

关于《华宝证券华享添利周周盈3号集合资产管理计划资产管理合同》合同变更征询及临时开放期的公告

尊敬的投资者：

华宝证券华享添利周周盈3号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）已于2022年7月13日公告成立。现根据法律法规变更及投资运作需求，拟变更为《华宝证券华享添利周周盈3号集合资产管理计划资产管理合同（第四版）》。

一、合同变更内容

根据《资产管理合同》第二十四条第（一）款约定，经管理人与托管人协商一致，拟对《资产管理合同》内容进行修改，修订内容包括：投资范围、投资比例、投资限制、投资经理、估值方法、风险揭示等条款。

详细请参考附件《华宝证券华享添利周周盈3号集合资产管理计划资产管理合同重要条款修订对照表》《华宝证券华享添利周周盈3号集合资产管理计划资产管理合同（第四版）》（以下简称“《资产管理合同（第四版）》”）。

二、临时开放期安排

管理人将【2024】年【11】月【27】日至【2024】年【11】月【27】日（含当日）设置为临时开放期，不同意本次合同变更的投资者可在临时开放期间申请全份额退出本集合计划，投资者未在临时开放期间申请全份额退出的，视为同意本次合同变更。

临时开放期结束后，即【2024】年【11】月【28】日，《华宝证券华享添利周周盈3号集合资产管理计划资产管理合同（第四版）》将依照法律法规及监管机构规定要求生效。自本次合同变更生效日起，投资者、管理人、托管人应按照《华宝证券华享添利周周盈3号集合资产管理计划资产管理合同（第四版）》行使相关权利，履行相应义务。

特此公告。

华宝证券股份有限公司
2024年11月27日

附件一：华宝证券华享添利周周盈3号集合资产管理计划资产管理合同重要条款修订对照表

华宝证券华享添利周周盈3号集合资产管理计划资产管理合同

重要条款修订对照表

变更前	变更后
第三节“承诺与声明”中新增	
（三）投资者承诺与声明	
.....	
5、承诺符合反洗钱法律法规要求，未从事洗钱或配合洗钱的相关活动。承诺配合管理人或销售机构依照法律法规开展的反洗钱及非居民金融账户涉税信息尽职调查。	
.....	
8、投资者承诺遵守资产管理计划开展投资涉及的全部法律法规、监管规定、交易所规则及相关自律组织的管理要求，并不实施任何内幕交易、利益输送、操纵市场、结构化发行及其他违法违规行为。投资本资产管理计划不涉及扰乱市场秩序，利用投资资产管理计划资金直接或者间接参与结构化发债或利用资产管理计划为发行人操纵发行定价、违规关联交易、利益输送等提供便利的等违规行为；并承诺向管理人提供最终投资者清单、投资者关联方清单等信息，配合管理人开展的识别结构化发债的全部措施。	
9、同意遵守所有适用的经济制裁和出口管制法律和法规；声明与保证没有违反制裁和管制法，没有被任何有权实施经济制裁或出口管制的政府机构或国际组织以任何方式进行制裁或管制，或因制裁或管制的原因被制裁和管制机构调查、处罚或起诉。	
10、如果以上声明部分或全部不真实，投资者承担由此产生的法律责任并自行承担由此造成的损失。	
（四）反腐败声明与承诺	
1、本合同各方当事人都清楚并愿意严格遵守中华人民共和国反商业贿赂相关法律法规，各方都清楚任何形式的贿赂和贪渎行为都将触犯法律，并将受到法律的严惩。	
2、任何一方不得向其他各方、其他各工作人员或其他相关人员提供、给予利益和方便或实施输送不正当利益的行为，包括但不限于：	
（1）现金、购物卡、有价证券及支付凭证、通讯器材、交通工具、非低值文化用品以及其他贵重物品或者为上述物品提供代持等便利；	
（2）组织参加境内外旅游、高消费娱乐、宴请、娱乐健身、非以正当开展业务之目的召开的会议等活动；	
（3）提供全职、兼职岗位或就业机会；	
（4）任何借款或贷款往来；	
（5）共同成立营利组织或参与利益分配；	
（6）安排显著偏离公允价格的结构化、高收益、保本理财产品等交易；	
（7）其他具有贿赂性质的利益。	
3、如在合作过程中任何一方发现相关人员以个人名义或假借对方名义索要、收受、谋取不正当利益的，应及时通知对方。各方应积极配合相关调查、处理工作。	

4、资产托管人声明：资产托管人对一切腐败行为采取零容忍态度，并一直贯彻合法经营、廉洁从业的原则。资产托管人严禁工作人员、代理人及其他相关人员提供或接受任何非法利益、索要非法利益，该等不正当行为均不被资产托管人允许或认可，不代表资产托管人行为，与资产托管人无关。资产管理人、投资者已明确了解资产托管人的管理要求，不得因任何腐败行为向资产托管人主张责任。

5、本约定适用于本合同各方当事人的员工、代理人及其他相关人员，其他相关人员包括一方工作人员以外的与本协议有直接或间接利益关系的人员。

第五节“集合计划的基本情况”、第十一节“集合计划的投资”、附件一“投资监督事项表”中“投资范围”

(1) 交易所和银行间市场上市或挂牌交易标准化债权类资产，包括但不限于国债、地方政府债、金融债（含次级债、混合资本债、政策性金融债、无固定期限资本债券、保险公司资本补充债券）、二级资本工具、永续债、公司债（含非公开发行）、企业债（含非公开发行、项目收益债券）、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、标准化票据、非公开定向债务融资工具、以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等。债券逆回购（包括质押式回购、质押式协议回购、买断式回购等）、同业存单；银行存款、现金；

