

关于方正证券稳盛11号集合资产管理计划 合同变更的公告

尊敬的委托人：

由我司担任管理人的“方正证券稳盛11号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）已于2019年12月4日成立。基于本集合计划的运作需求，经与托管人协商一致，我公司拟对《方正证券稳盛11号集合资产管理计划合同》（以下简称“原资管合同”）部分内容进行变更，现将变更事宜进行公告，并向委托人征询意见。

一、合同变更主要内容

1、变更参与退出安排

如本次合同变更生效，参与开放日将固定为每周二，但是如果周二遇非工作日，则当日不开放也不顺延。

如本次合同变更生效，将由原份额到期自动退出变更为滚动持有模式，即本次合同变更生效后投资者持有的份额不再到期自动退出，而是由投资人自份额参与日起（含参与日，下同）每满273天的下一日（如为非工作日，则顺延至下一工作日）的退出开放日选择是否退出，如投资者未在该退出开放日选择办理退出，则投资者持有的份额将进入下一个锁定期（273天），期间无法退出。

在此模式下，存续份额的首个可退出日如下表所示，如客户拟退出，需在退出日手动提交退出申请或按照销售机构的规则在退出日前提交预约退出申请；否则所持份额将进入下一个锁定期（下述退出日将可能根据国家放假安排有所调整，遇节假日将顺延，供参考，以实际情况为准）：

参与日	下一个退出日	期间天数	参与日	下一个退出日	期间天数
2023/11/21	2024/8/20	273	2024/3/19	2024/12/17	273
2023/11/28	2024/8/27	273	2024/3/26	2024/12/24	273
2023/12/5	2024/9/3	273	2024/4/2	2024/12/31	273
2023/12/12	2024/9/10	273	2024/4/9	2025/1/7	273
2023/12/19	2024/9/18	274	2024/4/16	2025/1/14	273



2023/12/26	2024/9/24	273	2024/4/23	2025/1/21	273
2024/1/2	2024/10/8	280	2024/4/30	2025/1/28	273
2024/1/9	2024/10/8	273	2024/5/7	2025/2/4	273
2024/1/16	2024/10/15	273	2024/5/14	2025/2/11	273
2024/1/23	2024/10/22	273	2024/5/21	2025/2/18	273
2024/2/6	2024/11/5	273	2024/5/28	2025/2/25	273
2024/2/20	2024/11/19	273	2024/6/4	2025/3/4	273
2024/2/27	2024/11/26	273	2024/6/11	2025/3/11	273
2024/3/5	2024/12/3	273	2024/6/18	2025/3/18	273
2024/3/12	2024/12/10	273	2024/7/2	2025/4/1	273

因投资者的退出安排发生变更，业绩报酬计提期间也将因为投资者的退出日变更而相应变更。

2、变更业绩报酬计提基准

本次合同变更生效后，管理人将进行分红，并在除权除息日的下一交易日将业绩报酬计提基准调整为【4.05】%（具体以届时发布的公告为准），调整后的业绩报酬计提基准低于原业绩报酬计提基准，存在委托人收益减少的风险，请投资者知悉前述安排。如投资者未在本合同变更的指定开放日退出本计划，则视为同意本次业绩报酬计提基准调整安排，该调整在新业绩报酬计提基准生效之日起对本集合计划所有存续份额生效。

后续在本计划运作过程中，管理人可根据市场经济变化等情况调整“业绩报酬计提基准”，但至多每6个月调整一次，每次调整（如有）不超过±20bp，管理人将在调整生效前的至少1个工作日公布新业绩报酬计提基准，所有投资者均可以在新业绩报酬计提基准生效前的最近一个开放日退出本计划（具体以管理人公告为准），不受锁定期限制，如投资者未在前述开放日退出本计划，则将视为同意业绩报酬计提基准调整，该调整在生效之日起对本集合计划所有存续份额生效。

前述变更对投资者后续投资安排影响较大，请投资者认真阅读本计划变更后的参与退出安排条款、业绩报酬计提相关条款，充分知晓前述参与、退出安排变更所带来的风险，合理安排资金，如不同意本次变更的，请及时向管理人提交不同意申请或者在临时开放期

提交退出申请。

3、根据证监会、基金业协会的最新监管要求、内容与格式要求调整自有资金参与、关联交易与利益冲突、当事人的权利义务等内容并相应调整风险揭示，重要变更内容详见“附件2《方正证券稳盛11号集合资产管理计划合同》变更条款对照表”，部分文字性表述调整未在附件2变更条款对照表中列式的，管理人亦在附件3变更后的新版本合同中以加粗并下划线的方式标注。

本次具体变更全部内容以附件3变更后的新合同版本为准，请投资者阅读并知悉附件3变更后新版本合同。

《方正证券稳盛11号集合资产管理计划说明书》和《方正证券稳盛11号集合资产管理计划风险揭示书》内容按照资管合同同步变更，具体变更条款参见资管合同相应部分，不再单独列示。

本次变更不涉及本计划投资范围、投资限制及投资策略的重大变更。

二、委托人征询意见及委托人回复意见安排

根据原资管合同第二十五部分的规定，管理人已将合同变更事项与托管人协商并达成一致，特于2024年8月6日在管理人网站进行公告及征询委托人意见，并将在2024年8月15日-2024年8月16日设置接受委托人退出的开放期。

委托人同意合同变更的，请在本公告征询意见期（即2024年8月8日-2024年8月14日，含）提交同意变更的回复（格式可参见附件1）；

委托人不同意变更的，应在本公告征询意见期（即2024年8月8日-2024年8月14日，含）提交不同意变更的回复（格式可参附件1）或在指定开放期提出退出本集合计划的申请。

委托人未在前述时间回复意见也未在指定开放日退出计划的，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：对回复不同意合同变更且逾期未提出退出申请的委托人所持有的计划份额，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，退出价格按照退出当日集合计划份额净值计算（如有业绩报酬的，业绩报酬将从退出资金中扣除）。

管理人将根据委托人异议情况宣布本次合同变更是否生效，本次合同变更具体生效时间以管理人公告为准。



委托人填写附件1《关于方正证券稳盛11号集合资产管理计划合同变更的回复意见》或其他形式意见的，可以采用以下任一方式回复我司：

(1) 电子邮件：fanmuhan@foundersc.com

(2) 传真：010-56992717

(3) 邮寄：北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18层方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司（邮编：100020）。

委托人如有疑问，可致电咨询，电话：95571。

特此公告！

附件：

- 1、《关于方正证券稳盛11号集合资产管理计划合同变更的回复意见》
- 2、《方正证券稳盛11号集合资产管理计划合同》变更条款对照表
- 3、新版《方正证券稳盛11号集合资产管理计划合同》（变更内容详见加粗并下划线部分）



附件1

关于方正证券稳盛 11 号集合资产管理计划合同变更的回复意见

委托人姓名（或机构名称）：_____

委托人身份证号码（或统一社会信用代码）：_____

委托人持有份额的产品名称：方正证券稳盛 11 号集合资产管理计划_____

关于 2024 年 8 月 6 日方正证券官方网站《关于方正证券稳盛 11 号集合资产管理计划合同变更的公告》所述关于参与退出安排、业绩报酬计提基准调整等合同变更事项，本委托人在充分阅读前述变更内容并知悉本次变更所带来的风险的基础上，回复意见如下（请划勾“√”确认）：

同意

不同意并申请退出

委托人（签字或盖章）：

法定代表人或授权代表签章：

年 月 日

附件 2: 《方正证券稳盛 11 号集合资产管理计划合同》变更条款对照表

原合同	变更后
	<p>新增:</p> <p>鉴于: 方正证券稳盛 11 号集合资产管理计划已于 2019 年 12 月 4 日成立, 本集合计划成立后, 管理人根据《方正证券稳盛 11 号集合资产管理计划资产管理合同》的约定进行了变更, 自本合同成立并变更生效之日起按本版本合同执行, 原版本合同自动终止, 具体变更内容及变更生效日以管理人发布的公告为准。</p>
<p>一、前言</p> <p>1. 订立本合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》)、《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》)、《集合资产管理计划管理合同内容与格式指引(试行)》、《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》等法律法规、中国证监会和及相关自律组织的有关规定。</p> <p>.....</p> <p>3. 订立本合同的原则是平等自愿、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, 当事人按照《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《方正证券稳盛 11 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。管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案。证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任, 也不代表证券投资基</p>	<p>一、前言</p> <p>1. 订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《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》)、《中华人民共和国期货和衍生品法》、《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》)、《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》)、《集合资产管理计划管理合同内容与格式指引(试行)》、《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》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。</p> <p>.....</p> <p>3. 订立本合同的原则是平等自愿、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, 当事人按照《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《方正证券稳盛 11 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。管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案。证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任, 也不代表证券投资基</p>

<p>企业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。</p>	<p>企业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断，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。</p>
<p>二、释义</p> <p>《管理办法》：指 2018 年 10 月 22 日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；</p> <p>《运作规定》：指 2018 年 10 月 22 日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》；</p> <p>工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所等相关交易所的正常交易日；</p> <p>退出：指委托人按集合资产管理合同规定的条件要求收回全部或部分委托资产的行为；</p>	<p>二、释义</p> <p>《管理办法》：指中国证监会于 2023 年 1 月 12 日发布并于 2023 年 3 月 1 日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；</p> <p>《运作规定》：指中国证监会于 2023 年 1 月 12 日发布并于 2023 年 3 月 1 日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》；</p> <p>工作日、交易日、估值日：指上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所等交易场所的正常交易日；</p> <p>退出：份额持有人按本集合资产管理合同规定的条件全部或部分退出本集合计划份额的行为；</p> <p>新增</p> <p>中债：指中央国债登记结算有限责任公司</p> <p>中证：指中证指数有限公司</p> <p>信义义务：依照《基金法》及本合同之约定，托管人在履行托管职责时，应当恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务。</p> <p>个人信息：是以电子或者其他方式记录的与已识别或者可识别的自然人有关的各种信息，包括但不限于个人身份信息、账户信息，包括但不限于姓名、账号、开户机构、金融账户、身份证或护照等证件类信息、联系方式、联系地址、电子邮箱等；但不包括匿名化处理后的信息。</p> <p>个人信息的处理：包括个人信息的收集、存储、使用、加工、传输、提供、公开、删除等。</p>

