产品的特有风险 本集合计划投资于公募基金、基金公司资产管理计划、证券公司集合资产管理计划、期货公司资产管理计划、保险资产管理计划、信托计划、私募基金等产品，此类产品可能由于其管理人的投资失误、买入标的市场表现不佳、风险控制失效等原因造成产品净值的下降，从而造成本资产管理计划净值的下降，最终导致委托人资产损失。此类产品的管理人的管理能力、投资水平、信用状况等因素及相关托管人的资质与信用等因素都可能影响此类产品的收益、盈亏，从而导致本计划的收益、盈亏受到影响。此类金融产品间接投资与证券市场，证券市场价格因受各种因素的影响而引起波动，从而间接影响本集合计划的业绩。包括但不限于如下风险： 17、混合类产品的特定风险 本产品属于混合类产品，投资于债权类资产(现金或银行活期存款除外)的比例低于资产管理计划总资产 80%(不含)；投资于权益类资产的比例低于资产管理计划总资产 80%(不含)；投资于期货和衍生品的持仓合约价值低于资产管理计划的 80%(不含)，或衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产 20%。集合计划面临投资于债权类、权益类和期货和衍生品类资产的一般风险和特殊风险，且将随着各类资产配置比例的变化而变化，在某类资产占比更大时，本计划的风险将更多受该类资产影响。
二十九、其他事项	
(三) 反商业贿赂 合同一方向其他方承诺并保证，在本合同的签署及履行过程中，其自身应当，并应促使其为履行本合同的工作人员严格遵守法律法规、行业自律规则、社会公德、商业道德、职业道德和行为规范，不得以任何直接或间接的方式贿赂另一方的任何人员和/或与该等人员具有利益关系的人员，不得以任何方式直接或间接提供或索取回扣、佣金等不正当财物、利益或机会，不得以任何方式从事其	(三) 反商业贿赂 合同一方向其他方承诺并保证，在本合同的签署及履行过程中，其自身应当，并应促使其为履行本合同的工作人员严格遵守法律法规、行业自律规则、社会公德、商业道德、职业道德和行为规范，不得以任何直接或间接的方式贿赂另一方的任何人员和/或与该等人员具有利益关系的人员，不得以任何方式直接或间接提供或索取回扣、佣金等不正当财物、利益或机会，不得以任何方式从事其

他商业贿赂或利益输送行为。合同各方理解并同意配合另一方或其监管机构就廉洁从业及反商业贿赂开展的检查调查工作，并提供必要的协助及配合。

他商业贿赂或利益输送行为。合同各方理解并同意配合另一方或其监管机构就廉洁从业及反商业贿赂开展的检查调查工作，并提供必要的协助及配合。如投资者/托管人在协议谈判、订立和履行过程中知悉管理人任何已发生或即将发生的上述商业贿赂或利益输送行为，请立即通知管理人，举报投诉邮箱为：zj_xfjb@cicc.com.cn（并以【甲方管理人】官网不时公布的最新方式为准）