

关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同变更的公告

尊敬的各位委托人：

由东莞证券股份有限公司（以下简称“管理人”）管理，兴业银行股份有限公司（以下简称“托管人”）托管的东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）已成立运作。为了给委托人提供更加优质的投资理财服务，根据相关法律法规及《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同（第一次合同变更）》（以下简称“原《资产管理合同》”）第二十四条“资产管理合同的变更、终止与财产清算”关于“由于其他原因需要变更合同的（除本合同另有约定外），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。委托人应在征询意见发出后的 5 个工作日内给出书面或其他约定方式的答复。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。”的相关约定，现管理人与托管人经协商一致对原《资产管理合同》开放日安排、资产管理计划的投资等条款进行变更，并根据《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》《集合资产管理计划资产管理合同内容

与格式指引》完善管理人自有资金参与及退出、关联交易、风险揭示等相关条款表述，本次变更主要内容见附件 1《关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划合同变更对照表》。

《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书(第一次合同变更)》《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书(第一次合同变更)》以及相关推广发行资料等法律文件涉及相关内容一并进行修订。

本次合同变更后，本集合计划份额锁定期(最短持有期)将由 360 天(自然日)变更为 6 个月，但每份份额锁定期仍将以实际申购确认日作为起始期进行计算，若委托人持有期未满 6 个月，则需实际持有满 6 个月后方可在开放期内办理份额退出业务。

本次资产管理合同变更已取得托管人的同意，现管理人以公告形式向委托人征询意见。本次资产管理合同变更征询意见期间为 2025 年 03 月 06 日至 2025 年 03 月 12 日，本集合计划委托人可在《关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划合同变更意见回复函》(附件 2)中选择“同意”或“不同意”合同变更，并在签字捺印或盖章后向管理人提交。委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意本次资产管理合同变更。

本次资产管理合同变更征询意见期间内，委托人可以通过下列任一方式反馈意见：

1、电子邮件：zcgl@dgzq.com.cn

2、邮寄地址：广东省东莞市可园南路一号金源中心 21 楼深圳分公司

本着尊重客户意愿的原则，委托人不同意本次资产管理合同变更的，务必在 2025 年 03 月 06 日至 2025 年 03 月 12 日征询意见期间内向管理人书面反馈“不同意”本次合同变更的意见，并于临时开放日 2025 年 03 月 13 日提出退出本集合计划的申请，进行份额退出。对于明确书面回复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划或因锁定期问题无法退出的委托人，管理人将统一在 2025 年 03 月 13 日当日对该委托人持有的全部份额做强制退出处理。逾期未回复的，则视为委托人已以行为表明其最终确定的意思表示为同意公告中载明的全部变更事项。本次资产管理合同变更将于 2025 年 03 月 14 日生效。

变更后的资产管理合同等材料通过管理人网站进行披露，敬请各位委托人认真阅读。

特此公告。

附件 1：关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划合同变更对照表

附件 2：关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划合同变更意见回复函

附件 3：东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同（第二次合同变更）

附件 4: 东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书（第二次合同变更）

附件 5: 东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书（第二次合同变更）

东莞证券股份有限公司

2025 年 3 月 5 日

附件 1:

关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划
合同变更对照表

变更前	变更后
二、释义	
<p>.....</p> <p>集合资产管理计划管理合同、管理合同、资产管理合同、本合同：指《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》及其的任何有效修订和补充。</p> <p>托管协议：指《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划托管协议》及其的任何有效修订和补充。</p> <p>风险揭示书：指《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书》及其的任何有效修订和补充。</p> <p>《基金法》：指 2015 年 4 月 24 日修订的《中华人民共和国证券投资基金法》。</p> <p>《指导意见》：指经中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证监会、国家外汇管理局批准发布并于 2018 年 4 月 27 日实施的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》。</p> <p>《管理办法》：指经中国证监会批准发布并于 2018 年 10 月 22 日实施的《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》：指经中国证监会批准发布并于 2018 年 10 月 22 日实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》。</p> <p>.....</p> <p>集合计划账户：指份额登记机构为委托人开立的、记录其持有的集合计划份额余额及其变动情况的账户。</p>	<p>.....</p> <p>集合资产管理计划管理合同、管理合同、资产管理合同、本合同：指《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及对该合同进行的任何有效修订和补充。</p> <p>风险揭示书：指《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书》及其的任何有效修订和补充。</p> <p>《基金法》：指 2015 年 4 月 24 日修订的《中华人民共和国证券投资基金法》。</p> <p>《管理办法》：指经中国证监会批准发布并于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》：指经中国证监会批准发布并于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>《合同内容与格式指引》：指经协会理事会审议通过，2023 年 12 月 15 日协会发布并自2024 年 3 月 1 日起施行的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》。监管部门另有规定的从其规定。</p> <p>.....</p> <p>管理人子公司：指管理人持股比例不低于 51%的主体及被管理人控制的主体。</p> <p>集合计划账户：指份额登记机构为委托人开立的、记录其持有的集合计划份额余额及其变动情况的账户。</p>

退出：指委托人在集合计划开放日部分或全部退出集合计划的行为，不包括委托人在本集合计划终止时收回资产的行为。

法律法规：指中华人民共和国（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区、台湾地区）现行有效的法律、行政法规、司法解释、部门规章以及其他对《管理合同》当事人有约束力的决定、决议、通知等。

不可抗力：指《管理合同》当事人无法预见、无法克服、无法避免且在《管理合同》生效之后发生的，使《管理合同》当事人无法全部或部分履行合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、疫情、政府征用、没收、法律变化等。

.....

退出：指委托人按集合资产管理计划管理合同约定的条件要求在集合计划开放日部分或全部退出集合计划的行为，不包括委托人在本集合计划终止时收回资产的行为。

流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或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）、停牌股票、流动受限的新股及非公开发行股票、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、期货及标准化期权合约和同业存单，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。

法律法规：指中华人民共和国（为本合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区、台湾地区）现行有效的法律、行政法规、部门规章、司法解释、地方性法规、地方政府规章及其他规范性文件（包括但不限于监管机构、交易所、证券登记结算机构、证券业协会和基金业协会等行业自律组织、银行间市场等机构制订的业务规则）以及其他对本合同投资者、管理人和托管人有约束力的决定、决议、通知等。