(2) 资产管理产品：公募证券投资基金（包括货币市场基金、公募 REITs、同业存单基金、债券型基金），商业银行或其理财子公司发行的理财产品，信托计划，基金公司资产管理计划、基金子公司资产管理计划、证券公司资产管理计划、证券公司子公司资产管理计划、保险资产管理计划、保险公司子公司资产管理计划、期货公司资产管理计划、期货公司子公司资产管理计划；

本计划可参与债券正回购（包括质押式回购、协议回购、买断式回购）。

(1) 交易所和银行间市场上市或挂牌交易的标准化债权类资产，包括但不限于国债、地方政府债、政府支持机构债、中央银行票据、金融债（含次级债、二级资本债、混合资本债、政策性金融债、无固定期限资本债券、保险公司资本补充债券）、公司债、企业债、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、非公开定向债务融资工具以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等；资产支持证券（ABS，非次级）、资产支持票据（ABN，非次级）；可转换债券、可交换债券；逆回购、同业存单；银行存款（含定期存款、协议存款、结构性存款、同业存款、通知存款、大额存单等）、现金；

(2) 期货和衍生品类资产：国债期货、利率互换、标准化信用风险缓释工具（包括信用风险缓释凭证（CRMW）、信用联结票据（CLN）等）、标准债券远期；

(3) 本计划不直接从二级市场买入股票、权证，但可持有因可转换债券、可交换债券转（换）所形成的股票、权证；

(4) 资产管理产品：公募证券投资基金（含公募 REITs、互认基金等），商业银行或其理财子公司发行的理财产品，信托计划，基金公司资产管理计划、基金子公司资产管理计划、证券公司资产管理计划、证券公司子公司资产管理计划、保险资产管理计划、保险公司子公司资产管理计划、期货公司资产管理计划、期货公司子公司资产管理计划（包括前述各产品类型的 QDII 产品）。

本计划可参与债券正回购。

第五节“集合计划的基本情况”、第十一节“集合计划的投资”、附件一“投资监督事项表”中“投资比例”

(1) 按市值计, 本计划投资于固定收益类资产占计划总资产比例为 80% (含) -100% (含); 投资于权益类资产占计划总资产比例为 0-20% (不含); 投资于期货和衍生品账户权益占计划总资产比例为 0-20% (不含); (2) 按市值计, 本计划投资于资产管理产品的比例为 0% (含) -80% (不含)。	(1) 按市值计, 本计划投资于固定收益类资产占计划总资产比例为 80% (含) -100% (含); 投资于权益类资产占计划总资产比例为 0% (含) -20% (不含); 投资于期货和衍生品账户权益占资产管理计划总资产比例: 0% (含) -20% (不含); (2) 按市值计, 本计划投资于资产管理产品比例为 0% (含) -80% (不含); (3) 本计划投资于同一资产的资金不超过计划资产净值的 25%; 管理人管理的全部集合资产管理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、地方政府债券等投资品种除外); (4) 本集合计划总资产占净资产的比例不超过 200%。
第五节 “集合计划的基本情况” 中新增 “(八) 集合计划的费用”	
(八) 集合计划的费用 1、参与费率: 本计划的参与费率为【0】%/笔。 2、退出费率: 本计划的退出费率为【0】%/笔。 3、管理费: 本计划的管理费率为【0.6】%/年, 管理费每日计提, 按季支付。 4、托管费率: 本计划的托管费率为【0.01】%/年, 托管费每日计提, 按季支付。 5、管理人业绩报酬: 本计划不计提业绩报酬。 6、其他费用; 具体详见本合同第二十节 “集合计划的费用与税收”。	
第十一节 “集合计划的投资” 中 “(八) 投资限制”	
本集合计划财产的投资组合应遵循以下限制: (1) 本计划投资于的同一资产的资金不超过计划资产净值的 25%, 管理人管理的全部集合资产管理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、地方政府债券等投资品种除外); (2) 本集合计划总资产占净资产的比例不超过 200%; (3) 本计划债券正回购资金余额不得超过计划上一日资产净值的 100%; (4) 本计划在开放退出期内, 资产组合	本集合计划财产的投资组合应遵循以下限制: (1) 本计划债券正回购资金余额不得超过计划上一日资产净值的 100%; (2) 本计划在开放退出期内, 资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值不低于计划资产净值的 10%; (3) 本计划参与债券、可转债、可交债等证券发行申购时, 所申报的金额原则上不得超过计划的总资产, 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; (4) 本计划所投资的可转债、可交债可