三、承诺与声明

(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。
2. 投资者承诺以真实身份参与集合计划，财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。投资者承诺，如委托资金为资产管理产品募集的资金时，将确保资产管理产品的投资者中不包含其他资产管理产品。如委托资金为除公募资产管理产品外的合伙企业、契约等非法人形式，最终投资者满足法律法规、监管规则规定的合格投资者要求，并向管理人提供合法募集资金的证明文件、充分披露实际投资者和最终资金来源，保证所提供证明文件真实、准确、完整、合法。
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，投资于本计划将自行承担投资风险。

三、承诺与声明

(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。
2. 投资者承诺以真实身份参与集合计划，财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。投资者承诺，**如交付的财产为资产管理产品募集的资金时，将确保资产管理产品的投资者中不包含其他资产管理产品。如交付的财产为除公募资产管理产品外的合伙企业、契约等非法人形式**，最终投资者满足法律法规、监管规则规定的合格投资者要求，并向管理人提供合法募集资金的证明文件、充分披露实际投资者和最终资金来源，保证所提供证明文件真实、准确、完整、合法。
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，投资于本计划将自行承担投资风险。
4. 投资者确认并同意，根据法律法规规定及本合同的约定，为配合管理人履行其反洗钱、投资者适当性、反恐怖融资、反贿赂、非居民金融账户涉税信息(CRS)尽职调查、受益所有人识别、产品备案信息报送、份额注册登记等法定义务，以及为履行本资管合同所必需之目的，管理人有权按照法律法规处理投资者的个人信息；对于机构投资者，如涉及提供第三方个人信息的，应当确保提供的个人信息来源合法并且确保管理人处理其个人信息不违反该第三方的授权同

	意,确保管理人有权按照法律法规处理相关个人信息。
<p>四、当事人及权利义务</p> <p>3、委托人的义务</p> <p>(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;</p> <p>(二) 管理人</p> <p>2、管理人权利</p> <p>根据《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:</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>3、管理人义务</p> <p>根据《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:</p> <p>(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</p>	<p>四、当事人及权利义务</p> <p>(一) 委托人</p> <p>2、委托人的权利</p> <p>新增:</p> <p>(8) 投资者为自然人的,对个人信息依法享有并行行使包括但不限于查阅、复制、转移、更正、补充、删除、撤回同意、解释说明等权利,法律、行政法规另有规定的除外。投资人行使前述权利的,具体可联系 95571;</p> <p>3、委托人的义务</p> <p>(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、投资信息等,依法依规提供信息的除外;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;</p> <p>(二) 管理人</p> <p>2、管理人权利</p> <p>根据《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:</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>3、管理人义务</p> <p>根据《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:</p> <p>(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,对所管理的不同资产管理计划的受托财产分</p>

<p>别投资；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(12) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；</p> <p>(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；</p> <p>(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份额净值；</p> <p>(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；</p> <p>(16) 对非标准化资产和相关交易主体（如有）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；</p> <p>(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；</p> <p>(18) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；</p> <p>(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；</p> <p>(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，向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；</p>	<p>别管理，分别记账，进行投资；</p> <p>(8) 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；</p> <p>(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、投资信息等，依法依规提供信息的除外；</p> <p>(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；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；</p> <p>(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；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；</p> <p>(12) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；</p> <p>(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；</p> <p>(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份额净值；</p> <p>(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相关要求和合同的约定；</p> <p>(16) 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（如有）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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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</p>
--	---

<p>(三) 托管人</p> <p>3、托管人的义务</p> <p>(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；</p> <p>(9) 编制托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；</p>	<p>度、年度等定期报告；</p> <p>序号顺延</p> <p>(三) 托管人</p> <p>3、托管人的义务</p> <p>(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输送利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；</p> <p>(9) 编制托管年度报告，并报送中国证监会相关派出机构；</p> <p>新增：</p> <p>(16) 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；</p> <p>(17) 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；</p> <p>(18) 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；</p> <p>序号顺延</p>
<p>五、资产管理计划的基本情况</p> <p>(五) 投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级</p> <p>3、投资比例</p> <p>⑥ 权益类资产：不高于资产总值的 20%，包括可交换债交换转股及可转债转股所带来的被动持有的股票，原则上可交换债交换转股及可转债转股后需在可交易日起 1 个月内卖出，但若因股票停牌等原因无法卖出的，则管理人应在前述限制解除之日起的 15 个交易日内卖出。</p>	<p>五、资产管理计划的基本情况</p> <p>(五) 投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级</p> <p>3、投资比例</p> <p>⑥ 权益类资产：不高于资产总值的 20%，包括可交换债交换转股及可转债转股所带来的被动持有的股票，原则上可交换债交换转股及可转债转股后需在可交易日起 1 个月内卖出，但若因股票停牌等原因无法卖出的，则管理人应在前述限制解除之日起的 20 个交易日内卖出。</p> <p>新增：</p> <p>⑦ 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其净资产的 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</p>

<p>(十) 封闭期、开放期以及流动性安排：</p> <p>1、本集合计划定期开放赎回退出，每季度开放参与不超过十二次，每次开放一个工作日，且相邻两个开放日期不连续。非开放期均为封闭期，封闭期内不接受参与、退出等业务。初始募集期及各参与开放期内新增参与份额的锁定期原则上为9个月，自参与份额确认日起算，锁定期内不得退出。各份额锁定期期满后的下一个工作日管理人为解除锁定的份额办理退出，具体锁定期日期等退出事宜以管理人公告为准。</p> <p>本集合计划合同变更时，管理人将公告临时开放期，委托人可在合同变更临时开放期退出集合计划。</p> <p>2、流动性安排</p> <p>开放退出期内，本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本计划资产净值的20%，7个工作日可变现资产的价值不低于该计划资产净值的10%。流动性受限资产，是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。7个工作日可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。</p>	<p>监会认可的投资品种不受前述规定限制。</p> <p>(十) 封闭期、开放期以及流动性安排：</p> <p>1、封闭期：除开放期以外的期间为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。</p> <p>2、开放期：</p> <p>参与安排：本集合计划每周二（如遇非工作日，则不顺延）为参与开放期，委托人可在该参与开放期内办理参与业务。</p> <p>退出安排：投资者持有的份额自参与日起（含参与日，下同）满273天的下一日（如为非工作日，则顺延至下一工作日）为退出开放日，期间封闭运作，投资者仅可在该退出开放日办理退出业务；若投资者未在该退出开放日退出的，则投资者持有的份额进入第二个锁定期（273天），即该份额需继续封闭至自份额参与日起满546（273天*2）天的下一日（如遇非工作日，则顺延至下一个工作日）方可退出，以此类推。如果管理人按照本合同约定调整业绩报酬计提基准的，所有投资者均可以在新业绩报酬计提基准生效前的最近一个开放日退出本计划（具体以管理人公告为准），不受份额锁定期限制，前述开放日委托人所持份额未退出的，其所持份额锁定期仍按照该份额参与日起计算。</p> <p>本集合计划合同变更时，管理人将公告临时开放期，委托人可在合同变更临时开放期退出集合计划。</p> <p>2、流动性安排</p> <p>开放退出期内，本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本计划资产净值的20%，7个工作日可变现资产的价值不低于该计划资产净值的10%。流动性受限资产，是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让</p>
--	--

	<p>或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。7个工作日可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。</p>
<p>六、资产管理计划的募集</p> <p>(一) 资产管理计划的募集对象、募集方式和募集期限</p> <p>1、募集对象</p> <p>本集合计划应当面向合格投资者，合格投资者累计不得超过 200 人。委托人应确保自身符合合格投资者条件。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。</p> <p>(3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>(5) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；</p> <p>(四) 计划份额认购金额及付款期限</p> <p>投资者在募集期间的认购金额应不低于 30 万元人民币（不含认购费），追加参与的最低金额为人民币 10000 元的整数倍。</p>	<p>六、资产管理计划的募集</p> <p>(一) 资产管理计划的募集对象、募集方式和募集期限</p> <p>1、募集对象</p> <p>本集合计划应当面向合格投资者，合格投资者累计不得超过 200 人。委托人应确保自身符合合格投资者条件。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。</p> <p>(3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>(5) 基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；</p> <p>(四) 计划份额认购金额及付款期限</p> <p>投资者在募集期间的认购金额应不低于 30 万元人民币（不含认购费），追加参与的最低金额为人民币 1 万元。</p>
<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p> <p>(二) 参与和退出的开放日及时间</p> <p>集合计划投资者可在本集合计划开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本集合计划，但集合计划管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申</p>	<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p> <p>(二) 参与和退出的开放日及时间</p> <p>参与安排：本集合计划每周二（如遇非工作日，则不顺延）为参与开放期，委托人可在该参与开放期内办理参与业务。</p> <p>退出安排：投资者持有的份额自参与日起</p>

购和/或赎回通知时除外。

本集合计划定期开放赎回退出，每季度开放参与不超过十二次，每次开放一个工作日，且相邻两个开放日期不连续。非开放期均为封闭期，封闭期内不接受参与、退出等业务。初始募集期及各参与开放期内新增参与份额的锁定期原则上为9个月，自参与份额确认日起算，锁定期内不得退出。各份额锁定期期满后下一个工作日管理人为解除锁定的份额办理退出，具体锁定期日期等退出事宜以管理人公告为准。

(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认

③退出款项划付

委托人的退出申请确认后，退出款项将在T+2日内从托管账户划出，T+7个工作日内到账。

(十一) 延期支付及延期退出的情形和处理方式：

发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，管理

(含参与日，下同)满273天的下一日(如为非工作日，则顺延至下一工作日)为退出开放日，期间封闭运作，投资者仅可在该退出开放日办理退出业务；若投资者未在该退出开放日退出的，则投资者持有的份额进入第二个锁定期(273天)，即该份额需继续封闭至自份额参与日起满546(273天*2)天的下一日(如遇非工作日，则顺延至下一个工作日)方可退出，以此类推。如果管理人按照本合同约定调整业绩报酬计提基准的，所有投资者均可以在新业绩报酬计提基准生效前的最近一个开放日退出本计划(具体以管理人公告为准)，不受份额锁定期限制，前述开放日委托人所持份额未退出的，其所持份额锁定期仍按照该份额参与日起计算。

本集合计划可根据销售机构政策采用预约退出安排，预约退出的办理方式具体以销售机构的规则为准。

本集合计划合同变更时，管理人将公告临时开放期，委托人可在合同变更临时开放期退出集合计划。

(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认

③退出款项划付

委托人的退出申请确认后，退出款项将在T+2日内从托管账户划出，T+7个工作日内到账。本计划向投资者支付的受托资金及收益将返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或者同名账户。