不可抗力：指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战

	<p>争、骚乱、疫情、火灾、政府征用、没收、法律变化、系统故障、突发停电或其他突发事件、注册与过户登记人非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等。</p> <p>.....</p>
<p>四、当事人及权利义务</p>	
<p>(一) 集合计划的参与和退出安排</p> <p>管理人</p> <p>机构名称: 东莞证券股份有限公司</p> <p>法定代表人: 陈照星</p> <p>住所/通信地址: 广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心21楼</p> <p>邮政编码: 523000</p> <p>联系人: 宋浩瑗</p> <p>联系电话: 0769-22119271</p> <p>.....</p> <p>托管人</p> <p>机构名称: 兴业银行股份有限公司</p> <p>法定代表人: 吕家进</p> <p>住所/通信地址: 福州市福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦</p> <p>邮政编码: 200000</p> <p>联系人: 张珏</p> <p>联系电话: 021-52629999</p> <p>.....</p> <p>4.3 委托人</p> <p>4.3.1 委托人的权利</p> <p>(1) 分享资产管理计划财产收益;</p> <p>(2) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产;</p> <p>(3) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额;</p> <p>(4) 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;</p> <p>(5) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况;</p>	<p>(一) 集合计划的参与和退出安排</p> <p>.....</p> <p>管理人</p> <p>机构名称: 东莞证券股份有限公司</p> <p>法定代表人: 陈照星</p> <p>住所/通信地址: 广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心21楼</p> <p>邮政编码: 523000</p> <p>联系人: <u>杨云露</u></p> <p>联系电话: 0769-22119271</p> <p>托管人</p> <p>机构名称: 兴业银行股份有限公司</p> <p>法定代表人: 吕家进</p> <p>住所/通信地址: 福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦</p> <p>邮政编码: 300014</p> <p>联系人: 余杨小璇</p> <p>联系电话: 021-52629999</p> <p>.....</p> <p>(三) 投资者的权利和义务</p> <p>1、投资者的权利</p> <p>(1) 分享资产管理计划财产收益;</p> <p>(2) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产;</p> <p>(3) 按照资产管理合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额;</p> <p>(4) 按照资产管理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;</p> <p>(5) 监督管理人、托管人履行投资管理和托管义务的情况;</p>

<p>(6) 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。</p> <p>4.3.2 委托人的义务</p> <p>(1) 委托人应认真阅读并遵守本合同及《说明书》，并保证委托资金的来源及用途合法；</p> <p>(2) 委托人应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；</p> <p>(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，委托人应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；</p> <p>(4) 委托人应认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(5) 委托人应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；</p> <p>(6) 在持有的资产管理计划份额范围内，委托人承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；</p> <p>(7) 委托人应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；</p> <p>(8) 委托人不得违反资产管理合同约定干涉管理人的投资行为；</p> <p>(9) 委托人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</p>	<p>(6) 法律、行政法规、中国证监会及协会规定和资产管理合同约定的其他权利。</p> <p>2、投资者的义务</p> <p>(1) 认真阅读并遵守本合同及说明书，保证投资资金的来源及用途合法；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(5) 认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(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；</p> <p>(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、审计费及税费（包括法律法规规定的增值税及附加税费等）等合理费用；</p> <p>(8) 不得违反资产管理合同约定干涉管理人的投资行为；</p> <p>(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以及托管人托管的其他资产合法权益的活动；</p>
-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<p>资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；</p> <p>(10) 委托人应保守商业秘密，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>(11) 本集合计划可以采用电子签名或纸质合同手写签名、盖章方式签订，委托人应当如实提供与签署电子签名合同或纸质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；</p> <p>(12) 委托人承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，并承诺将严格遵守上述规定，不会实施任何违反前述规定的非法行为；积极配合管理人进行相应的客户身份识别及反洗钱客户风险等级划分、反洗钱可疑交易报送、涉嫌恐怖融资可疑交易报送等工作；</p> <p>(13) 委托人保证提供给管理人进行身份信息识别的信息和资料均真实、准确、完整、合法。在其身份信息资料发生变更时，应当及时书面告知管理人；委托人预留的有效联系方式发生变更的，应及时通知管理人。如委托人预留联系方式变更未及时通知管理人，导致管理人在其认为需要时无法及时联系到委托人的，因此而产生的责任和风险由委托人自行承担；</p> <p>(14) 委托人不得违规转让其所拥有的计划份额；</p> <p>(15) 委托人承诺本次投资行为是为本</p>	<p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(12) 本集合计划可以采用电子签名或纸质合同手写签名、盖章方式签订，投资者应当如实提供与签署电子签名合同或纸质合同相关的信息和资料。投资者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；</p> <p>(13) 承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，并承诺将严格遵守上述规定，不会实施任何违反前述规定的非法行为；积极配合管理人进行相应的客户身份识别及反洗钱客户风险等级划分、反洗钱可疑交易报送、涉嫌恐怖融资可疑交易报送等工作；</p> <p>(14) 保证提供给管理人进行身份信息识别的信息和资料均真实、准确、完整、合法。在其身份信息资料发生变更时，应当及时书面告知管理人；投资者预留的有效联系方式发生变更的，应及时通知管理人。如投资者预留联系方式变更未及时通知管理人，导致管理人在其认为需要时无法及时联系到投资者的，因此而产生的责任和风险由投资者自行承担；</p> <p>(15) 不得违规转让其所拥有的计划份额；</p> <p>(16) 承诺本次投资行为是为本人/本机构购买集合计划；</p>
----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<p>人/本机构购买集合计划；</p> <p>(16) 委托人承诺不以非法拆分转让为目的购买集合计划，不会突破合格投资者标准，将金融产品份额或其收益权进行非法拆分转让；</p> <p>(17) 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。</p>	<p>(17) 承诺不以非法拆分转让为目的购买集合计划，不会突破合格投资者标准，将金融产品份额或其收益权进行非法拆分转让；</p> <p>(18) 法律、行政法规、中国证监会及协会规定和资产管理合同约定的其他义务。</p>
<p>五、资产管理计划的基本情况</p>	
<p>.....</p> <p>5.5.2 主要投资方向</p> <p>(1) 经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、QDII 基金、ETF 基金、LOF 基金等公募基金。</p> <p>(2) 国内依法发行的股票（包括科创板股票）、国债、金融债、中期票据、公司债、企业债、可转债、分离交易可转债、短期融资券、债券逆回购、非公开定向债务融资工具（PPN）、银行存款、同业存单、央行票据等。</p> <p>(3) 国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品，包括在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、证券公司资产管理计划、基金及基金子公司发行的资产管理计划、商业银行理财产品等资产管理产品。</p> <p>(4) 参与债券正回购业务。</p> <p>投资于(3)中资产管理产品的，该资产管理产品不得再投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>5.5.3 投资比例</p>	<p>.....</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>2、 主要投资方向</p> <p>(1) 本集合计划资产投资于标准化资产，包括国内依法发行的股票（包括科创板股票）、国债、金融债、中期票据、公司债、企业债、可转换债券、短期融资券、债券逆回购、非公开定向债务融资工具（PPN）、银行存款、同业存单、中央银行票据等。</p> <p>(2) 经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品，公募基金包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、QDII 基金、ETF 基金、LOF 基金等。</p> <p>(3) 本集合计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）。</p> <p>(4) 法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>3、 投资比例</p> <p>本集合计划资产的配置比例如下：</p> <p>(1) 投资于公募基金以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品的比例不低于 80%；</p> <p>(2) 债券、银行存款等债权类资产占</p>