中7个工作日可变现资产的价值不低于计划资产净值的10%；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计划资产净值的20%。 (5) 本计划参与债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过计划的总资产，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； (6) 本计划投资的信用类债券的债项评级（如有）在AA级（含）或A-1（含）以上；若无债项评级，则主体或担保方评级在AA级（含）以上；因投资评级下调被动持有的除外。无主体评级及债项评级的信用类债券不受上述限制，管理人可自主投资。因投资评级下调被动持有的除外。本计划所有评级均不参考中债资信评估有限公司的评级； (7) 本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，本计划的总资产不得超过其净资产的120%。国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外； (8) 本计划所投资的资产管理产品不得投资于非标准化金融资产； (9) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。	以转（换）权益类资产，转（换）的权益类资产应在可交易之日起20个交易日卖出； (5) 本计划投资的信用类债券（不含可转债、可交债）的债项评级（如有）在AA级（含）或A-1（含）以上；若无债项评级，则主体或担保方评级在AA级（含）以上；因投资评级下调被动持有的除外；前述信用类债券（不含可转债、可交债）存续期内，无更新主体评级、债项评级及担保方评级的，管理人经内部评估后可自主进行投资决策。本计划投资的资产支持证券、资产支持票据的债项评级在BBB（含）以上，如无债项评级的，则主体或担保方评级BBB（含）及以上；因投资评级下调被动持有的除外。本计划所有评级均不参考中债资信评估有限公司的评级； (6) 本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，本计划的总资产不得超过其净资产的120%。国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外； (7) 本计划投资的资产管理产品不得投资于非标准化金融资产； (8) 法律、行政法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他投资限制。
第十五节“投资经理的指定与变更”中“（一）投资经理”更新为	
任雅姗女士，中央财经大学经济学硕士。2015年起从事金融行业，2015年加入华宝证券，现任华宝证券资产管理业务总部固定收益部投资经理。历任债券交易员、投资助理、投资经理。擅长信用债、ABS、利率债等品种的投资研究。 王李瑞先生，复旦大学风险管理与保险硕士，FRM。2016年起从事金融行业，2022年加入华宝证券，现任华宝证券资产管理业务总部固定收益部投资经理。历任建信保险资产管理有限公司研究员、投资助理、投资经理。投资风格稳健、策略多元，擅长信用债、可转债等投资品种的精选挖掘，注重自上而下的大类资产配置。 李孟帆女士，上海财经大学金融计量硕士。2016年起从事金融行业，2022年加入华宝证券，现任华宝证券资产管理业务总部固定收益部投资经理。历任商业银行信用分析经理，华鑫证券资管信评负责人。拥有丰富的固定收益类资产信用研究经验，深耕各行业信用轮动，投资风格稳健，擅长信用债、ABS等投资品种的精选挖掘。 王淑美女士，中国人民大学会计硕士，CPA。2011年起从事金融行业，2011年加入华宝证券，现任华宝证券资产管理业务总部固定收益部投资经理。历任华宝证券研究所宏观、债券及行业研究员。擅长利率债、可转债交易及信用债分析评价。	
第十九节“集合计划资产的估值和会计核算”中“（七）估值方法”	

.....
(七)

3、债券估值

A、对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(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;

B、在银行间债券市场交易的债券等固定收益品种,采用中央国债登记结算公司提供的中债收益率曲线及估值价格确定公允价值;对在银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,未上市期间发行人信用状况、市场利率没有发生大的变动的情况下,按参考近期投资价格估值;

C、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。

D、交易所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进行估值;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,按最近交易日债券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进行估值。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;

交易所上市实行全价交易的债券(可转债除外),选取第三方估值机构提供的估值全价减去估值全价中所含的债券(税后)应收利息得到的净价进行估值。证券交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。在交易所市场挂牌转让的私募债券和资产支持证券,按估值日中证指数公司提供的相应品种当日的估值净价进行估值。证券交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。

4、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应计利息,在利息到账日以实收利息入账。

.....

.....
(七)

3、债券估值

A、在证券交易所市场挂牌交易的不含权债券,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的估值全价进行估值(可转债、可交债除外,合同另有约定的除外)并根据相关法律、法规的规定进行涉税处理(下同);

B、对于已上市或已挂牌转让的含权债券,建议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唯一估值全价或推荐估值全价;

C、交易所上市交易的可转换债券、可交换债券,实行全价交易的按估值日收盘价作为估值全价进行估值;实行净价交易的,采用估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价进行估值。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,按最近交易日债券收盘价进行估值。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;

D、全国银行间债券市场交易的债券,采用第三方估值机构(中债金融估值中心)提供的估值价格确定公允价值。

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。

F、首次公开发行未上市的债券,且第三方估值机构未提供估值价的,采用估值技术确定公允价值。

4、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应计利息,在利息到账日以实收利息入账。债券正回购按首次交易金额估值,利息在回购期间摊销。

其中,结构性存款:(1)有预期收益率的结构性存款,按照预期收益率逐日计提存款利息;(2)无法提供预期收益的,依据交易对手银行提供的估值结果更新最新存款价值,交易对手银行无法提供或未及时提供估值结果的,按最近一次银行提供的估值结果进行估值。如交易对手银行从

6、衍生品估值方法

(1) 期货合约按照期货交易所以估值日的结算价估值, 若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, 采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的, 从其规定。

(2) 标准债券远期的估值方法, 可参考外部结算机构最新提供的估值结果或根据可靠的估值技术, 确定公允价值。法律法规另有规定的, 从其规定。

(3) 信用风险缓释凭证 (CRMW) 按监管机构或行业协会有关规定, 对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进行估值; 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, 则采用估值技术确定公允价值。法律法规另有规定的, 从其规定。

.....

未提供估值结果的, 由管理人和托管人协商一致后采用估值技术进行估值。

.....

6、衍生品估值方法

(1) 期货合约按照期货交易所以估值日的结算价估值, 若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, 采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的, 从其规定。

(2) 标准债券远期的估值方法, 可参考外部结算机构最新提供的估值结果或根据可靠的估值技术, 确定公允价值。法律法规另有规定的, 从其规定。

(3) 信用风险缓释凭证 (CRMW) 依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。信用风险缓释合约, 依据第三方或交易对手方提供的合约盈亏估值结果或估值报告确认合约损益, 如第三方或交易对手方无法提供合约盈亏估值结果或估值报告的, 采用估值技术估值。

(4) 信用联结票据 (CLN) 选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

(5) 利率互换, 根据清算机构或代理清算机构提供的结算单据或结算数据进行估值, 若清算机构或代理清算机构未提供结算单据或结算数据的, 采用估值技术确定公允价值。法律法规另有规定的, 从其规定。

.....