(十一) 延期支付及延期退出的情形和方式：

新增：

5、发生继续接受赎回申请将损害现有集合计划份额持有人利益的情形时，管理人可暂停接受集合计划份额持有人的赎回申请。

发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支

<p>人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p> <p>(十二) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式；</p> <p>(6) 销售机构对委托人资金来源表示疑虑，委托人不能提供充分证明的；</p> <p>(十六) 管理人自有资金参与集合计划 管理人可以自有资金参与本集合计划份额。</p> <p>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《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》和中国证监会及自律组织的相关规定。</p> <p>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单个集合资产管理计划的份额合计不得超过该计划总份额的 50%。</p> <p>3、若管理人以自有资金参与本计划的，管理人持有本集合计划的期限不得低于 6 个月，参与、退出时，应当提前 5 个工作日通过管理人网站公告告知投资者和托管人。因集合资产管理计划规模变动等客观因素导</p>	<p>付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。集合计划份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。</p> <p>(十二) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式；</p> <p>(6) 委托人未按照管理人或销售机构的要求提供投资者适当性管理、反洗钱调查相关资料的或者委托人不符合《投资者适当性管理办法》、《中华人民共和国反洗钱法》、《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关法律法规、监管规定要求以及管理人和销售机构的投资者适当性管理、反洗钱、非居民金融账户涉税信息尽职调查制度的，管理人和销售机构有权拒绝委托人的参与申请；</p> <p>新增：</p> <p>(8) 发生集合资产管理合同规定的暂停集合计划资产估值情况；</p> <p>(9) 其他可能对本集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有委托人利益的情形；</p> <p>(十六) 管理人自有资金参与集合计划</p> <p>1、自有资金参与的条件：管理人及其子公司以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》和中国证监会及自律组织的相关规定。</p> <p>2、自有资金参与的金额和比例：管理人及其子公司如以自有资金参与本集合计划，具体参与比例视情况而定。管理人以自有资金参与本集合计划的比例不超过集合计划总份额（含管理人自有资金）的 16%。管理人及其子公司以自有资金参与单个集合资产管理计划的份额合计不得超过该计划总份额的 50%。</p> <p>3、投资者和托管人同意，管理人及其子公司有权在产品募集期以自有资金参与本计划。</p>
---	---

致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规规定比例的，管理人有权在合理期限内安排自有资金退出，可不受上述限制。管理人以自有资金参与本计划的持有期限超过6个月的，管理人有权安排自有资金退出。

4、自有资金责任承担方式和金额：管理人自有资金享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。管理人自有资金参与部分不构成对委托人本金及收益的保证，也不保证委托人份额本金不受损失，不对其他委托人参与的份额承担任何补偿责任。

5、收益分配以管理人的公告为准。

6、为应对巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，但需事后及时告知委托人和托管人，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要求进行备案、报送。

若管理人及其子公司以自有资金参与本计划的，持有本集合计划的期限不得低于6个月。管理人及其子公司在存续期参与、退出时，应当提前5个工作日通过电子邮件（托管人联系邮箱为：gd_tzjd.gd@ccb.com、gd_tgsc.gd@ccb.com

、gd_tztg.gd@ccb.com）的方式告知托管人，托管人通过前述邮箱回复意见。如联系邮箱发生变更，管理人或托管人可通过原联系邮箱指定新的联系邮箱。管理人及其子公司在存续期参与、退出时，提前5个工作日通过管理人网站公告告知投资者，公告期内，投资者未对管理人或其子公司自有资金参与、退出提出异议的，视为投资者同意，管理人及其子公司将按照公告参与或退出本计划。投资者不同意的，应当按照公告约定的方式在公告期内向管理人提出异议，管理人将于公告期满次个交易日对按规定方式提出异议的委托人办理赎回以保障投资者退出权利，届时委托人将按照管理人办理赎回日的净值赎回本计划全部份额。

因集合资产管理计划规模变动等客观因素导致管理人及其子公司自有资金参与集合计划被动超过本条“自有资金参与的金額和比例”约定比例的及法律、法规规定的比例的，管理人及其子公司有权在合理期限内安排自有资金退出，可不受上述限制，无需委托人和托管人事先同意，但需事后及时告知委托人和托管人。

4、自有资金责任承担方式和金额：管理人及其子公司自有资金享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。管理人及其子公司自有资金参与部分不构成对委托人本金及收益的保证，也不保证委托人份额本金不受损失，不对其他委托人参与的份额承担任何补偿责任。

5、收益分配以管理人的公告为准。

6、为应对巨额退出，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，管理人及其子公司以自有资金参与及其后续退出可

	<p>不受上述限制,但需事后及时告知委托人和托管人,并向中国证监会相关派出机构报告。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资 (二) 投资范围及比例 2、资产配置比例 ⑥权益类资产: 不高于资产总值的 20%, 包括可交换债交换转股及可转债转股所带来的被动持有的股票, 原则上可交换债交换转股及可转债转股后需在可交易日起 1 个月内卖出, 但若因股票停牌等原因无法卖出的, 则管理人应在前述限制解除之日起的 15 个交易日内卖出。</p> <p>(三) 投资比例超限的处理方式及流程 如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素, 造成集合计划投资比例超标, 管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个工作日内将投资比例降至许可范围内。计划持有债券资产期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 管理人应在评级报告发布之日起且具备交易条件的 10 个工作日内予以全部卖出。</p> <p>(十) 资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配 开放退出期内, 其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于该计划资产净值的</p>	<p>十一、资产管理计划的投资 (二) 投资范围及比例 2、资产配置比例 ⑥权益类资产: 不高于资产总值的 20%, 包括可交换债交换转股及可转债转股所带来的被动持有的股票, 原则上可交换债交换转股及可转债转股后需在可交易日起 1 个月内卖出, 但若因股票停牌等原因无法卖出的, 则管理人应在前述限制解除之日起的 20 个交易日内卖出。</p> <p>新增: ⑦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其净资产的 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>委托人在此同意并授权管理人可以按照本合同第十四章的规定进行关联交易。本计划发生关联交易的, 管理人在交易完成后应告知委托人和托管人, 并按照现行法律法规、自律规则向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>(三) 投资比例超限的处理方式及流程 如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素, 造成集合计划投资比例超标, 管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个工作日内将投资比例降至许可范围内。计划持有债券资产期间, 如果其信用等级下降、不再符合投资标准, 管理人应在评级报告发布之日起且具备交易条件的 20 个工作日内予以全部卖出。</p> <p>(十) 资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配 开放退出期内, 其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于该计划资产净值的</p>

<p>10%。7 个工作日可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具以及同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。</p>	<p>10%。7 个工作日可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。</p>
<p>十四、利益冲突及关联交易</p>	<p>十四、关联交易及利益冲突</p> <p>(一) 关联交易</p> <p>1、关联方范围</p> <p>管理人制定了《方正证券股份有限公司资产管理产品关联交易管理办法》(简称“《关联交易办法》”)，对关联交易进行内部规制。根据《关联交易办法》，本计划关联方是指在资管产品的投资管理过程中，能对资管产品直接或间接控制或施加重大影响的主体，包括本计划管理人及其管理的资管产品；本计划托管人；按照《企业会计准则》确定的管理人的关联方及其管理的资管产品；资管产品的托管人的关联方，即控股股东、实际控制人及与其有重大利害关系的公司等。管理人及其关联方、托管人及其关联方详见中国证监会指定上市公司信息披露网站“巨潮资讯网”(网址：www.cninfo.com.cn)及管理人官方网站(网址：www.foundersec.com)、托管人公开披露的最新报告中股东变动、主要股东持股情况、财务报表附注等章节涉及的关联方为准并参考这些主体发行或承销的证券。</p> <p>2、关联交易类型</p> <p>根据《关联交易办法》，本计划关联交易指资管产品在投资运作中与关联方发生的所有交易，包括但不限于投资于管理人、资管产品托管人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理计划；与关联方开展证券等交易，交易对手方、质押券涉及关联方；投资于关联方的非标准化股权类资产及债权类资产；法律法规及中国证监会规定为关联交易的其他事项。</p> <p>3、一般关联交易和重大关联交易的区分标准</p>

根据《关联交易办法》，本计划重大关联交易是指管理人运用单只资产管理计划财产投资于管理人、产品托管人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的单只证券单笔金额超过 1 亿元或投资比例超过产品净资产的 20%；投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理计划单笔投资金额超过 1 亿或投资比例超过产品净资产的 20%；直接或间接投资于关联方的非标准化股权类资产或债权类资产，单笔投资金额超过 1 亿元或投资比例超过产品净资产的 20%；与管理人及其关联方作为交易对手开展证券等交易的，单笔交易金额超过 1 亿元或超过产品净资产的 20%的（《关联交易办法》另有规定的除外）；质押券涉及管理人及其关联方的，单笔交易金额按照单笔融出本金计算。

一般关联交易是指除上述重大关联交易以外的关联交易。

4、重大关联交易的征询

本计划原则上不进行重大关联交易。本计划拟进行重大关联交易的，应当至少提前 3 个工作日公告。公告期内，投资者未对该笔重大关联交易提出异议的，视为投资者同意。投资者不同意的，应当按照公告约定的方式在公告期内向管理人提出异议，管理人将于公告期满次个交易日对按规定方式提出异议的委托人办理赎回以保障投资者退出权利，届时委托人将按照管理人办理赎回日的净值赎回本计划全部份额。

5、一般关联交易的授权

除重大关联交易外，委托人同意并授权管理人以本计划进行一般关联交易。本计划发生一般关联交易的，管理人在交易完成后定期统一向投资者和托管人披露，并向中国证监会派出机构报告。

6、关联交易审批等内部管控机制

根据《关联交易办法》，本计划进行一般关联交易的，应经投资所在部门行政负责人、资产管理业务管理部风控团队及合规团队、风险管理部、合规部、资管分公司总经理审批后方可执行。本计划进行重大关联交易