本集合计划资产的配置比例如下：

(1) 投资于公募基金(含货币基金)、资产管理产品的比例不低于 80%；

(2) 债券、银行存款、货币市场基金等债权类资产占资产总值的比例不超过 80%；

(3) 股票、股票型基金等股权类资产占资产总值的比例不超过 80%；

~~(4) 本集合计划投资于债权类底层资产的比例不超过 80%；投资于股权类底层资产的比例不超过 80%。底层资产的投资比例应当按照所投资的资产管理产品披露投资组合的频率进行计算；~~

(5) 本集合计划投资同一资产的比例不超过计划资产净值的 25%；投资银行活期存款、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；

(6) 管理人所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%。投资银行活期存款、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；

(7) 债券正回购：融入资金余额不超过集合计划净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外。

(8) 本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时所申报的金额不得超过本计划的资产总值，所申报的数量不得超过拟发行证券公司本次发行证券的总量。

本集合计划投资于其他资产管理产品的，计算本集合计划的总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。本集合计划投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投

资产总值的比例为 20%-100%，当管理人判断权益类市场未来表现疲软，债券市场收益率相对较高时，或管理人出于流动性安排进行调仓时，本集合计划投资于债权类资产的比例可以高于本集合计划资产总值的 80%；

(3) 股票等股权类资产占资产总值的比例不高于 80%；

(4) 本集合计划投资同一资产的比例不超过计划资产净值的 25%；投资银行活期存款、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；

(5) 管理人所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%；投资银行活期存款、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；

(6) 集合计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%；

(7) 本集合计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算；本集合计划如投资于其他私募资产管理产品的，应当按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或者同类资产的金额。

.....

(六) 存续期限

本集合计划存续期限为自本集合计划成立之日起 10 年，可展期。若本计划存续期限届满之日为非交易日的，则顺延至下一交易日终止。

(八) 费用

1、参与费(认购/申购费率)：0%；

2、退出费：0%；

<p>资同一或同类资产的金额，应当符合法律法规的规定及本合同约定。</p> <p>.....</p> <p>5.6 存续期限 本集合计划存续期限为自本集合计划成立之日起 10 年，可展期。若本计划存续期限届满之日为非交易日的，则顺延自下一交易日终止。</p> <p>5.10 服务机构 本集合计划的份额注册登记机构为中登公司。</p>	<p>3、管理费（年费率）：0.8%；</p> <p>4、托管费（年费率）：0.015%；</p> <p>5、业绩报酬：对于集合计划实际年化收益率大于对应份额业绩报酬计提基准的部分，管理人按照 20%的比例计提业绩报酬；</p> <p>6、证券交易费、相关税费，以及按照法律法规及本合同的约定可以在受托资产中列支的其他费用。</p> <p>具体费用情况详见本合同“资产管理计划的费用与税收”的约定。</p> <p>（十）服务机构 本集合资产管理计划份额登记机构为中登公司，估值与核算、信息技术系统服务机构为东莞证券股份有限公司。</p>
<p>六、资产管理计划的募集</p>	
<p>6.1.1 募集对象 本集合计划面向合格投资者募集。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：</p> <p>（1）具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；</p> <p>（2）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；</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>（4）接受国务院金融监督管理机构监</p>	<p>1、 募集对象 本集合计划面向合格投资者募集。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：</p> <p>（1）具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；</p> <p>（2）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；</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>（4）接受国务院金融监督管理机构监</p>

<p>管的机构发行的资产管理产品；</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>(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p>	<p>管的机构发行的资产管理产品；</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>(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> <p>参与本资产管理计划的投资者如属于上述第（4）类“接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品”的，该资产管理产品的投资者中不得存在其他资产管理产品，且该资产管理产品的投资者财产来源符合法律法规规定。如该资产管理产品为私募资产管理产品的，其所有投资者为符合法律法规规定的合格投资者，该私募资产管理产品的管理人应如实向本资产管理计划管理人披露穿透后的机构投资者及其关联方。该资产管理产品的管理人有义务如实配合向本资产管理计划的销售机构、管理人提供投资者明细，若投资者信息发生实质性变更，该资产管理产品的管理人承诺将及时告知本资产管理计划的管理人及销售机构，并承诺不会出现导致本资产管理计划发生违反监管规定如多层嵌套的情形。</p>
<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p>	
<p>8.1 集合计划的参与和退出安排</p> <p>.....</p> <p>8.1.2 开放日安排</p> <p>本集合计划自成立之日起6个月内为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务；本集合计划成立满6个月后，每满3个月的首个工作日开放一次，管理人可依据实际情况酌情延长开放期，但延长日期原则上不得超过10个工作日，具体开放安排以管理人公告为准。投资者每笔份额持有时间不得少于360天（自然</p>	<p>(一) 集合计划的参与和退出安排</p> <p>.....</p> <p>2、开放日安排</p> <p>本集合计划自成立之日起6个月为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务；封闭期满后，每【周一】开放，如遇非工作日不开放、不顺延，开放期内可办理参与、退出业务。</p> <p>本集合计划每份额均设置最短持有期（锁定期），最短持有期自集合计划成立之日起或集合计划份额申购确认日</p>

目)，最短持有期满后，投资者可在开放期办理退出业务。开放期内，投资者可以根据本合同约定办理参与和持有期满份额的退出业务。在存续期内，管理人可视运作情况对开放期净参与规模上限及单个委托人参与金额上限进行限制，具体由管理人公告确定。

……

8.1.13 拒绝或暂停参与、退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理委托人的参与、退出申请：

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；

(2) 证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；

(3) 法律、法规、规章规定的其他情形或其他在本合同及说明书中载明的特殊情形。

发生上述情形之一的，管理人通过管理人网站通告委托人。已接受的退出申请，若管理人有足额支付能力，则管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续工作日予以兑付。发生拒绝或暂停受理参与、退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理参与、退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停参与、退出的情况消除时，管理人应在不超过正常支付时间 20 个工作日内及时恢复参与、退出业务的办理。

发生说明书、资产管理合同中未予载明的事项，但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划参与、退出申请的，应与托管人协商一致，并向委