9、公募 REITs 的估值方法

①对投资的公募 REITs, 发行上市前采用估值技术确定的公允价值进行估值; 发行上市后按收盘价进行估值。

②对投资的流通受限公募 REITs 份额, 采用第三方估值机构提供的流动性折扣率计算公允价值进行估值。

③若公募 REITs 因交易不活跃或者经济环境变化导致收盘价不能准确反映公允价值时, 采用估值技术确定公募 REITs 的公允价值。

10、估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的, 估值日汇率为中国人民银行或其授权机构公布的人民币与主要

第二十三节“风险揭示”和附件一风险揭示书中新增

6、投资标的风险

(4) 投资资产支持证券的特有风险

A、现金流预测偏差风险：资产证券化产品还本付息的来源为基础资产产生的现金流，基础资产的稳定性越差，预测过程中产生的偏差就越大。还款来源还可能受宏观经济和行业政策的影响非常大，存在现金流预测与实际还款不符合的风险；

B、基础资产运营成本风险：资产证券化产品的未来现金流为基础资产产生的全部收入减去基础资产日常运营的相关成本。若对该部分成本没有做相应安排，可能影响原始权益人的正常运营，进而影响基础资产未来现金流的额度及稳定性。

C、抵质押风险：未来收益权如果处于抵质押状态，可能出现收益权无法分割，导致不能实现部分收益权的转移的风险；即使收益权未被抵押，如果产生收益权的固定资产处于抵质押状态，而债权人或担保权人依据相关合同收回或处置该固定资产，则会使计划面临较大风险。

D、资金监管缺失的风险：目前部分专项计划的设计中缺失监管银行，而监管银行的缺失可能会影响产品未来现金流归集的可靠性和安全性，存在原始权益人是否将基础资产现金流挪作他用的道德风险，从而对产品的本息兑付产生不利的影响。

E、集中回售导致的流动性风险：部分资产证券化产品根据投资者的需求及自身的营销目的，设置了回售和赎回的约定，如投资者选择提前回售，当期现金流可能无法覆盖剩余应付本息，从而使原始权益人面临一定的资金缺口，若专项计划未安排回售准备金，则可能会导致启动差额补足和担保支付的情况。

F、资金归集风险：资产证券化产品基础资产类型的多样化，导致现金流归集的复杂性，可能会给基础资产的稳定性带来一定影响。比如资金流入的账户众多，缴费时间可能提前或延迟，致使资金归集的数据具有一定的不确定性，影响了该类产品的按时足额还本付息的能力。

G、信用风险：证券化资产所产生的现金流可能不能支持资产证券化产品本金和利息的及时支付。

H、流动性不足风险：由于资产证券化产品在我国尚属创新金融产品，产品规模相对较小，投资人对此类产品还不熟悉，在转让时可能存在一定的流动性风险，可能由于无法找到交易对象而难于将资产支持证券变现。

(5) 投资于可转换公司债券特定风险

①有条件赎回：可转债设有有条件赎回条款的，在可转债的转股期内，如果发行人的A股股票价格达到可转债转股价格的一定百分比，经相关监管部门批准（如需），发行人有权按照债券面值加当期应计利息的价格赎回全部或部分未转股的可转债；此外，当可转债未转股的票面总金额不足一定金额时，发行人有权按面值加当期应计利息的价格赎回全部未转股的可转债。如果发行人在获得相关监管部门批准（如需）后行使相关有条件赎回的条款，可能促使可转债投资者提前转股，从而导致投资者面临可转债存续期缩短、未来利息收入减少的风险。

②可转债的转股价值可能产生重大不利变化的风险：可转债发行人的A股的股价走势取决于宏观经济形势、股票市场环境以及本行经营业绩等多重因素影响。如果发行人的A股股价持续低于可转债的转股价格，或者发行人由于各种客观原因导致未能及时向下修正转股价格，或者即使发行人向下修正转股价格，但发行人的A

股股价仍有可能持续低于修正后的转股价格，则可能导致可转债的转股价值发生重大不利变化，并进而导致可转债在转股期内不能转股的风险，对可转债持有人的利益造成重大不利影响。

③可转债发行不提供担保的风险：可转债发行人未提供担保的，如果发行人受经营环境等因素的影响，经营业绩和财务状况发生不利变化，可转债投资者可能面临因发行的可转债无担保而无法获得对应担保物补偿的风险。

(6) 投资于可交换公司债券特定风险：

①购买可交换公司债券后可能面临由于债券不能及时上市流通而无法立即出售，或者由于债券上市流通后交易不活跃甚至出现无法持续成交的情况，不能以某一价格足额出售其希望出售的债券所带来的流动性风险。标的股票依据《上海证券交易所股票上市规则》规定停复牌的，上交所可视情况对可交换债券停复牌。换股期间，预备用于交换的股票出现司法冻结、扣划或其他权利瑕疵影响投资者换股权利的，发行人应当向上交所申请暂停可交换债券换股，发行人未及时申请暂停可交换债券换股的，上交所可视情况暂停提供换股服务。

②到期未换股而集中兑付的风险：标的股票的价格不仅受上市公司盈利水平和发展前景的影响，而且受国家宏观经济形势及政治、经济政策、投资者的投资偏好、投资项目收益等因素的影响。如果因标的股票的价格走势低迷或债券的债券持有人的投资偏好等原因导致债券到期未能实现换股，发行人必须对未换股的可交换公司债券偿还本息，将会相应增加发行人的财务费用负担和资金压力，从而使发行人面临本息集中兑付风险。