<p>1、存在或可能存在利益冲突的情形</p> <p>(1) 集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券。</p> <p>(2) 集合计划管理人运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。</p> <p>(3) 本计划的期货经纪商为方正中期期货有限公司，为管理人的子公司，此关联关系可能导致利益冲突。</p> <p>2、存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率</p>	<p>的，除按照前述审批程序外还需提交分管高管审批后方可执行，《关联交易办法》另有规定的除外。</p> <p>对于本计划投资于托管人及其关联方发行的同业存单、与托管人及其关联方进行的存款（包括但不限于银行活期存款、银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、进行债券回购（含交易对手方或质押券涉及及其关联方的正回购和逆回购）、现券买卖及债券借贷交易等在资产管理计划正常业务中发生的关联交易，由投资经理决策，无需经过前述关联交易审批程序。</p> <p>7、委托人知悉并同意管理人按照《关联交易办法》界定本计划关联方范围、关联交易范围、重大关联交易范围及关联交易内部审批程序等，管理人有权根据监管规定或内部管理需要对《关联交易办法》进行不时修订。管理人修订前述制度涉及本合同约定的关联方范围、关联交易范围、重大关联交易范围及关联交易内部审批程序等内容的，管理人应当及时公告，并按照新制度执行，无需按照本合同约定履行合同变更程序，《关联交易办法》与最新法律法规或中国证监会、基金业协会相关规定、要求不一致的，管理人将直接按照法律法规或监管规定执行。</p> <p>(二) 存在或可能存在利益冲突的情形</p> <p>集合计划管理人运用集合计划财产与集合计划管理人、集合计划托管人及其他关联方进行关联交易及其他可能存在利益冲突的情况，包括但不限于：</p> <p>(1) 本集合计划通过管理人席位或交易单元进行的交易并向管理人支付佣金；</p> <p>(2) 选择管理人的关联方方正中期期货有限公司作为期货经纪商的；</p> <p>(3) 其他可能存在利益冲突的情况。</p> <p>委托人签署本协议即视为其同意前述安排，并知悉由此可能导致的利益冲突，并愿意承担由此带来的风险。</p> <p>(三) 存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率</p> <p>1、存在利益冲突的处理方式</p>
--	--

<p>(1) 存在利益冲突的处理方式</p> <p>集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券,但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。</p> <p>集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品;集合计划管理人可聘请子公司方正中期期货有限公司为本计划提供期货经纪服务,但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。</p> <p>托管人关联方以其披露的年度报告关联方名单为准。</p> <p>集合计划投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意本集合计划将进行上述关联交易。</p> <p>集合计划份额持有人不得因本集合计划投资收益劣于集合计划管理人及其关联方管理的其他类似投资产品,而向集合计划管理人或集合计划托管人提出任何损失或损害补偿的要求。</p> <p>(3) 发生利益冲突情形信息披露的内容和时间</p> <p>1、定期报告</p> <p>发生利益冲突情形需在集合计划的资产管理季度(年度)报告进行信息披露。</p> <p>2、临时报告</p> <p>集合计划存续期间,管理人运用受托管理资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券的,应当按照规定编制信息披露公告,披露下列信息:</p> <p>(1) 交易概述;</p> <p>(2) 交易各方的关联关系;</p>	<p>集合计划管理人可按照监管规定及本合同约定以本计划进行关联交易。本计划进行关联交易的,管理人应当按照关联交易的性质及公司制度规定履行内部关联交易审批程序,遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突的原则。</p> <p>集合计划投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意本集合计划关于关联交易的相关安排。</p> <p>集合计划份额持有人不得因本集合计划投资收益劣于集合计划管理人及其关联方管理的其他类似投资产品,而向集合计划管理人或集合计划托管人提出任何损失或损害补偿的要求。</p> <p>3、发生利益冲突情形信息披露的内容和时间</p> <p>(1) 定期报告</p> <p>发生重大关联交易情形需在集合计划的资产管理季度(年度)报告进行信息披露。</p> <p>(2) 临时报告</p> <p>集合计划存续期间,管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的,应当按照规定编制信息披露公告,披露下列信息:</p> <p>①交易概述;</p> <p>②交易各方的关联关系;</p> <p>③交易的主要内容,包括交易标的的代码(如有)、价格、数量、金额等;</p>
---	---

<p>(3) 交易的主要内容, 包括交易标的的代码(如有)、价格、数量、金额等;</p> <p>(4) 管理人认为应当披露的其他信息。</p> <p>上述事项发生后 10 个工作日内(无交易协议的, 自事项发生之日起 10 个工作日内), 管理人按照规定在管理人网站发布信息披露公告。</p>	<p>④管理人认为应当披露的其他信息。</p> <p>本集合计划运用受托管理资产从事重大关联交易的, 应当于交易完成后 5 个工作日内, 按照规定在管理人网站发布信息披露公告。</p>
<p>十五、投资经理的指定与变更</p> <p>1、投资经理的指定</p> <p>资产管理计划投资经理由管理人负责指定。本集合计划的投资经理为韩阳先生, 简介如下:</p> <p>韩阳, 男, 华东理工大学财务管理学士, 具有多年银行及非银行金融机构投资管理从业经历, 拥有中国银行间本币交易员和外汇交易员资格。历任瑞穗银行(中国)金融市场部交易员助理, 瑞穗银行(中国)金融市场部外汇和资金交易员, 西门子财务服务有限公司投资组合高级交易员。现担任方正证券股份有限公司北京证券资管分公司证券投资部高级副总裁、投资经理。无兼职情况, 通过基金从业资格考试, 最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p>	<p>十五、投资经理的指定与变更</p> <p>1、投资经理的指定</p> <p>资产管理计划投资经理由管理人负责指定。本计划的投资经理为: 韩阳、刘玉立。</p> <p>韩阳, 男, 北京大学金融学硕士, 伦敦大学学院工商管理硕士, 华东理工大学财务管理学士, FRM, 具有多年金融机构投资管理从业经历。历任瑞穗银行金融市场部资金、外汇及衍生品交易员, 西门子全球市场部司库投资经理等。现担任方正证券股份有限公司北京证券资管分公司资管债券投资部联席行政负责人、投资经理。</p> <p>刘玉立, 女, 中央财经大学硕士, 历任华金证券自营交易员、度小满金融投资经理、英大保险资产管理有限公司投资经理, 现担任方正证券股份有限公司北京证券资管分公司资管债券投资部投资经理。具备丰富的投资交易经验, 擅长信用债挖掘、多策略投资。上述两位投资经理均未有对外兼职情况, 均已取得基金从业资格, 且已在基金业协会登记为私募资产管理业务投资经理。</p>
<p>十八、交易及交收清算安排</p> <p>(二) 投资证券后的清算交收安排</p> <p>1、结算备付金与保证金</p> <p>根据中国结算规定, 在每月前 3 个交易日内, 中国结算对结算参与人的最低结算备付金、结算保证金限额进行重新核算、调整。托管人在中国结算调整最低结算备付金、结算保证金当日, 在《资金账户报告》中反映调整后的最低备付金和结算保证金。管理人应预留最低备付金和结算保证金, 并根据中国结算确定的实际最低备付金、结算保证金数据为依据安排资金运作, 调整所需的现金头寸。如因调整最低备付金、结算保证金后</p>	<p>十八、交易及交收清算安排</p> <p>(二) 投资证券后的清算交收安排</p> <p>1、结算备付金与保证金</p> <p>中国结算分别于每月前 6 个交易日及每月前 3 个交易日内, 对结算参与人最低备付金限额与结算保证金限额进行重新核算、调整。资产托管人应分别于每月前 3 个交易日内及结算保证金调整当日通过《资金账户报告》通知资产管理人本计划最低备付金调整金额以及调整后的结算保证金金额。资产管理人应预留最低备付金和结算保证金, 并根据中国结算确定的实际最低备付金、结算保证金数据为依据安排资金运作, 调整所需的</p>

<p>造成透支，管理人应在调整最低备付金、结算保证金当日上午 12:00 之前补足透支款。</p> <p>2、清算交收</p> <p>如因管理人原因导致资金头寸不足，管理人应在 T+1 日上午 12:00 前补足头寸，确保资金交收。</p> <p>实行场内 T+0 非担保交收的资金清算按照托管人的相关规定流程执行。</p> <p>(八) 投资银行存款的特别约定</p> <p>1、管理人和托管人的职责</p> <p>管理人负责对本集合计划存款银行的评估与研究，建立健全银行定期存款的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度，切实防范有关风险。</p> <p>(1) 管理人负责控制信用风险。信用风险</p>	<p>现金头寸。如因调整最低备付金、结算保证金后造成透支，资产管理人应视资产托管人最低结算备付金比例计收方式分别于下列时点补足透支金额：</p> <p>(1) 固定备付金比例计收方式下，资产管理人应在调整最低备付金、结算保证金当日上午 11:00 之前补足金额。</p> <p>(2) 差异化备付金比例计收方式下，资产管理人应最晚于资金交收日 8:30 前补足金额</p> <p>2、清算交收</p> <p>如因管理人原因导致资金头寸不足，管理人应视资产托管人最低结算备付金比例计收方式分别于下列时点补足透支金额：</p> <p>(1) 固定备付金比例计收方式下，资产管理人应最晚于资金交收当日上午 11:00 之前补足金额。</p> <p>(2) 差异化备付金比例计收方式下，资产管理人应最晚于资金交收日 8:30 前补足金额。</p> <p>如果未遵循上述规定备足资金头寸，影响了集合计划资产自身的清算交收及托管人与中证登记公司之间的一级交收，由此给托管人、本计划财产及托管人托管的其他资产造成的损失由管理人负责。</p> <p>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。</p> <p>(八) 投资银行存款的特别约定</p> <p>1、资产管理人和资产托管人的职责</p> <p>资产管理人应当加强对本产品投资银行存款风险的评估与研究，建立健全银行存款投资的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度，严格测算与控制投资银行存款的风险敞口，针对不同类型存款银行建立</p>
---	---

主要包括存款银行的信用等级、存款银行的支付能力等涉及到存款银行选择方面的风险。因选择存款银行不当造成集合计划财产损失的，托管人不承担任何责任。

(2) 管理人负责控制流动性风险，对于因控制流动性风险不力而造成的损失，托管人不承担任何责任。流动性风险主要包括管理人要求全部提前支取、部分提前支取或到期支取而存款银行未能及时兑付的风险、集合计划投资银行存款不能满足集合计划正常结算业务的风险等涉及到集合计划流动性方面的风险。