起 6 个月，份额处于锁定期内的，委托人不得在开放期申请该份额退出。最短持有期满后，委托人可以根据本合同约定在开放期内办理最短持有期满份额的退出业务。

在存续期内，管理人可视运作情况对开放期净参与规模上限及单个委托人参与金额上限进行限制，具体由管理人公告确定。

6、参与和退出的程序及确认

(1) 投资者按推广机构的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

(2) 投资者应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔参与申请；

(3) 投资者签署电子签名合同或纸质合同后，方可参与本集合计划，参与申请经管理人确认后有效，构成本合同的有效组成部分；

(4) T 日在交易时间内提交的申请，管理人及份额登记机构在收到委托人申请的 T+3 日对该申请的有效性进行确认，委托人通常可在 T+4 日到网点查询申请的确认情况；

(5) 本集合计划存续期内发生参与申请的，在参与当日（T 日）办理参与业务时间结束后，管理人将对参与规模和投资者人数进行汇总统计，当本集合计划开放日累计参与规模达到集合计划公告的规模上限（如有）或投资者人数达到人数上限时，对 T 日提交的参与申请，管理人将按照“时间优先、金额优先”的原则确认申请通过的份额，即申请时间（以注册登记机构确认结果为准）在前的参与申请优先确认，时间相同的，申请参与金额更大的参与申请优先确认；

托人披露。

8.1.6 参与和退出的程序及确认

(1) 投资者按推广机构的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

(2) 投资者应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔参与申请；

(3) 投资者签署电子签名合同或纸质合同后方可参与本集合计划，参与申请经管理人确认后，构成本合同的有效组成部分；

(4) T日在交易时间内提交的申请，管理人及份额登记机构在收到委托人申请的T+3日对该申请的有效性进行确认，委托人通常可在T+4日到网点查询申请的确认情况；

(5) 本集合计划存续期内发生参与申请的，在参与当日（T日）办理参与业务时间结束后，管理人将对参与规模和投资者人数进行汇总统计，当本集合计划开放日累计参与规模达到集合计划公告的规模上限（如有）或投资者人数达到人数上限时，对T日提交的参与申请，管理人将按照“时间优先、金额优先”的原则确认申请通过的份额，即申请时间（以注册登记机构确认结果为准）在前的参与申请优先确认，时间相同的，申请参与金额更大的参与申请优先确认；

(6) 退出申请款项的支付：委托人退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往份额登记机构，再由份额登记机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出委托人的指定账户，退出款项将在T+5日内从托管账户划出。

.....

(6) 退出申请款项的支付：委托人退出申请确认后，管理人指示托管人将退出款项从集合计划托管专户划往份额登记机构，再由份额登记机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出委托人的指定账户，退出款项将在T+7日内从托管账户划出。

.....

13、拒绝或者暂停参与、退出的情形以及处理方式

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理委托人的参与、退出申请：

(1) 本计划面向合格投资者募集，对于不符合法律法规规定或本合同约定的投资者，管理人有权拒绝其参与申请；

(2) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；

(3) 证券/期货交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；

(4) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有投资者利益时；

(5) 集合计划资产规模过大，使管理人无法找到合适的投资品种，或可能对集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有集合计划投资者的利益；

(6) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金支付出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；

(7) 销售机构对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；

(8) 发生本合同中未予载明的事项，但管理人有正当理由认为需要拒绝或暂停参与、退出的情形，应与托管人协商一致；

8.4 管理人自有资金参与

8.4.1 自有资金参与的条件

管理人可以自有资金参与本集合计划，应符合《管理办法》《运作规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

8.4.2 自有资金的参与方式

在初始募集期、每个开放日，管理人可以自有资金参与本集合计划。

8.4.3 自有资金参与的比例和限制

管理人以自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的15%，管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划份额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自有资金参与集合计划被动超限的，管理人应当及时公告退出安排，将部分自有资金参与份额退出，以符合法规要求。集合计划存续期间，管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于6个月。管理人以自有资金参与或退出本集合计划的，应当提前5个工作日通过管理人网站公告，告知委托人和托管人。

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合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出可不受前款限制，但应及时告知委托人和托管人，并向相关派出机构报告。

8.4.4 自有资金的收益分配

管理人以自有资金参与份额与其他份额投资者享有同等收益分配权利和义务。

8.4.5 自有资金责任承担方式和金额

管理人以自有资金参与份额与其他份额投资者享有同等权利和义务。

(9) 法律法规规定的其他情形或其他在本合同及说明书中载明的特殊情形。发生上述情形之一的，管理人通过管理人网站通告委托人。已接受的退出申请，若管理人有足额支付能力，则管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，将按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分在后续工作日予以兑付。发生拒绝或暂停受理参与、退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理参与、退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停参与、退出的情况消除时，管理人应在不超过正常支付时间20个工作日内及时恢复参与、退出业务的办理。

.....

(四) 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出

1、自有资金参与、退出的条件

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、退出本集合计划，应符合《管理办法》《运作规定》和中国证监会、中国证券业协会及协会的相关规定。

2、自有资金的参与、退出方式

委托人、托管人在此同意，证券期货经营机构及其子公司可以以其自有资金在初始募集期认购本资产管理计划。本集合计划存续期间，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、退出本集合计划时，管理人应当提前5个工作日在管理人网站公告取得全体委托人同意，并通过邮件或双方认可的方式告知托管人取得其同意。

针对委托人不同意证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、退出的，管理人应保障其退出的权利，具体退出安排以管理人公告为准。证券期货经营

8.4.6 风险揭示和信息披露

集合计划管理人按上述约定以自有资金参与本集合计划份额，不构成对本集合计划份额本金及收益不受损失的保证。

管理人自有资金退出时应当提前5个工作日通过管理人网站公告，告知委托人和托管人。

8.5 管理人应当定期将本集合计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

.....

机构及其子公司自有资金参与本集合计划的持有期限不得少于6个月。

3、自有资金参与、退出金额和比例限制

在集合计划存续期内，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份额合计不得超过本集合计划总份额的50%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，证券期货经营机构应当及时安排自有资金参与份额退出，以符合法规要求，且该自有资金退出可不受前述第2项的限制，但事后应及时告知委托人和托管人。

4、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可不受前述第2、3项的限制，但应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或按监管要求报备。