③债券收益不确定风险：债券的收益受换股价格、标的股票价格、赎回条款、投资者的预期等诸多因素的影响：a、持有期间获取利息，持有至到期被发行人以到期赎回价格赎回而获取的赎回收益，或在存续期内被发行人按照债券面值加应计利息赎回而获取的赎回收益；b、当标的股票二级市场价格高于换股价时，通过交换股票获取二级市场价格与换股价之间差价；c、其他可能的收益波动情形。

④换股期限内可能无法换股的风险

预备用于交换的股票在债券发行前，不存在被查封、扣押、冻结等财产权利被限制的情形，也不存在权属争议或者依法不得转让或设定担保的其他情形。尽管如此，不排除在债券存续期间，预备用于交换的股票出现《信托法》及其他法律、法规规定的特定情形下的司法冻结、扣划或其他权利瑕疵，或预备用于交换的股票数量少于未偿还债券全部换股所需股票而发行人又无法补足，亦或发行人或预备用于交换的股票出现其他影响投资者换股权利事项而使上交所暂停或终止债券换股的情形，进而出现在约定的换股期限内投资者可能无法换股的风险。

⑤担保及信托风险

在债券存续期内，若调整换股价格而造成预备用于交换的股票数量少于未偿还债券全部换股所需股票的，发行人将在换股价格调整日之前补充提供预备用于交换的股票，并就该等股票办理担保及信托登记。此外，由于标的股票及其孳息属于信托财产，除《信托法》及其他法律、法规规定的特定情形外不得被冻结、扣划。尽管如此，一旦标的股票发生《信托法》及其他法律、法规规定的特定情形下的司法扣划或权属瑕疵，债券受托管理人有权根据债券持有人会议的决议要求公司追加担保。

当发行人无法偿付债券本息时，以上担保及信托措施可为债券本息的偿付提供一定保障。但由于受到经济周期、调控政策及其他不可控因素的影响，不排除作为担保及信托财产的标的股票的价格短期内出现大幅下跌导致标的股票市值无法实现

对债券本金的超额担保或补充措施出现重大变化的情形，而该等情形可能影响到上述担保及信托措施对债券本息偿付的最终保障效果。此外，债券如未设置维持担保条款，作为担保及信托财产的标的股票的价格出现大幅下跌导致标的股票市值无法覆盖债券本息时，发行人亦可能不实施追加担保，从而影响对债券本息偿付的保障效果。

⑥标的股票价格波动风险

标的股票的价格不仅受上市公司盈利水平和发展前景的影响，而且受国家宏观经济形势及政治、经济政策、投资者的投资偏好、投资项目收益等因素的影响。如上述宏观环境或外部因素产生变化，投资者及公司将面临标的股票价格波动的风险。股票的价格走势低迷可能导致债券价值波动，从而影响投资者收益及换股情况；换股期内，标的股票价格可能低于换股价格，从而投资收益；如债券到期未能实现换股，公司必须对未换股的可交换公司债偿还本息，将会相应增加公司的财务费用负担和资金压力，从而使公司面临本息集中兑付风险。

(7) 投资公开募集基础设施证券投资基金（REITs）的风险

本计划可能投资于公募募集基础设施证券投资基金（公募 REITs），该类基金采用“公募基金+基础设施资产支持证券”的产品结构，将 80%以上基金资产投资于基础设施资产支持证券，并持有其全部份额，通过基础设施资产支持证券持有基础设施项目公司的全部股权，穿透取得基础设施项目完全所有权或经营权利；基金以获取基础设施项目租金、收费等稳定现金流为主要目的，收益分配比例不低于合并后基金年度可供分配金额的 90%，与投资股票或债券的公募基金具有不同的风险收益特征。投资公募 REITs 可能面临的风险包括但不限于如下几个方面：

①公募 REITs 大部分资产投资于基础设施项目，具有权益属性，受宏观经济环境、土地使用政策、环境保护政策、产品发展规范、主要产品或服务的市场供需状况、行业竞争环境、运营管理水平、经营权利及所有权期限等因素影响，基础设施项目市场价值及现金流情况可能发生变化，可能引起公募 REITs 价格波动，甚至存在基础设施遭遇极端事件（如地震、台风等）发生较大损失而影响基金价格的风险，将带来投资的不确定性。

②公募 REITs 投资集中度高，收益率很大程度依赖基础设施项目运营情况，基础设施项目可能因环境变化或运营不善等因素影响，导致实际现金流大幅低于测算现金流，存在基金收益率不佳的风险，基础设施项目运营过程中租金、收费等收入的波动也将影响基金收益分配水平的稳定。此外，基础设施基金可直接或间接对外借款，存在基础设施项目经营不达预期，基金无法偿还借款的风险，上述因素可能将影响公募 REITs 基金份额持有人的收益水平。

③公募 REITs 采取封闭式运作，封闭期不开放申购与赎回，只能在二级市场交易，存在流动性不足的风险。对于上市交易的公募 REITs，基金的场外份额持有人需将基金份额转托管至场内才可卖出或申报预受要约，交易价格与基金份额净值可能存在差异。

④公募 REITs 运作过程中可能因触发法律法规或交易所规定的终止上市情形而终止上市，导致公募 REITs 份额持有人无法在二级市场交易。

⑤基础设施基金运作过程中可能涉及基金持有人、公募基金、资产支持证券、项目公司等多层面税负，如果国家税收等政策发生调整，可能影响投资运作与收益，并进而影响公募 REITs 份额持有人的收益水平。

.....