(3) 管理人须加强内部风险控制制度的建设。如因管理员工的个人行为导致集合计划财产受到损失的，需由管理人承担由此造成的损失。

(4) 托管人对银行存款投资监督的准确性和完整性受限于管理人、存款银行提供的数据和信息，合规投资的最终责任在管理人。托管人无投资责任，对任何管理人的银行存款投资行为或其投资回报不承担任何责任。托管人负责复核集合计划银行存款业务的相关协议、划款指令、支取指令等有关文件，切实履行托管职责。托管人只负责对存款开户证实书进行保管，不负责存款开户证实书真伪的辨别，不承担存款开户证实书对应存款的本金及收益的安全。

2、相关协议的签署

管理人在投资银行存款之前，需与存款银行签订具体存款协议。具体存款协议或其他托管人认可的书面材料应包括但不限于以下内容：

(1) 存款账户必须以集合计划名义开立，预留托管人指定印鉴，账户名称为本集合计划名称。

(2) 协议须约定存款类型、期限、利率、计息方式、金额、账号、起止时间，存款银行经办行名称、地址及进款账户。

(3) 协议须约定将为本计划在托管人指定营业机构开立的托管账户指定为唯一回款账户，任何情况下，存款银行都不得将存款

相关投资限制制度，切实防范有关风险。由于资产管理人提前支取或部分提前支取存款投资导致的息差(即本产品已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额)，资产管理人负责解决。

资产托管人负责依据资产管理人提供的银行存款投资合同/协议、投资指令、支取通知等有关文件办理资金的支付以及存款证实书的接收、保管与交付，切实履行托管职责。资产托管人负责依据托管合同的约定对存款开户证实书(如有)进行保管，不负责存款开户证实书真伪的辨别，存款开户证实书(如有)对应存款的本金及收益的安全由资产管理人负责。

2、办理资产管理计划投资银行存款的开户、全部提前支取、部分提前支取或到期支取，可采取以下方式之一：

(1) 由资产管理人和资产托管人的授权代表持授权委托书共同全程办理。

(2) 由存款银行/资产管理人提供上门送、取单服务。在上门送、取单时，存款银行/资产管理人经办人员应携带单位介绍信/授权书以及个人身份证件，以便资产托管人进行核查。

(3) 资产管理人与资产托管人双方协商一致的其他办理方式。

3、本产品投资银行存款或办理存款支取时，资产管理人需提前发送银行存款投资合同/协议、投资指令、支取通知等有关文件到资产托管人处，以便资产托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。

4、如发生逾期支取，资产托管人不承担相应利息损失及逾期支取手续费。

5、本产品投资银行存款时，应本着便于存款证实书(如有)安全保管和日常监督检查的原则，尽可能选择托管账户开户行所在地的银行机构办理。

6、对于已移交资产托管人保管的存款开户证实书(如有)等实物凭证，资产托管人应确保安全保管；对未按约定将存款开户证实书等实物凭证移交资产托管人保管的，资产

<p>本息划往任何其他账户。</p> <p>(4) 资金划转过程中存款银行需要使用过渡账户的,存款银行须保证资金在过渡账户中不出现滞留,不被挪用。</p> <p>(5) 存款银行有义务保证本计划存款投资在存续期内的安全。</p> <p>(6) 协议须约定存款银行不得接受管理人或托管人任何一方单方面提出的对该银行存款进行更名、转让、挂失、质押、担保、撤销变更印鉴及回款账户信息等任何可能导致财产转移的申请。</p> <p>(7) 协议须明确,存款证实书需要由存款银行/管理人提供上门送、取单服务,存款协议中需明确送单截止日期,除非存款合同中已明确约定存款银行不为本合同项下存款出具存款证实书或其他实物权利凭证且承诺于存款到期日无条件将存款的本金及利息划回托管账户。管理人/存款银行对存款证实书的真实性负责,并承担移交过程中由于存款证实书丢失、损毁、被人为调换等所引发的一切后果。正常情况下,同城存款银行应在存款证实书开立后 3 个工作日内将原件移交托管行保管;异地存款银行应在存款证实书开立后 10 个工作日内将原件移交资产托管人保管。</p> <p>(8) 存款投资存续期间,存款银行经办行须向管理人、托管人提供定期对账服务以及实时查询定期存款余额的途径并确保查询。</p> <p>3、办理集合计划投资银行存款的开户、全部提前支取、部分提前支取或到期支取,由存款银行/管理人提供上门送、取单服务。在上门送、取单时,存款银行/管理人经办人员应携带单位介绍信/授权书以及个人身份证件,以便托管人进行核查。</p> <p>4、集合计划投资银行存款或办理存款支取时,管理人需提前发送银行存款投资合同/协议、划款指令或支取通知到托管人处,以便托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。</p> <p>5、如发生逾期支取,托管人不承担相应利息损失及逾期支取手续费。</p>	<p>托管人应向资产管理人进行必要的催缴和风险提示;提示后仍不将相关实物凭证送达资产托管人保管的,出于托管履职和尽责,资产托管人可视情况采取必要的风险控制措施:(1) 建立风险预警机制,对于实物凭证未送达集中度较高的存款银行,主动发函资产管理人尽量避免在此类银行进行存款投资;(2) 在定期报告中,对未按约定送达资产托管人保管的实物凭证信息进行规定范围信息披露;(3) 未送达实物凭证超过送单截止日后 30 个工作日,且累计超过 3 笔(含)以上的,部分或全部暂停配合资产管理人办理后续新增存款投资业务,直至实物凭证送达托管人保管后解除。实物凭证未送达但存款本息已安全划回托管账户的,以及因发生特殊情况由资产管理人提供相关书面说明并重新承诺送单截止时间的,可剔除不计。</p>
---	--

<p>6、资产管理计划投资于银行存款时，应本着便于集合计划的安全保管和日常监督检查的原则，尽可能选择托管人经办行所在地的分支机构办理。</p> <p>7、对于已移交托管人保管的存款开户证实书等实物凭证，托管人应确保安全保管；对未按约定将存款开户证实书等实物凭证移交托管人保管的，托管人应向管理人进行必要的催缴和风险提示；提示后仍不将相关实物凭证送达托管人保管的，出于托管履职和尽责，托管人可视情况采取发函提示、报告披露、暂停配合管理人办理新增存款投资业务等必要的风险控制措施。</p>	
<p>二十、资产管理计划的估值和会计核算</p> <p>(一) 集合计划的估值</p> <p>7、估值方法</p> <p>(1) 证券投资基金估值方法</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(4) 债券估值方法</p> <p>①在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；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，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p>	<p>二十、资产管理计划的估值和会计核算</p> <p>(一) 集合计划的估值</p> <p>7、估值方法</p> <p>(1) 证券投资基金估值方法</p> <p>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。</p> <p>在证券交易所交易、登记的上市流通封闭式基金、ETF基金、场内登记的LOF基金等，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。在场外交易、登记的开放式基金(含场外登记的LOF基金)按前一日基金份额净值估值。估值日未公布前一日基金份额净值的，以最近公布的基金份额净值估值；在基金首次公布份额净值之前按照购入成本估值。</p> <p>未上市的封闭式基金按估值日的份额净值估值，若估值日未公布份额净值，按最近公布的份额净值估值。</p> <p>(4) 债券估值方法</p> <p>①对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值机构(中证)提供的相应品种当日的估值净价；</p> <p>②对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值机构(中证)提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价；对于含投资人回售</p>

<p>②在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去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所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p> <p>③首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>④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。交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债，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，按成本进行后续计量。</p> <p>⑤在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。</p> <p>⑥对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，按照成本估值。</p> <p>⑦在机构间私募产品报价与服务系统发行的债券以成本估值。在持有期按票面利率每日计提应收利息。</p> <p>⑧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。</p>	<p>权的固定收益品种，回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值；</p> <p>③对在交易所上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值全价，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。估值日没有报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，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。如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的，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；</p> <p>④对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债，主要选取第三方估值机构(中证)提供的估值价格进行估值。</p> <p>⑤对银行间市场上不含权的固定收益品种，选取第三方估值机构(中债)提供的相应品种当日的估值净价；</p> <p>⑥对银行间市场上含权的固定收益品种，选取第三方估值机构(中债)提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值；</p> <p>⑦对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值；</p> <p>⑧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。</p> <p>(5) 国债期货的估值</p> <p>国债期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。</p> <p>(6) 股票估值方法</p> <p>①上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。</p> <p>②上市流通股估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发</p>
---	---

<p>13、特殊情况的处理</p> <p>(1) 管理人或托管人按估值方法的第 6 项进行估值时,所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。</p>	<p>行机构未发生影响证券价格的重大事件,以最近交易日的收盘价估值。</p> <p>③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公允价值的前提下,按成本价估值。</p> <p>④送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在证券交易所上市同一股票的收盘价进行估值。</p> <p>⑤在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股票、首次公开发行股票时股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股,按以下方法估值:</p> $FV = S \times (1 - LoMD)$ <p>其中:</p> <p>FV: 估值日该流通受限股票的价值</p> <p>S: 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值</p> <p>LoMD: 该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣,该流动性折扣一般由中证指数有限公司发布提供。</p> <p>(7) 对于以摊余成本计量的固定收益品种,管理人应结合交易对手方信用风险情况等因素综合判断并计量预期信用损失。</p> <p>13、特殊情况的处理</p> <p>(1) 管理人或托管人按前述估值方法进行估值时,所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。</p>
<p>二十一、资产管理计划的费用与税收</p> <p>(一) 费用种类</p> <p>1、管理人的管理费和业绩报酬</p> <p>(二) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>2、管理人管理费计提和支付:</p> <p>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,管理费的年费率为 0.30%。计算方法如下:</p> $H = E \times 0.30\% \div 365$ <p>H 为每日应计提的集合计划管理费</p> <p>E 为前一自然日集合计划资产净值</p>	<p>二十一、资产管理计划的费用与税收</p> <p>(一) 费用种类</p> <p>1、管理人的固定管理费和业绩报酬</p> <p>(二) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>2、管理人管理费计提和支付:</p> <p>管理费包含固定管理费和业绩报酬。</p> <p>(1) 固定管理费</p> <p>本集合计划的固定管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提,固定管理费的年费率为 0.30%。计算方法如下:</p> $H = E \times 0.30\% \div 365$ <p>H 为每日应计提的集合计划固定管理费</p> <p>E 为前一自然日集合计划资产净值</p>

管理人的管理费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次，经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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) 同一委托人不同时间多次参与的，对委托人所持每笔份额分别计算年化收益率计提业绩报酬；