5、自有资金的收益分配

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额与其他投资者份额享有同等收益分配权利和义务。

6、自有资金责任承担方式和金额

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额与其他投资者份额享有同等权利和义务。

7、风险揭示

证券期货经营机构及其子公司按上述约定以自有资金参与本集合计划份额，不构成对本集合计划份额本金及收益不受损失的保证。

	<p>在本集合计划存续期内，当法律法规或有关自有资金参与、退出本集合计划的规定或政策发生变更，管理人经与托管人协商一致并公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整。委托人对修改或调整的内容有异议，可在修改或调整的内容生效前按照公告要求申请退出集合计划。委托人未退出的，视为同意修改或调整的内容。</p> <p>（五）管理人应当定期将本集合计划投资者变更情况报送协会或按监管要求报备。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资</p>	
<p>.....</p> <p>11.2.1 投资范围</p> <p>（1）经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、QDII 基金、ETF 基金、LOF 基金等公募基金。</p> <p>（2）国内依法发行的股票（包括科创板股票）、国债、金融债、中期票据、公司债、企业债、可转债、分离交易可转债、短期融资券、债券逆回购、非公开定向债务融资工具（PPN）、银行存款、同业存单、央行票据等。</p> <p>（3）国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品，包括在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、证券公司资产管理计划、基金及基金子公司发行的资产管理计划、商业银行理财产品等资产管理产品。</p> <p>（4）参与债券正回购业务。</p> <p>投资于（3）中资产管理产品的，该资产管理产品不得再投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投</p>	<p>.....</p> <p>（二）投资范围</p> <p>（1）本集合计划资产投资于标准化资产，包括国内依法发行的股票（包括科创板股票）、国债、金融债、中期票据、公司债、企业债、可转换债券、短期融资券、非公开定向债务融资工具（PPN）、银行存款、同业存单、中央银行票据等。</p> <p>（2）经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品，公募基金包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、QDII 基金、ETF 基金、LOF 基金等。</p> <p>（3）本集合计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）。</p> <p>（4）法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>.....</p> <p>（四）投资决策依据与决策程序</p> <p>.....</p> <p>2、决策程序</p>

资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

11.2.2 投资比例

本集合计划资产的配置比例如下：

(1) 投资于公募基金（含货币基金）、资产管理产品的比例不低于 80%；

(2) 债券、银行存款、货币市场基金等债权类资产占资产总值的比例不超过 80%；

(3) 股票、股票型基金等股权类资产占资产总值的比例不超过 80%；

~~(4) 本集合计划投资于债权类底层资产的比例不超过 80%；投资于股权类底层资产的比例不超过 80%。底层资产的投资比例应当按照所投资的资产管理产品披露投资组合的频率进行计算；~~

(5) 本集合计划投资同一资产的比例不超过计划资产净值的 25%；投资银行活期存款、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；

(6) 管理人所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%。投资银行活期存款、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；

(7) 债券正回购：融入资金余额不超过集合计划净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外。

(8) 本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时所申报的金额不得超过本计划的资产总值，所申报的数量不得超过拟发行证券公司本次发行证券的总量。

本集合计划投资于其他资产管理产品的，计算本集合计划的总资产时应当按

(1) 管理人资产管理投资决策委员会是本计划投资运作的最高决策机构，负责贯彻落实有关法律法规、管理人的公司制度，授权并监督管理人的资产管理业务部门的工作。

(2) 管理人资产管理部门负责人负责领导资产管理业务的投资团队，监控投资决策和投资执行过程；参与产品重大投资项目审核。

(3) 管理人资产管理部投资管理机构确定产品的投资策略。

(4) 管理人投资经理依据投资管理机构决议，制定交易策略，进行具体品种的交易。

具体决策程序以管理人内部制度规定的决策程序为准。

(五) 投资比例及投资比例超限的处理方式

1、本集合计划资产的配置比例如下：

(1) 投资于公募基金以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品的比例不低于 80%；

(2) 债券、银行存款等债权类资产占资产总值的比例为 20%-100%，当管理人判断权益类市场未来表现疲软，债券市场收益率相对较高时，或管理人出于流动性安排进行调仓时，本集合计划投资于债权类资产的比例可以高于本集合计划资产总值的 80%；

(3) 股票等股权类资产占资产总值的比例不高于 80%；

(4) 本集合计划投资同一资产的比例不超过计划资产净值的 25%；投资银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种除外；

(5) 管理人所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%；投资银行活期存款、

照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。本集合计划投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额，应当符合法律法规的规定及本合同约定。

……

11.7.7 决策程序

(1)管理人私募资产管理投资决策委员会是管理人董事会和经理层班子会议授权下，本集合计划管理人进行资产管理投资运作的最高决策机构，贯彻落实有关法律法规、管理人的公司制度，授权并监督管理人的资产管理业务部门的工作。

(2)管理人资产管理部投资总监负责领导资产管理业务的投资团队管理所属各资产管理计划，监控投资决策和投资执行过程；在公司私募资产管理投资决策委员会授予的权限范围内，对产品重大资产投资项目进行审核。

(3)管理人深圳分公司投资决策小组对本集合计划的投资决策等提出指导性意见，确定具体的投资策略；如遇重大事项按制度规定上报公司私募资产管理投资决策委员会批准。

(4)管理人投资经理依据私募资产管理投资决策委员会及投资决策小组决议，制定交易策略，进行具体品种的交易。

11.8 投资限制

为维护委托人的合法权益，本集合计划投资的投资限制为：

(1)集合计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%；

(2)除本合同另有约定外，本集合计划投资同一资产的比例不超过计划资产净值的 25%；

(3)集合计划参与债券正回购：融入资

国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种除外；

(6)集合计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%；

(7)本集合计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算；本集合计划如投资于其他私募资产管理产品的，应当按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或者同类资产的金额。

……

(六) 投资限制

为维护委托人的合法权益，本集合计划投资的投资限制为：

1、投资于债项评级 AA 级及以下（对于无债项评级的债券以主体评级或担保方评级）的债券按成本计算合计不得高于集合计划资产净值的 50%。

2、债券正回购：融入资金余额不超过集合计划净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外。

3、当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%时，本集合计划的总资产不得超过净资产的 120%。投资国债、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。

4、本集合计划开放退出日，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本集合计划资产净值的 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得超过本集合计划资产净值的 20%。

5、本集合计划参与债券等证券发行申购时，本集合计划所申报的金额原则上

<p>金余额不超过集合计划净资产的100%，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>(4)不得将委托资产投向高污染、高能耗行业等不符合国家产业政策、环境保护政策的项目(证券市场投资除外)；</p> <p>(5)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。</p> <p>如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行合同变更程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。</p>	<p>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、本集合计划不得投资于资产支持证券和资产支持票据的劣后级；如投资于资产支持证券或资产支持票据，其基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权。</p> <p>7、相关法律法规以及监管部门规定的其它禁止或者限制投资的事项。</p> <p>如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行合同变更程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。</p> <p>.....</p> <p>(十一) FOF 产品所投资资产管理产品的选择标准等事项</p> <p>本集合计划根据宏观经济运行情况及投资风格表现等制定资产配置策略，优选风格稳定、能持续创造阿尔法、风险控制能力优异的公募基金，通过定量和定性两大维度对基金管理人进行深入分析研究，并通过风格评价和业绩评价筛选出市场上投资管理能力强、投资风格清晰、投资收益稳定的基金管理人及符合本集合计划投资策略的资产管理产品。</p> <p>本集合计划不投资管理人及管理人关联方所设立的资产管理产品。</p>
<p>十二、服务机构及投资顾问</p>	
<p>本集合计划不聘用投资顾问。</p>	<p>(一) 本集合资产管理计划份额登记机构为中登公司，估值与核算、信息技术系统服务机构为东莞证券股份有限公司。</p> <p>(二) 本集合计划不聘用投资顾问。</p>
<p>十四、利益冲突及关联交易</p>	
<p>14.1 关联交易及利益冲突情形</p> <p>在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定并严格遵守管理人内部</p>	<p>(一) 资产管理计划存在的或者可能存在利益冲突的情形</p> <p>1、从事关联交易；</p>