(9) 国债期货投资风险

①杠杆风险。

国债期货交易采用保证金交易方式，潜在损失可能成倍放大，具有杠杆风险。

②到期日风险。

国债期货合约到期时，如计划仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将计划持有的合约进行现金交割，计划存在无法继续持有到期合约的可能，具有到期日风险。国债期货合约采用实物交割方式，如计划未能在规定期限内如数交付可交割国债或者未能在规定期限内如数缴纳交割款，将构成交割违约，交易所将收取相应的惩罚性违约金。

③强制平仓风险

当市场走势对集合计划不利导致集合计划的期货保证金账户保证金不足时，如管理人未于规定时间存入所需保证金，集合计划持有的未平仓合约将可能在亏损的情况下被强行平仓，由此造成的损失由集合计划承担。

如计划参与交割不符合交易所或期货公司相关业务规定，期货公司有权不接受计划的交割申请或对计划的未平仓合约强行平仓，由此产生的费用和结果将由集合计划承担。

④使用国债期货对冲市场风险的过程中，计划财产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临基差风险。在需要将期货合约展期时，合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性，面临跨期基差风险。

(10) CRMW、CLN 的特有风险

CRMW、CLN 属于信用风险缓释工具，对信用事件的定义包括破产、支付违约。在评价和购买 CRMW、CLN 时，应特别认真考虑以下各项风险因素。

①参考实体风险

CLN 在存续期内，如果发生不可控制的市场、环境变化、信用风险经济形势、国家政策、或参考实体本身资信或财务状况恶化等情况，可能导致参考实体信用能力降低，参考实体或参考债务评级被下调，公允价值有可能大幅降低，甚至可能触发信用事件，或导致以创设机构约定的方式进行结算，可能使投资者的利益受到影响。

②流动性风险

CRMW、CLN 将在限定投资人范围内交易流通，在转让时存在一定的交易流动性风险，可能由于无法找到交易对手而难以将其变现。

③偿付风险

在 CRMW、CLN 的存续期内，如果由于不可控制的市场及环境变化，创设机构可能出现经营状况不佳或创设机构的现金流与预期发生一定的偏差，从而影响 CRMW、CLN 的按期足额兑付。

④与创设机构相关的主要风险

如果创设机构在经营管理中，受到自然环境、经济形势、国家政策和自身管理等有关因素的影响，使其经营效益恶化或流动性不足，不能从预期的还款来源获得足够资金，可能使凭证的本息不能按期兑付。在 CRMW、CLN 存续期内，可能出现由于创设机构经营情况变化，导致信用评级机构调整对创设机构的信用级别，从而引起 CRMW、CLN 交易价格波动，使 CRMW、CLN 投资人的利益受到影响。

(11) 利率互换的风险

利率互换交易的风险主要来自于内部风险和外部风险。内部风险主要是由于基金管理人对市场预测不当，导致的投资决策风险；外部风险包括金融标的价格不利变动导致的价格风险，市场供求失衡、交易不畅导致的流动性风险等。

(12) 标准债券远期的投资风险

①杠杆性风险。标准债券远期业务采用保证金交易方式，潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。

②到期日风险。标准债券远期合约到期时，如计划仍持有未平仓合约，上海清算所将按照交割结算价将计划持有的合约进行现金交割，计划存在无法继续持有到期合约的可能，具有到期日风险。标准债券远期合约采取现金交割方式，清算会员未能在现金交割结算规定时点内于指定账户备足相应资金，导致现金交割失败，将构成交割违约，上海清算所将视实际情况采取违约处理。

③违约风险。清算会员未能在上海清算所发出日间保证金追缴通知后规定时间内于指定账户备足相应资金，导致保证金追缴失败，为日间保证金追缴违约；清算会员未能在日终保证金结算规定时点内于指定账户备足相应资金，导致保证金结算失败，为日终保证金结算违约；清算会员未能在现金交割结算规定时点内于指定账户备足相应资金，导致现金交割失败，为交割违约。发生上述三种情况或其他上海清算所认定的清算会员违约情况时，上海清算所可视具体情况采取相应的违约处置措施。

④强制平仓风险。上海清算所对标准债券远期实行强行平仓和强行结算制度，违约清算会员未在规定时间内按要求补交违约金额及违约罚金的，由上海清算所对其持有的未平仓标准债券远期合约进行强行平仓，违约清算会员有义务配合上海清算所进行强行平仓。

⑤在使用标准债券远期进行风险对冲和套期保值时，可能因为标准债券远期合约与合约标的价格波动不一致而面临期现基差风险。

.....

(15) 投资结构性存款的风险：结构性存款不同于一般性存款，具有投资风险。结构性存款在普通存款的基础上嵌入了金融衍生品工具，其风险和收益与利率、汇率、指数等的波动挂钩或者与某实体的信用情况挂钩，可能会造成本金亏损。

(16) 投资互认基金的风险

境外市场风险：由于互认基金可能以境外市场为主要投资方向，境外市场投资受到所投资市场宏观经济运行情况、货币政策、财政政策、产业政策、税法、汇率、交易规则、结算、托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使基金资产面临潜在风险，进而可能对投资者的收益产生影响。

汇率风险：本计划投资于互认基金，如果基金部分或全部的相关投资非以人民币计价，基金资产在不同币种之间兑换后的价格可能受相关汇率波动影响，从而影响到基金以人民币计价的收益，进而可能会对投资者的投资收益产生影响。