(2) 在收益分配日、委托人份额退出日和集合计划终止日（即“业绩报酬计提日”）对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬。为避免歧义，就单笔份额而言，其业绩报酬计提日是指该笔份额的实际业绩报酬计提日；

(3) 业绩报酬核算期是指针对委托人所持有的每笔份额，上一个管理人实际计提了业绩报酬的业绩报酬计提日（以下简称：上一业绩报酬计提日；如上一个业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日或委托人份额参与当日）至本次业绩报酬计提日期间；

(4) 在收益分配日计提的业绩报酬，从委托人分红资金中扣除，在委托人份额退出日或计划终止时计提的业绩报酬，从委托人退出资金中扣除；

(5) 委托人退出时，按照“先进先出”法，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。

(6) 本集合计划业绩报酬提取频率不得超过 6 个月一次，因委托人退出资产管理计划，管理人按照合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

2) 业绩报酬计算公式

委托人所持或退出的某笔份额期间年化收益率 $R_t = [(P_t - P_0) / P_0] \times (365 \div T)$

P_t = 委托人所持或退出的该笔份额本次业绩

管理人的固定管理费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次，经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(2) 业绩报酬

1) 管理人收取业绩报酬的原则

① 同一委托人不同时间多次参与的，对委托人所持每笔份额分别计算年化收益率计提业绩报酬；

② 业绩报酬计提基准日为本计划分红除权日，投资者退出日或计划终止日；业绩报酬计提日为本计划分红确认日（分红除权日的下一交易日），投资者退出确认日或计划终止日；

③ 业绩报酬从分红资金、退出资金或者清算资金中提取。集合计划分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金。在委托人退出或本集合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；

④ 在委托人退出或计划终止时，业绩报酬按委托人退出份额或计划终止时持有的份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余部分不受影响；

⑤ 从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过 6 个月一次。

2) 业绩报酬计算公式

委托人所持或退出的某笔份额期间年化收益率 $R = [(P_t - P_0) / P_0] \times (365 \div T)$

P_t = 委托人所持或退出的该笔份额本次业绩

报酬计提日累计单位净值

P_0 =委托人所持或退出的该笔份额上一个业绩报酬计提日累计单位净值

P_0^x =委托人所持或退出的该笔份额上一个业绩报酬计提日的单位净值

T=委托人所持或退出的该笔份额上一个业绩报酬计提日（不含）到本次业绩报酬计提日（含）的天数

管理人可根据本集合计划运作情况，于本集合计划参与开放期对集合计划业绩报酬计提基准予以调整，具体以管理人公告为准。管理人调整业绩报酬计提基准的，则所有存续份额的业绩报酬计提基准将从本次调整生效之日（简称“调整业绩报酬计提基准日”）起调整，届时前述业绩报酬计算公式中“业绩报酬计提基准”s按照如下公式计算如下：

$$s = \sum_{i=0}^n s_i \times t_i / T$$

n为业绩报酬核算期内业绩比较基准调整的次数（ $n>0$ ）；

s_i 为业绩报酬核算期内第 i 次调整的业绩报酬计提基准， s_0 为委托人上一个业绩报酬计提日的业绩报酬计提基准；

$i=0$ 时， t_0 为上一个业绩报酬计提日（不含）到第 1 次调整业绩报酬计提基准日（不含）的天数； $0<i<n$ 时， t_i 为业绩报酬核算期内第 i 次调整业绩报酬计提基准日（含）到第 $i+1$ 次调整业绩报酬计提基准日（不含）的天数； $i=n$ 时， t_n 为业绩报酬核算期内第 n 次调整业绩报酬计提基准日（含）到

报酬计提基准日累计单位净值

P_0 =委托人所持或退出的该笔份额上一个业绩报酬计提基准日累计单位净值

P_0^x =委托人所持或退出的该笔份额上一个业绩报酬计提基准日的单位净值

T=委托人所持或退出的该笔份额上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数

初始募集期参与的，以注册登记机构份额注册登记日为上一个业绩报酬计提基准日及业绩报酬计提日；存续期内参与的，以参与日为上一个业绩报酬计提基准日，以参与确认日为上一个业绩报酬计提日。委托人退出时，按照“先进先出”法，分别计算退出份额中对应的每一笔参与份额应收的业绩报酬。

管理人可根据市场经济变化等情况对集合计划业绩报酬计提基准予以调整，并于参与开放期前至少 1 个交易日公告，但每半年至多调整一次，每次调整（如有）不超过±20bp（含），具体以管理人公告为准。管理人调整业绩报酬计提基准的，则所有存续份额的业绩报酬计提基准将从本次调整生效之日（简称“调整业绩报酬计提基准日”）起调整，在管理人系统支持的情况下，委托入份额持有期间发生业绩报酬计提基准变更的，管理人可按照本合同约定的计算方式分段计算业绩报酬。

本次业绩报酬计提日（含）的天数。
s 的计算结果均以四舍五入的方法保留小数点后两位。

例如：假设管理人 2019 年 8 月 7 日开放参与并约定锁定 9 个月到 2020 年 5 月 6 日，管理人在参与开放日前公布业绩报酬计提基准为 5.00%，在 2020 年 5 月 7 日 (T=273) 即锁定期期满后的下一个工作日，管理人将为 2019 年 8 月 7 日参与的客户办理退出。假设在该锁定期内，管理人分别在 2019 年 9 月 4 日和 2019 年 10 月 9 日调整业绩报酬计提基准至 5.10% 和 5.20%。则在客户退出时，业绩报酬计提基准 $s=5.0\%*28/273+5.1\%*35/273+5.2\%*210/273=5.17\%$

日期	s _i	t _i
2019-8-7	5.0%	28
2019-9-4	5.1%	35
2019-10-9	5.2%	210

以上仅为计算业绩报酬计提基准的举例，不作为本集合计划真实的业绩报酬计提基准，本集合计划的业绩报酬计提基准以管理人发布的公告为准。

以上锁定期满日仅为计算业绩报酬计提基准的举例，不作为本集合计划唯一锁定期满日的推算。

3) 业绩报酬支付：当收益分配日、集合计划份额退出或集合计划终止后 T+2 日内，托管人根据管理人的指令将退出净值总额（含业绩报酬和退出费用）或分红金额（含业绩报酬）划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人，并将扣除业绩报酬后的退出款项转入销售机构在注册登记机构的资金账户。托管人对业绩报酬的计算不承担复核义务和责任。

二十二、资产管理计划的收益分配

(三) 收益分配原则

- 1、同一种类集合计划份额的每一份额享有同等分配权，本合同另有约定除外；
- 2、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

3) 业绩报酬支付：由于涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人负责计算，托管人依照管理人的计算结果配合完成账务处理。托管人于本集合计划业绩报酬计提日起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从分红资金、退出资金或清算资金中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

二十二、资产管理计划的收益分配

(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；
- 2、在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，本集合计划可以进行收益分配，收益

<p>3、在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，本集合计划可以进行收益分配，分配比例不超过分配基准日全部可分配收益的100%；</p> <p>(五) 收益分配的执行方式： 本集合计划分红方式为现金分红方式。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)。 现金分红形成的集合计划份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集合计划资产的损益。</p>	<p>分配频率不得超过6个月一次，分配比例不超过分配基准日全部可分配收益的100%；</p> <p>3、本集合计划以截至收益分配基准日的可供分配利润为限进行收益分配；</p> <p>(五) 收益分配的执行方式： 本集合计划的默认分红方式为现金分红，委托人可以选择现金分红或者红利再投资分红方式。委托人选择红利再投资分红方式的，分红资金按分红除权日当日的单位净值自动转为本集合计划的份额，免收参与费(红利再投资不受本计划份额上限的限制)；委托人未选择分红方式或选择现金分红方式的，管理人将现金红利款划往销售机构账户，再由销售机构划入委托人账户，现金红利款自款项从集合计划托管账户划出之日起7个工作日内到达委托人账户。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)。红利再投资形成的集合计划份额不受本计划最短持有期限的限制，可以在本计划的开放日(每周二，非工作日顺延)办理退出业务。 红利再投资形成的集合计划份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集合计划资产的损益。</p>
<p>二十三、信息披露与报告</p> <p>(一) 本集合计划的信息披露应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》及相关自律规则的规定。如中国证监会、中国基金业协会更新了相关信息披露规则或制定了其他相关规则，则从其规则执行。</p> <p>(二) 定期报告</p>	<p>二十三、信息披露与报告</p> <p>(一) 本集合计划的信息披露应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》及相关自律规则的规定。如中国证监会、中国基金业协会更新了相关信息披露规则或制定了其他相关规则，则从其规则执行。资产管理计划应当向投资者提供资产管理合同、计划说明书、风险揭示书、资产管理计划净值、资产管理计划参与及退出价格、定期报告、重大事项的临时报告、清算报告等信息披露文件。管理人披露资产管理计划净值、资产管理计划参与及退出价格应当经托管人复核。</p> <p>(二) 定期报告</p>

<p>2、集合计划的资产管理季度报告</p> <p>资产管理季度报告由管理人在每季度结束之日起 15 日内编制，管理人在季度报告完成当日，将其发送托管人，托管人收到后 15 日内复核其中的财务数据，并将复核结果书面通知管理人，由管理人于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站披露季度报告，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。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，可以不编制当期的季度报告。</p> <p>3、集合计划的资产管理年度报告</p> <p>本计划年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格的会计师事务所审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。资产管理年度报告由管理人编制，托管人复核，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送证券公司住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构。管理人应当在每年结束后 3 个月内，编制完成资产管理计划财产年度报告，管理人在年度报告完成当日，将其发送托管人，托管人收到后 1 个月内复核其中的财务数据，并将复核结果书面通知管理人。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人可不编制披露当期的年度报告。</p> <p>4、临时报告</p> <p>集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人指定网站、销售机构网站、或其他途径和方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>(10) 集合计划资产投资于管理人、托管人及前述机构控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p>	<p>2、集合计划的资产管理季度报告</p> <p>资产管理季度报告由管理人公告，每季度结束之日起一个月内通过管理人网站披露季度报告。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，可以不编制当期的季度报告。</p> <p>3、集合计划的资产管理年度报告</p> <p>本计划年度财务会计报告应当经符合《证券法》规定的会计师事务所审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。资产管理年度报告由管理人编制，经托管人复核其中的财务数据后由管理人公告。托管人在每年度向管理人提供一次托管报告，由管理人向委托人进行披露。每年结束之日起 4 个月内通过管理人网站披露年度报告，本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，可以不编制当期的年度报告。</p> <p>4、临时报告</p> <p>集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人指定网站、销售机构网站、或其他途径和方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>(10) 重大关联交易</p>
<p>二十四、风险揭示</p>	<p>二十四、风险揭示</p> <p>新增：</p> <p>(一) 本金损失风险</p>