<p>有关投资决策管理及关联交易管理等制度的前提下，本集合计划可能投资于管理人、托管人及其关联方所发行、管理、保荐、托管、销售或存在其他法律关系或利益联系的金融产品，或者与该等金融产品以公平合理的价格进行交易。</p> <p>托管人应在本计划成立5个工作日内向管理人提供托管人关联方名单，以便履行关联方信息披露义务，如后续托管人关联方名单发生变动的，应在变动之日起5个工作日内书面通知管理人。</p> <p>14.2 本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率</p> <p>14.2.1 管理人将本计划资产投资于管理人、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，管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循投资者利益优先原则，交易完成后，管理人应书面通知托管人，以公告的形式通知委托人。</p> <p>14.2.2 委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事前文已经明确列明的关联交易及利益冲突情形，管理人无需就前述具体关联交易及利益冲突再行分别取得委托人的授权，但该等关联交易及利益冲突投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。</p> <p>14.2.3 本计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，管理人应当坚持委托人利益优先原则，从充分维护委托人利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，管理人应当视具体利益冲突情形选择在向委托人提供的定期报</p>	<p>资产管理计划关联方包括：</p> <p>(1) 管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方（关联方范围按照《企业会计准则》的规定确定）；</p> <p>(2) 托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方（关联方范围按照《企业会计准则》的规定确定）；</p> <p>(3) 法律法规、监管机构、行业协会规定的其他情形。</p> <p>关联交易是指：</p> <p>(1) 管理人将本资产管理计划资产投资于资产管理计划关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>(2) 管理人将本资产管理计划资产投资于管理人及其关联方担任管理人的其他资产管理计划；</p> <p>(3) 本资产管理计划以资产管理计划关联方为交易对手，开展现券交易、回购交易；</p> <p>(4) 本资产管理计划接受资产管理计划关联方发行的证券或者承销期内承销的证券作为质押券的逆回购交易；</p> <p>(5) 法律法规、监管规定、自律规则等规定为关联交易的其他事项。</p> <p>2、证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本资产管理计划；</p> <p>3、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本资产管理计划；</p> <p>4、其他可能产生利益冲突的情形。</p> <p>除本合同另有约定外，委托人签署本合同，即视为已经充分理解并同意管理人开展上述事项，并自愿承担相关投资风险。</p> <p>(二) 本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率</p> <p>1、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资产管</p>
----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<p>告或临时报告中进行披露。</p> <p>14.3 管理人运用受托管理资产从事关联交易的，事后应及时、全面、客观的以公告的方式向投资者披露，并书面通知托管人。</p> <p>管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应向中国证监会相关派出机构报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。</p>	<p>理计划财产，公平对待全体委托人，当管理人利益与委托人利益发生重大冲突时，以委托人合法利益为优先，当不同委托人之间发生利益冲突时，应当坚持公平性原则。</p> <p>2、在发生本合同约定的利益冲突情形时，管理人应当视具体利益冲突情形通过公告或定期报告或临时报告的方式，充分向托管人和委托人披露该利益冲突情形的具体内容，并按监管要求报备。</p> <p>3、关于关联交易的特殊约定： 资产管理计划的关联交易分为重大关联交易和一般关联交易。</p> <p>(1) 重大关联交易是指交易金额达到或超过人民币 3000 万元的关联交易以及行业协会和监管机构确定的重大关联交易。在开展重大关联交易前，管理人应事先采取逐笔征求意见或公告确认等方式征得投资者的同意；投资者不同意的，管理人保障其退出的权利或终止从事重大关联交易的投资计划。管理人应当在完成重大关联交易后，及时告知托管人并以公告方式及时向委托人披露，并按监管要求报备。</p> <p>(2) 一般关联交易是指除重大关联交易以外的关联交易，委托人签署本合同即视为其已经充分理解并同意管理人开展一般关联交易，并自愿承担相关投资风险。管理人应当在定期报告中充分向托管人和委托人披露一般关联交易情况，并按监管要求报备。</p> <p>4、关联方的披露查询方式 管理人应定期或不定期更新管理人关联方名单。托管人应在本计划成立 5 个工作日内向管理人提供托管人关联方名单，以便履行关联方信息披露义务，如后续托管人关联方名单发生变动的，</p>
--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>托管人应及时以邮件等书面形式告知管理人。</p> <p>管理人将在管理人网站披露管理人和托管人的关联方范围。关联方范围披露方式有变化的，管理人通过公告等书面形式予以披露。</p> <p>（三）关联交易的内部控制措施</p> <p>管理人已制定资产管理业务投资管理相关制度，并严格按照内部制度规定履行关联交易内部控制程序，按照市场公平合理价格执行。资产管理计划参与一般关联交易的，应经对应投资管理小组、深圳分公司投资总监（或其授权人员）审批同意后交易。涉及重大关联交易的，应经对应投资管理小组、深圳分公司投资总监（或其授权人员）、对应投决委审批同意后交易。具体决策程序以管理人内部制度规定的决策程序为准。</p> <p>管理人关联交易内部控制措施有重大变化的，管理人将在管理人网站中予以披露。</p> <p>（四）前述内容如法律法规或监管部门另有规定的，按其规定处理，管理人通过管理人网站、短信或其他方式告知投资者和托管人相关事宜，无需另行履行合同变更程序。</p>
<p>十五、投资经理的指定与变更</p>	
<p>15.1 资产管理计划投资经理由管理人负责指定。</p> <p>管理人经研究决定指定徐文祥先生为本集合计划投资经理。</p> <p>徐文祥，男，中央财经大学金融学硕士，历任金鹰基金交易主管、投资经理，6年中型公募基金投研条线经验，深谙公募基金内部运营、投研、风控体系，擅长从基金公司、基金经理、基金三个维度自上至下挖掘优质基金标的，结合大</p>	<p>（一）投资经理基本信息与相关业务经验</p> <p>本集合计划投资经理为李永杰先生。</p> <p>李永杰，南安普顿大学金融学硕士，曾就职于国内保险机构从事自营资金的基金投资管理工作，现任深圳分公司投资经理，擅长全球宏观经济分析，以大类资产配置视角自上而下选择基金，构建 FOF 投资组合，以实现收益、风险均衡为目标。</p>