法律风险：互认基金需要遵守互认地区的法律法规。如果相关法律法规发生变化，或者基金在遵守法律法规方面出现问题，可能会对基金的运作产生影响。

政策风险：互认基金的运作和销售受到中国内地和互认地区两地政策的影响。如果相关政策发生变化，可能会对基金的运作产生影响。

双边税务风险：由于互认基金涉及到中国内地和互认地区两地的税务，因此可能存在双边税务风险。例如，中国内地或互认地区的税务政策发生变化，或者两地的税务政策存在冲突，可能会对投资者的投资收益产生影响。

7、投资境外资产所涉风险

本计划可能会投资 QDII 产品，因 QDII 产品以美元等外币进行投资，美元等外币相对于人民币的汇率的变化将会影响 QDII 产品以人民币计价的基金资产价值，从而导致资产面临潜在风险；QDII 产品所投资的国家或地区宏观政策、社会经济环境一旦发生变化或所在市场发生黑天鹅事件，可能导致市场波动而影响收益；由于各国

或地区的法律法规方面的原因，导致某些投资行为受到限制或合同不能正常执行，从而面临损失的可能性。由于 QDII 产品涉及跨境交易，申购、赎回的时间要长于国内其他产品，可能会对 QDII 产品的收益产生影响。

8、从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险

(1) 一般关联交易风险

投资者签署本合同即代表同意本计划可从事一般关联交易，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。管理人运用计划财产从事一般关联交易的，在交易完成后的合理时间内将交易的情况向投资者披露。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，而无法及时获知关联交易事项，从而存在风险。

(2) 重大关联交易风险

若本计划从事重大关联交易的，应事前逐笔征得投资者同意，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者权益，在交易完成后的合理时间内，及时、全面、客观的将交易的情况向投资者披露。投资者可能因为未能有效获知重大关联交易的风险即同意管理人进行重大关联交易，从而存在风险。

管理人根据资产管理合同约定从事关联交易的，虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因管理人运用集合计划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。最后，可能存在关联关系隐秘复杂而不被准确识别的风险。

9、未设置预警止损机制的风险

本计划未设置预警止损机制，由此当市场大幅下跌或遭遇其他特殊市场不利环境，本计划可能出现本金大幅亏损的风险。

10、业绩报酬相关风险（如有）

管理人有权根据市场情况及集合计划运作情况调整业绩报酬计提基准，投资者可能面临因下调业绩报酬计提基准或上调计提比例而导致委托财产中的投资收益减少的风险。此外，投资者还面临已支付给管理人的业绩报酬，即使投资者退出本集合计划时净值有所下跌，该部分业绩报酬也不予退还的风险。

.....

(二) 一般风险

.....

9、适当性管理相关风险

(1) 投资者有义务保证其提供的相关信息及材料真实、准确、完整。销售机构评定投资者的风险承受能力、做出适当性匹配意见系基于投资者提供的相关信息及证明材料真实、准确、完整的前提下做出；如投资者提供的信息及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，可能会导致投资者的风险承受能力评定、适当性匹配意见存在偏差、与实际不符的风险，销售机构有权拒绝为投资者提供服务或拒绝接受投资者的交易申请、业务申请，相关风险、责任、

损失由投资者自行承担。

(2) 投资者在信息发生重要变化、可能影响销售机构对其做出的投资者类别划分、风险承受能力认定时，应主动告知销售机构，以便销售机构做出调整。若投资者未能及时有效告知销售机构，则存在适当性匹配意见与实际不符的风险，进而可能产生的相应风险、责任、损失应由投资者自行承担。

(3) 投资者或产品的信息发生变化时，管理人、销售机构分别有权主动调整投资者的投资者分类、产品的风险等级以及适当性匹配意见，此时销售机构应告知投资者上述情况。管理人、销售机构做出产品风险等级调整的，投资者的交易或者购买产品的资格可能受到影响，进而产生相应的风险。

第二十七节 “合同的效力” 中 “(一) 合同的成立与生效” 新增

对于已经签署的《华宝证券华享添利周周盈 3 号集合资产管理计划资产管理合同（第三版）》（合同编号：HTSQ_20230801_0001_1）（简称“原合同”）的投资者而言，投资者未在管理人公告的因合同变更而设置的临时退出开放期内申请退出的，视为同意本次合同变更，且本次合同变更生效之日（以合同变更的相关公告为准），即视为有效签署本合同，本合同依照法律法规及监管规定成立并生效，同时原合同废止。

第二十八节 “其他事项”

(一) 本合同如有未尽事宜，由本合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

(二) 本合同签署后，若有关法律、法规、规章、自律规则、登记结算机构业务规则以及证券交易所或期货交易所交易规则修订或颁布，本合同相关条款与其中强制性规定发生冲突的，按新修订或颁布的法律、法规、规章、自律规则、业务规则及交易规则办理，但本合同其他内容及条款继续有效。

(三) 保密

1、管理人、托管人应就委托财产以及相关信息承担保密责任。除法律、法规的规定和本合同另有约定外，未经投资者事先书面同意，不得以任何方式披露或利用该信息。

2、任何一方对于在本合同履行过程中获知的对方的数据和信息，未经该方事先书面同意，不得用于本合同外的目的，不得告知非本合同当事方或与允许非本合同当事方使用，法律法规另有规定、监管及审计要求或本合同另有约定的除外。