<p>(六) 其他风险</p> <p>11、 税收政策相关风险</p> <p>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。</p> <p>15、 关联交易的风险</p> <p>本集合计划根据实际投资需求，可能投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，存在关联交易的风险。</p>	<p>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资产管理计划财产但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。</p> <p>本计划属于 R3 风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 R3 及以上的合格投资者。</p> <p>(二) 市场风险</p> <p>6、 再投资风险</p> <p>利率下降将对固定收益证券利息收入再投资的收益产生影响，此风险即为由于金融市场利率下降造成的无法通过再投资而实现预期收益的风险。</p> <p>(六) 税收政策相关风险</p> <p>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。</p> <p>关联交易的风险后移</p> <p>新增：</p> <p>16、 证券交易资金前端风险控制相关风险</p> <p>根据《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，</p>
---	--

<p>(七) 本集合计划特有风险</p> <p>1、合同变更风险</p> <p>管理人就合同变更征求委托人意见期间,未明确提出异议的委托人视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人,而无法及时获知合同变更事项,如果委托人因上述情况未能按时退出本计划,可能会被视为同意合同变更,从而存在风险。</p> <p>2、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</p>	<p>证券交易所、中国结算对管理人相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理,并通过证券交易所对本计划实施资金前端控制。本计划可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易,可能造成损失。除管理人、托管人故意或重大过失造成本计划损失,由各过错方根据过错程度承担责任外,其他损失由本计划资产承担。</p> <p>17、个人信息泄露的风险</p> <p>虽然管理人按照法律法规的规定及本合同的约定采取个人信息保护处理措施,但仍然存在个人信息泄露的风险,包括涉及个人敏感信息的泄露,这种信息泄露风险可能来自于现有信息保护技术水平、软件风险等。</p> <p>(七) 本集合计划特有风险</p> <p>1、合同变更风险</p> <p>在合同变更安排中,可能存在但不限于以下潜在风险:</p> <p>(1) 默认处理的风险。合同中约定委托人不同意变更的,应在公告或征询意见书中指定的时间内回复不同意的意见或在合同变更临时开放期提出退出本集合计划的申请。若委托人未在前述时间回复意见也未在指定开放日退出该集合计划的,将视为委托人同意合同变更,在此情况下,委托人对默认情况的忽略或误解,可能存在潜在风险。</p> <p>(2) 强制退出风险。合同中约定,委托人不同意变更的,应在公告或征询意见书中指定的时间内回复不同意的意见或在合同变更临时开放期提出退出本集合计划的申请;委托人明确答复不同意变更但未在指定开放日提出退出申请的,管理人将统一在征求意见截止日次一工作日为该委托人办理强制退出,在此情况下,会导致委托人的计划份额减少至零。</p> <p>2、收益分配相关风险</p> <p>(1) 本集合计划公布分红方案后,可能存在本集合计划净值浮动、管理人收取业绩报酬等原因导致分红除权日可供实际分配的资金少于分红方案公布的分配金额,届时管</p>
---	---

际收到的分红金额与收益分配方案不完全相同的风险。

3、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。

7、收益不确定风险

(1) 本集合计划“业绩报酬计提基准”仅为计算管理人业绩报酬，非预期收益率，也不是管理人对委托人作出的最低收益承诺。

(2) 本合同约定的“期间年化收益率”仅为计算管理人业绩报酬，未考虑委托人所持份额应付的业绩报酬，不代表委托人所持份额真实收益率。

(3) 本集合计划在运作过程中可能会调整“业绩报酬计提基准”，该调整对本集合计划所有份额生效。如委托人未在调整“业绩报酬计提基准”的开放日退出，则存在调整后的业绩报酬计提基准低于上一个业绩报酬计提基准，委托人收益减少的风险。

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；

(2) 由于不同时间参与本集合计划的投资者实际参与价格不同，管理人应提取的业绩报酬也不同，从而导致每单位份额实际分得的红利额可能不同，从而给委托人带来风险；

(3) 委托人可将本集合计划的分红方式选择为红利转份额，红利再投资形成的集合计划份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，由此产生的差额部分将计入集合计划资产，可能导致不同分红方式的委托人实际分得的红利额不同，从而给委托人带来风险；

(4) 委托人的分红方式将以分红登记日之前（不含分红登记日）确认的最后一次修改为准，在分红登记日及分红登记日之后确认的修改对此次分红无效，可能存在委托人未能及时修改分红方式而产生的风险。

(5) 红利再投资形成的集合计划份额不受本计划最短持有期限的限制，可以在本计划的开放日（每周二，非工作日顺延）办理退出业务，因此若委托人赎回红利再投资形成的份额时，如剩余持有的集合计划资产净值低于30万元的，则将触发管理人对该余额部分作强制退出处理的风险。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

3、收益不确定及业绩报酬计提基准调整的风险

(1) 本集合计划“业绩报酬计提基准”仅为计算管理人业绩报酬，非预期收益率，也不是管理人对委托人作出的最低收益承诺。

(2) 本合同约定的“期间年化收益率”仅为计算管理人业绩报酬，未考虑委托人所持份额应付的业绩报酬，不代表委托人所持份额真实收益率。

(3) 本集合计划在运作过程中管理人可根据市场经济变化等情况调整“业绩报酬计提基准”，但至多每6个月调整一次，每次调整（如有）不超过±20bp，管理人将在调

10、业绩报酬计提方法的风险

管理人按照合同约定收取业绩报酬，但不同的业绩报酬计提原则，比如“先进先出法”、“后进先出法”等不同方法可能导致计算的业绩报酬出现不同，从而影响委托人的实际收益水平。

11、本集合计划封闭期内不接受委托人参与或退出，因此委托人面临在非开放期时无法退出本集合计划的风险。

整生效前的至少 1 个工作日公布新业绩报酬计提基准，所有投资者均可以在新业绩报酬计提基准生效前的最近一个开放日退出本计划（具体以管理人公告为准），不受锁定期限制，如投资者未在前述开放日退出本计划，则将视为同意业绩报酬计提基准调整，该调整在生效之日起对本集合计划所有存续份额生效。委托人持有的每份份额的业绩报酬按照本合同第 21 条（二）2. “(2) 业绩报酬” 所述公式计算。

如果本计划存续期间管理人调整了业绩报酬计提基准，则存在调整后的业绩报酬计提基准低于上一个业绩报酬计提基准，委托人收益减少的风险，请委托人及时关注管理人公告并做好资金安排。

4、封闭期无法及时退出的风险

投资者所持份额（红利再投资所持有的份额除外）均有锁定期，投资者所持有的份额的自参与日起每满 273 天的下一日（如为非工作日，则顺延至下一工作日）方可退出，期间封闭运作，如投资者未在锁定期满后的退出开放日退出，则投资者所持有的份额将自动进入下一锁定期，届时委托人所持份额将面临较长时间内不能退出的风险，对此投资者需要充分认知所持份额退出时间并妥善做好资金的流动性安排。

请投资者参与前认真阅读本计划资管合同开放期参与退出相关条款，知晓前述参与、退出安排，合理安排资金。

10、从事重大关联交易、一般关联交易及其他利益冲突风险

委托人知悉并同意管理人按照《关联交易办法》界定本计划关联方、关联交易、重大关联交易和一般关联交易范围等，管理人有权根据监管规定或内部管理需要对《关联交易办法》进行不时修订。委托人知悉并同意管理人修订前述制度涉及本合同约定的关联方、关联交易、重大关联交易范围和关联交易内部管控机制等内容的，管理人应当及时公告，并按照新制度执行，无需按照本合同约定履行合同变更程序，《关联交易办法》

与最新法律法规或中国证监会、基金业协会相关规定、要求不一致的，管理人将直接按照法律法规或监管规定执行。

虽然管理人建立了关联交易制度，严格落实关联交易审批，强化内部控制管理，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，但仍存在可能因管理人运用计划财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险或关联交易决策过程中发生未妥善处理利益冲突的出现导致本计划资产受损等风险，进而可能影响委托人的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。此外，管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响计划财产的投资收益。

本计划拟进行重大关联交易的，将至少提前3个工作日公告，公告期内，投资者未对该笔重大关联交易提出异议的，视为投资者同意。投资者不同意的，应当按照公告约定的方式在公告期内向管理人提出异议，管理人将为其办理赎回，届时委托人所持全部份额将退出本计划。如委托人未及时关注管理人重大关联交易公告或未按照资管合同约定就重大关联交易提出异议的，投资者将存在被视作同意该笔重大关联交易的风险。对重大关联交易提出异议的投资者，将存在所持全部份额被退出本计划的风险。

除重大关联交易外，委托人知悉签署本协议即意味着直接授权管理人按照资管合同约定进行一般关联交易，届时管理人进行一般关联交易的，将不再单独向委托人征求意见，委托人存在无法及时知悉本计划从事一般关联交易的风险。

此外集合计划还存在其他可能存在利益冲突的情况，如本集合计划通过管理人席位或交易单元进行的交易并向管理人支付佣金，可能选择管理人的关联方方正中期期货有限公司作为期货经纪商的及其他可能存在

利益冲突的情况。

委托人在参与本计划前，需知悉前述关联交易安排和风险，及时关注管理人公告，并愿意承担由此可能带来的风险。

11、管理人及其子公司自有资金参与与退出安排

委托人签署本合同即表明其同意并授权管理人及其子公司按照本合同的约定安排自有资金参与、退出本计划。委托人应关注管理人网站等信息披露渠道，关注管理人自有资金的安排。委托人知悉，管理人及其子公司以自有资金在存续期参与、退出时，管理人将提前 5 个工作日通过电子邮件告知托管人并取得其同意，管理人将提前 5 个工作日通过管理人网站公告告知投资者，公告期内，投资者未对管理人或其子公司自有资金参与、退出提出异议的，视为投资者同意，管理人将按照公告安排管理人或其子公司自有资金参与或退出本计划。投资者不同意的，应当按照公告约定的方式在公告期内向管理人提出异议，管理人将于公告期满次个交易日对按规定方式提出异议的委托人办理赎回，届时委托人将按照管理人办理赎回日的净值赎回本计划全部份额。委托人在参与本计划前，需知悉前述约定，并愿意承担由此可能带来的风险。