<p>类资产走势构建 FOF 组合，实现收益、风险均衡管理。已经取得基金从业资格，具有良好的诚信记录和职业操守，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>15.2 管理人可以根据业务需要变更投资经理，经管理人内部审批决议后进行变更。变更后，管理人应在 5 个工作日内通知委托人和托管人。</p>	<p>(二) 管理人可以根据业务需要变更投资经理，经管理人内部审批决议后进行变更。变更后，管理人应在 5 个工作日内通知委托人和托管人。</p>
------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------

十六、资产管理计划的财产

<p>16.2.1 集合计划的银行托管账户的开设和管理</p> <p>(1) 集合计划托管人应负责本集合计划的银行托管账户的开设和管理。</p> <p>(2) 集合计划托管人以本集合计划的名义在其营业机构开设本集合计划的银行托管账户，账户名称应为“东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划”(账户名称以实际开立为准)。委托财产托管期间，托管账户预留印鉴为托管人托管业务专用章及托管人监管名章各一枚。开立的托管账户应遵循《单位银行结算账户管理协议》规定。</p> <p>16.2.5 投资定期存款的银行账户的开立和管理</p> <p>委托资产投资定期存款，存款账户预留的其中一枚印鉴应当为托管人的监管人名章，管理人应与存款机构签订定期存款协议，该协议作为划款指令附件，必须有如下明确条款：“存款证实书(或存单)不得以任何方式被质押或被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户(明确户名、开户行、账号等)，不得划入其他任何账户”。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书(或存单)等凭证后，存款证</p>	<p>(二) 集合计划财产相关账户的开立和管理</p> <p>1、集合计划的银行托管账户的开设和管理</p> <p>(1) 托管人应负责本集合计划的银行托管账户的开设和管理。托管人按照规定开立资产管理计划的托管账户以及其他投资所需账户，管理人应当给予必要的配合。</p> <p>(2) 托管人以本集合计划的名义在其营业机构开设本集合计划的银行托管账户，账户名称应为“东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划”(账户名称以实际开立为准)。</p> <p>本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付集合计划收益、收取参与款，均需通过本集合计划的银行托管账户进行。需办理资金划拨时，托管人根据管理人的有效划款指令传真件、扫描件进行划款。在托管存续期间，管理人未经托管人书面同意，不得撤销托管账户，不得在托管人柜台办理资金划拨、购买支票等结算业务，否则由此造成的受托资产损失，全部由管理人承担。</p> <p>5、投资定期存款的银行账户的开立和管理</p> <p>受托资产投资定期存款，存款账户印鉴</p>
------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<p>实书（或存单）等凭证正本需由托管人保管。管理人应该在合理的时间内进行银行存款的投资和支取事宜。若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。</p>	<p>至少预留一枚托管人的指定印章，管理人应与存款机构签订定期存款协议，该协议作为划款指令附件，必须有如下明确条款：“存款证实书（或存单）不得以任何方式被质押或被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户”。在取得存款证实书（或存单）等凭证后，存款证实书（或存单）等凭证正本需由托管人保管。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝对定期存款投资的划款指令。管理人应该在合理的时间内进行银行存款的投资和支取事宜。若管理人提前支取或部分提前支取定期存款而产生息差（即计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。</p>
---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

十八、越权交易的界定

<p>18.1 越权交易的界定 本合同所指越权交易是指管理人在委托投资交易过程中发生的如下行为： （1）违反本合同投资范围规定的投资交易行为；（2）进行法律法规禁止的超买、超卖行为。</p> <p>18.2 越权交易的处理程序 18.2.1 违反本合同投资范围的规定进行的投资交易行为 对于越权交易买进或卖出的款、券，管理人应于交割清算完成之日起二个工作日内进行相反的卖出或买进冲销处理并结算损益，若发生损失的，管理人应将与越权交易而导致的损失及相关交易费用等额的资金补足拨入委托资金账户；冲销处理后，若有盈余的，收益归委托财产所有。</p>	<p>（一）越权交易的界定 本合同所指越权交易是指管理人在投资交易过程中发生的如下行为：（1）违反本合同投资范围规定的投资交易行为；（2）法律法规禁止的超买、超卖行为。</p> <p>（二）越权交易的处理程序 1、违反本合同投资范围的规定进行的投资交易行为 对于越权交易买进或卖出的款、券，管理人应于交割清算完成之日起二个工作日内进行相反的卖出或买进冲销处理并结算损益，若发生损失的，管理人应将与越权交易而导致的损失及相关交易费用等额的资金补足拨入资金账户；冲销处理后，若有盈余的，收益归受托财产所有。</p>
--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<p>18.2.2 法律法规禁止的超买、超卖行为。管理人在委托财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，由管理人负责解决，由此给委托财产造成的损失及相关交易费用由管理人承担。如果因管理人原因发生超买行为，必须于 T+1 日上午 10:00 前完成融资，用以完成清算交收。管理人就越权交易部分未依本条规定办理，给委托财产造成损失的，由管理人承担赔偿责任。</p> <p>18.2.3 越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本委托财产所有。</p> <p>18.3 托管人对管理人投资运作的监督 托管人自本资产管理合同成立之日起，于每一估值日后按照如下条款监控。</p> <p>18.3.1 对本合同约定的投资范围进行监督；</p> <p>(1) 经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，包括股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金、QDII 基金、ETF 基金、LOF 基金等公募基金。</p> <p>(2) 国内依法发行的股票（包括科创板股票）、国债、金融债、中期票据、公司债、企业债、可转债、分离交易可转债、短期融资券、债券逆回购、非公开定向债务融资工具（PPN）、银行存款、同业存单、央行票据等。</p> <p>(3) 国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品，包括在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、证券公司资产管理计划、基金及基金子公司发行的资产管理计划、商业银行理财产品等资产管理产品。</p> <p>(4) 参与债券正回购业务。</p> <p>18.3.2 对本计划以下投资比例进行监</p>	<p>2、法律法规禁止的超买、超卖行为 管理人在受托财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，由管理人负责解决，由此给受托财产造成的损失及相关交易费用由管理人承担。如果系管理人原因发生超买行为，必须于 T+1 日上午 10:00 前完成融资，用以完成清算交收。管理人就越权交易部分未依本条规定办理，给受托财产造成损失的，由管理人承担赔偿责任。</p> <p>3、越权交易所产生的损失及相关交易费用由管理人负担，所产生的收益归本受托财产所有。</p> <p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督 托管人自本资产管理合同成立之日起，对本计划的投资履行监督职能，于每一估值日后，在双方核对一致的估值表的基础上，根据本合同第十一章投资运作的相关约定，对投资范围、投资比例、投资限制进行监督，法律、行政法规对托管人监督职责另有规定的，从其规定。</p> <p>托管人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者集合资产管理合同约定的，应当要求改正；未能改正的，有权拒绝执行，并报告中国证监会相关派出机构或按监管要求报备。</p> <p>托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、份额登记机构（中登公司）、数据供应商等相关机构提供的数据和信息。托管人对上述数据信息的真实性、准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示。管理人经托管人催告仍不按约定与托管人核对估值，导致托管人无法及时履行投资监督职责的，由过错方承担相应的责任。</p> <p>托管人向管理人披露托管人及其控股</p>
--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