3、如经他方事先书面同意而将有关信息告知非本合同当事方或允许非本合同当事方使用，应当与该方签订保密合同。

4、本保密义务不因本合同的终止而终止。本保密义务持续至本合同终止之日起

(一) 本合同如有未尽事宜，由本合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

(二) 本合同签署后，若有关法律、法规、规章、自律规则、登记结算机构业务规则以及证券交易所或期货交易所交易规则修订或颁布，本合同相关条款与其中强制性规定发生冲突的，按新修订或颁布的法律、法规、规章、自律规则、业务规则及交易规则办理，但本合同其他内容及条款继续有效。

(三) 保密

1、关于本合同项下的所有信息（包括本合同的存在本身及其条款内容）均为保密信息，本合同各方对此承担严格的保密义务，除适用法律、有管辖权的政府机构及监管机构等有权机关要求披露或各方为履行本合同约定所必须向其他第三方披露外，未经本合同另一方事先书面同意，任何一方不得将其披露给任何第三方

（本协议各方的股东、法律顾问和财务顾问除外，但前提是该等人士已经同意按照本条款规定遵守保密义务）。各方应确保其各自的股东、董事、高级管理人员、员工、代理人、顾问承担此等严格保密义务。

2、本保密义务不因本合同的终止而终止。本保密义务持续至本合同终止之日起【2】年。

【2】年。

(四) 或有事件

本合同所称的或有事件是指, 根据相关法律法规的规定, 管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。

份额持有人在此同意, 如果或有事件发生, 在管理人与托管人协商一致的基础上, 管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司, 并无需就此项变更取得份额持有人同意, 也无需和份额持有人另行签订协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告份额持有人。管理人保障份额持有人退出本集合计划的权利, 并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。

管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格, 并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。

管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

3、各方承诺, 未经对方书面同意, 不得使用对方名称、商标、标识等知识产权及与对方本协议项下的合作关系进行任何对外宣传。

4、如司法或行政机关等有权机关对本协议项下托管专户采取任何查封、冻结、扣押、扣划等措施, 托管人知悉后在符合法律法规规定及有权机关要求的情况下应当立即与管理人进行确认; 确系与集合计划财产相关事项导致托管专户被采取措施的, 托管人有权根据该有权机关的要求执行。

(四) 反贿赂、反腐败

就履行本合同项下各自的权利和义务, 任意一方均须各自遵守对其不时适用的反贿赂、反腐败的法律法规。

(五) 知识产权

本合同任意一方保留其已有知识产权的权利。

就某一方而言, 其对执行本合同所需的全部知识产权拥有合法有效的所有权及/或使用权, 就前述知识产权并不存在任何争议、权利请求或抵押、质押或其他形式的担保或限制; 不存在任何侵犯他人知识产权以至于影响本合同执行, 未收到限制、终止或以其它形式影响其继续拥有及/或使用前述知识产权的行政调查及/或处罚通知、司法裁定或判决或其它有权机关的类似文件。

(六) 资产管理人同意: 在其受到(或可能受到)任何制裁和管制机构的制裁或管制的情况下, 或因制裁或管制的原因被制裁和管制机构调查、处罚或起诉的情况下, 应立即通知资产托管人, 并与资产托管人积极沟通协商解决或替代方案。在资产托管人需要时, 配合资产托管人或其委托中介机构开展的经济制裁与出口管制合规尽职调查, 及时提供所需的协助和回复, 并将提供资产托管人或其委托中介机构合理要求的相关信息和文件资料, 必要时可对资产管理人的业务场所进行访问或对资产管理人人员进行访谈。

如果根据制裁和管制法, 该些制裁和管制法包括但不限于交易各方所在地、履

行合同相关地、美国、英国、中国内地和香港等司法管辖区以及联合国、欧盟等国际组织关于制裁和出口管制的有关法律、法规、决议、指令、命令,存在以下合同各方当事人控制以外的情况,均属于本合同项下的不可抗力事项之一:

1、任何一方或相关国家与地区被有权实施经济制裁或出口管制的政府机构或国际组织制裁或管制;

2、任何一方继续履行本合同的义务可能导致违反制裁和管制法;

3、基于制裁和管制法的规定任何一方无法、不可能、受妨碍或延误履行本合同的义务。

如在本合同生效后,本合同各方当事人任意一方被制裁和管制机构进行制裁或管制,且该等制裁将使得本合同项下的交易可能违反任何适用的法律法规,或者本合同的目的无法实现,则其他各方当事人有权即时终止权利义务的履行、解除合同,且不应因此承担任何进一步的义务或责任。

(七) 或有事件

本合同所称的或有事件是指,根据相关法律法规的规定,管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。

份额持有人在此同意,如果或有事件发生,在管理人与托管人协商一致的基础上,管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司,并无需就此项变更取得份额持有人同意,也无需和份额持有人另行签订协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告份额持有人。管理人保障份额持有人退出本集合计划的权利,并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。

管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格,并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。

管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

此外，合同还涉及如下修订：

- (1) 本次更新了部分管理人、托管人运营操作事项；
- (2) 全文“委托人”变更为“投资者”、“份额持有人”；
- (3) 全文“委托资产/财产”变更为“受托资产/财产”、“计划资产/财产”；
- (4) 巨额退出认定标准由总份额的 10%修改为总份额的 20%；
- (5) 根据中基协发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》整体调整了合同内容。

本次合同变更后，产品风险等级维持不变。具体修订后的内容投资者可以查阅《华宝证券华享添利周周盈 3 号集合资产管理计划资产管理合同(第四版)》内容。《华宝证券华享添利周周盈 3 号集合资产管理计划计划说明书(第四版)》同步修订。

附件二：华宝证券华享添利周周盈 3 号集合资产管理计划资产管理合同（第四版）