13、资产管理计划委托募集所涉风险

根据相关法律法规及自律监管规则规定，资产管理人委托具有基金销售资格的代理销售机构募集本资产管理计划财产。

虽然资产管理人能够确认在委托募集时该等代理销售机构具有基金销售资格，但无法保证其持续满足该等业务资格要求，且无法保证其将按照相关法律法规及自律监管规则的规定进行募集活动。若届时因代理销售机构不符合资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、操作失误等，可能给投资者带来一定的风险。而且，如果代理销售机构未按照相关法律法规及自律监管规则的规定进行募集活动，亦将直接影响投资者对本计划风险收益的判断，从

<p>二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>(一) 合同的变更</p> <p>2、除本合同另有约定外,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。管理人须在公告后5个工作日内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5个工作日内开放日或5个工作日内期限届满后的合同变更临时开放期内提出退出本集合计划的申请;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,管理人保障其退出集合计划的权利;对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人,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。</p> <p>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。</p> <p>4、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。管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案,并抄报中国证监会相关派出机构。</p> <p>管理人特别提示,合同变更可能涉及委托人的各项权益调整(包括但不限于权利义务的重大变动,管理费、托管费、业绩报酬的提高或降低等),委托人应实时关注管理人网站(www.foundersc.com)公告;委托人同意,管理人通过网站公告的方式视为已合理征询委托人的意见,无论其是否同意合同变更或提出退出申请,委托人同意,无论其是否同意合同变更或提出退出申请,管理人在与托管人达成一致意见并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</p>	<p>而对本计划投资者的利益产生不利影响。</p> <p>二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> <p>(一) 合同的变更</p> <p>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以在管理人网站公告的方式通知委托人。委托人不同意变更的,应在公告或征询意见书中指定的时间内回复不同意的意见或在合同变更临时开放期内提出退出本集合计划的申请。对回复不同意合同变更且逾期未提出退出申请的委托人所持有的计划份额,管理人将统一在征求意见截止日次一工作日做强制退出处理,退出价格按照退出当日集合计划份额净值计算(如有业绩报酬的,业绩报酬将从退出资金中扣除)。逾期未退出且未有意见答复的,视同委托人同意本合同变更。合同变更生效日以管理人公告为准。</p> <p>4、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。管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案。</p> <p>管理人特别提示,合同变更可能涉及委托人的各项权益调整(包括但不限于权利义务的重大变动,管理费、托管费、业绩报酬的提高或降低等),委托人应实时关注管理人网站(www.foundersc.com)公告;委托人同意,管理人通过网站公告的方式视为已合理征询委托人的意见,无论其是否同意合同变更或提出退出申请,管理人在与托管人达成一致意见并通过管理人网站或其他适当方式向委托人征询意见后,按照上述程序变更本合同属于委托人认可的行为。</p>
--	--

<p>询意见后，按照上述程序变更本合同属于委托人认可的行为。</p> <p>(二) 集合计划的展期</p> <p>1、展期的条件</p> <p>(1) 在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反《集合资产管理合同》、《说明书》的约定；</p> <p>(2) 展期没有损害委托人利益的情形；</p> <p>(3) 托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；</p> <p>(4) 中国证监会规定的其他条件。</p> <p>(三) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <p>6、集合资产管理计划存续期间，持续五个工作日投资者少于二人；</p> <p>管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第8项约定的情形除外。</p> <p>(四) 集合计划的清算</p> <p>5、集合计划延期清算处理方式</p> <p>资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告；</p>	<p>(二) 集合计划的展期</p> <p>1、展期的条件</p> <p>(1) 在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定、《集合资产管理合同》、《说明书》的约定；</p> <p>(2) 展期没有损害委托人利益的情形；</p> <p>(3) 托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；</p> <p>(4) 符合资产管理计划的成立条件；</p> <p>(5) 中国证监会规定的其他条件。</p> <p>(三) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <p>6、集合资产管理计划存续期间，持续五个工作日投资者少于二人，若本计划开放后投资者退出将导致剩余投资者少于2人的，管理人有权视情况拒绝当日全部退出申请并终止本计划并按照本合同约定进入清算程序；</p> <p>管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，前述第8项约定的情形除外。</p> <p>(四) 集合计划的清算</p> <p>5、集合计划延期清算处理方式</p> <p>资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告；</p>
<p>二十九、资产管理合同的效力</p>	<p>二十九、资产管理合同的效力</p> <p>(一) 资产管理合同签署的方式。</p> <p>各方采用电子签名方式签署的，委托人、管理人、托管人均应约定平台采用各份认可的电子签名方式签署，各方所使用的电子签名方式均应符合约定的可靠电子签名，电子合同应按有关监管部门要求备案或报送(如</p>

<p>(二) 资产管理合同的生效条件</p> <p>投资者为法人的，资产管理合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人/负责人或授权代理人签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，资产管理合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人/负责人或授权代理人签字或盖章之日起成立。</p> <p>(三) 合同的组成</p> <p>本合同正本一式伍份，管理人持有贰份，托管人持有一份，其余按照有关监管部门的要求备案或报送，每份均具有同等法律效力。</p>	<p>需)，并与纸质版合同具有同等法律效力。委托人应按销售机构指定方式签署《电子签名约定书》(如有)，之后方可以电子签名方式签署本合同。三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式接受电子签名合同(即本合同、《计划说明书》、《风险揭示书》或其他文书)的，视为签署本合同、《计划说明书》、《风险揭示书》或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。特别提请委托人在签署本合同前认真阅读本合同、《计划说明书》及《风险揭示书》全文。以电子签名方式签署本合同的，委托人应当采取有效措施妥善保管与电子签名合同相关的信息和资料，防止他人以投资者名义实施电子签名行为。</p> <p>(二) 资产管理合同的生效条件</p> <p>若本合同采用书面方式签署的，投资者为法人的，资产管理合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人(负责人)或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，资产管理合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人(负责人)或授权代表签字或盖章之日起成立。若本合同采用电子签约方式的，本合同经管理人和托管人加盖公章或合同专用章及法定代表人(负责人)或授权代表签字或盖章后，自委托人按本合同约定的电子签名方式签署本合同之日起成立。</p> <p>(三) 合同的组成</p> <p>本合同正本一式三份，管理人持有贰份，托管人持有一份，其余按照有关监管部门的要求备案或报送，每份均具有同等法律效力。</p>
	<p>新增：</p> <p>二十九、 反虚假宣传条款</p> <p>合同各方均清楚并愿意严格遵守中华人民共和国《著作权法》、《商标法》、《专利法》、《反不正当竞争法》等知识产权类、民法典</p>

及广告法等相关法律的规定,合同当事人均有权就本合同所约定事项以约定方式在约定范围内进行真实、合理的使用或宣传,但不得涉及合同所约定的保密内容。为避免商标侵权及不当宣传等风险的发生,合同当事人均同意,在使用对方的商标、品牌、企业名称等进行宣传前,均须获得对方事先的书面认可,否则,不得进行此类使用或宣传。合同当事人在此承诺,会积极响应对方提出的就合作事项的合理使用或宣传申请。合同当事人均承认,未经对方事先书面同意而利用其商标、品牌及企业名称等进行商业宣传;虚构合作事项;夸大合作范围、内容、效果、规模、程度等,均属对本合同的违反,并可能因虚假宣传构成不正当竞争,守约方或被侵权人将保留追究相应法律责任的权利。

三十、反洗钱

资产管理人和资产托管人应按照所在国家/地区反洗钱和反恐怖融资方面的法律法规和监管要求,建立健全洗钱和恐怖融资风险管理体系,建立并有效执行反洗钱和反恐怖融资内部控制制度,设立反洗钱和反恐怖融资专门机构或者指定内设机构负责反洗钱和反恐怖融资工作,建立健全和执行客户身份识别、客户身份资料和交易记录保存制度、大额交易和可疑交易监控和报告制度、洗钱和恐怖融资风险自评估制度、反恐怖融资管理机制、制裁筛查机制等相关制度,依法执行联合国安理会制裁决议或、中国制裁和反制措施以及国际金融制裁相关要求,开展反洗钱和反恐怖融资内部审计,做好境外洗钱和恐怖融资风险管控和合规经营工作,做好跨境业务的洗钱风险、制裁风险和恐怖融资风险防控,制定反洗钱和反恐怖融资培训制度,开展反洗钱和反恐怖融资宣传,并对可疑客户及可疑交易及时采取有效的风险管控措施。

资产管理人和资产托管人应在符合相关法律法规和监管要求的前提下,共同推进反洗钱和反恐怖融资的合作,为调查涉嫌洗钱、

	<p>恐怖融资或其他违法犯罪活动提供必要协助。资产管理人和资产托管人应为其自对方获得的与反洗钱和反恐怖融资相关的信息严格保密。一方或其所属的国家或地区在协议期间被列入国际组织、当地监管或有关外国政府的制裁名单或制裁范围(外国对中国公民或组织的歧视性限制措施除外), 或一方被中国列入反制清单或采取反制措施, 或一方被中国列入反制清单或采取反制措施, 或一方客户及业务涉嫌洗钱和恐怖融资、核武器扩散、国内/国际制裁、违反国内反制措施的违规或其他违法犯罪活动, 或一方为另一方拒绝接受的客户提供服务, 另一方有权中止或拒绝办理相关业务。如遇上述情况, 一方应提前 30 个工作日书面通知另一方。</p> <p>三十一、其他事项</p> <p>合同其他方签署本合同即视为知悉/授权托管人、管理人可为订立、履行个人作为一方当事人的合同所必需或为履行法定职责或者法定义务所必需而处理个人信息; 托管人、管理人承诺对上述个人信息的处理合法合规, 其他方亦已知悉其享有《个人信息保护法》项下所有相关权利。如果个人信息系由一方向另一方提供的, 该方承诺已告知并获得相关个人同意向另一方提供个人信息, 且个人已知晓个人信息的使用用途。</p>
	<p>其他重要表述修改:</p> <p>将全文的“委托资产”改为“受托资产”;</p> <p>将全文的“委托资金”改为“交付的财产”/“财产”。</p>