督：

(1) 投资于公募基金(含货币基金)、资产管理产品的比例不低于 80%；

(2) 债券、银行存款、货币市场基金等债权类资产占资产总值的比例不超过 80%；

(3) 股票、股票型基金等股权类资产占资产总值的比例不超过 80%；

(4) 本集合计划投资同一资产的比例不超过计划资产净值的 25%；投资银行活期存款、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；

(5) 债券正回购：融入资金余额不超过集合计划净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外。

(6) 本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时所申报的金额不得超过本计划的资产总值，所申报的数量不得超过拟发行证券公司本次发行证券的总量。

(7) 法律、行政法规对托管人监督职责另有规定的，从其规定。

18.3.3 对本计划以下投资限制进行监督：

(1) 集合计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%；

(2) 除本合同另有约定外，本集合计划投资同一资产的比例不超过计划资产净值的 25%；

(3) 集合计划参与债券正回购：融入资金余额不超过集合计划净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外；

(4) 法律、行政法规对托管人监督职责另有规定的，从其规定。

托管人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者集合资产管理合同约定的，应当

股东、实际控制人或者其他关联方，具体以托管人向管理人发送的邮件通知为准；托管人向管理人披露前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息，具体以托管人面向公开市场披露的信息为准。

如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的，各方除履行必要的合同变更流程外，还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。

<p>要求改正；未能改正的，有权拒绝执行，并报告管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构。</p>	
---------------------------------------------------------	--

<p><u>十九、交易及清算交收安排</u></p>	
----------------------------	--

	<p>(一) 本资产管理计划采用托管人结算模式。</p> <p>(二) 选择代理证券买卖的证券经营机构的程序</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人负责提供专用交易单元。 2、管理人应及时将本集合计划财产证券交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知托管人。 3、管理人与托管人配合完成交易单元的合并清算事宜，资产管理人在交易前应确认相关合并清算事宜已办结。若管理人在合并清算办结前交易，则相关的交收责任由管理人承担。 <p>(三) 投资证券后的清算交收安排</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中登公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务： 资产托管人、资产管理人应共同遵守双方签署的《托管银行证券资金结算协议》及对该协议不时的更新。 2、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中登公司 T+0 非担保结算要求的证券交易： <ol style="list-style-type: none"> (1) 对于在沪深交易所交易的采用 T+0 非担保交收的交易品种（如中小企业私募债、股票质押式回购、债券质押式协议回购、资产支持证券等，根据中登公司业务规则适时调整）由系统自动出具指令，中登公司业务规则允许采用 RTGS 交收的，在计划非担保交收账户可用资金充足的情况下，托管人将进行勾单处理。对于管理人在 15:00 后出具的划款指令，特别是需要托管人进行
--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

“勾单”确认的交易，托管人本着勤勉尽责的原则积极处理，但不保证支付/勾单成功。

(2) 管理人一旦出现交易后无法履约的情况，应在第一时间通知托管人。对于中登公司允许托管人指定不履约的交易品种，管理人应向托管人出具书面的取消交收指令，另，鉴于中登公司对取消交收(指定不履约)申报时间有限，托管人有权在电话通知管理人后，先行完成取消交收操作，管理人承诺日终前补出具书面的取消交收指令。

(3) 若管理人未及时出具交易应付资金划款指令，或管理人在托管产品资金托管账户头寸不足的情况下交易，托管人有权在中登公司取消交收截止时点前半小时内主动对该笔交易进行取消交收申报，所有损失由管理人承担。

(4) 对于根据结算规则不能取消交收的交易品种，如出现前述第(2)、(3)项所述情形的，管理人知悉并同意托管人有权(但并非确保)仅根据中登公司的清算交收数据，主动将托管产品资金托管账户中的资金划入中登公司用以完成当日 T+0 非担保交收交易品种的交收。

(5) 发生以下因管理人原因所造成的情形，管理人应承担相应责任：

A、管理人所管理的产品资金不足导致其自身产品交收失败，由管理人承担交易失败的风险；

B、因管理人未在本合同约定的时间前向托管人提交有效划款指令，导致托管人无法及时完成支付结算操作而使其自身产品交收失败的，由管理人自行承担交易失败的风险；

C、因管理人所管理的产品资金不足，且占用托管人最低备付金交收成功，造

成托管人损失，则应承担赔偿责任，且托管人保留根据上海银行间市场同业拆借利率向管理人追索利息的权利；

D、因管理人所管理的产品资金不足或管理人未在规定时间内向托管人提交划款指令，且有证据证明其直接造成托管人托管的其他产品交收失败和损失的，管理人应负赔偿责任。

(6) 管理人已充分了解托管人结算模式下可能存在的交收风险。如托管人托管的其他产品资金不足或过错，进而导致管理人管理的产品交收失败的，则托管人将配合管理人提供相关数据等信息向其他客户追偿。

(7) 对于托管产品采用 T+0 非担保交收下实时结算 (RTGS) 方式完成实时交收的收款业务由系统自动出具指令，并由托管人将交收金额提回至托管产品资金托管账户。

3、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中登公司 T+N 非担保结算要求的证券交易

管理人知悉并同意托管人仅根据中登公司的清算交收数据主动完成托管产品资金清算交收。若管理人出现交易后无法履约的情况，并且中登公司的业务规则允许托管人对相关交易可以取消交收的，管理人应于交收日前一工作日向托管人出具书面的取消交收指令，并与托管人进行电话确认。

(四) 银行间交易资金结算安排

1、管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同或未及时履行合同而造成的纠纷及损失。

2、如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交

易需要取消或终止，管理人应书面通知或邮件发送至托管人，并电话确认。

3、银行间交易结算方式采用券款兑付的，托管账户与本集合计划在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨，除了登记结算机构系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管账户之外，应当由管理人出具资金划款指令，托管人审核无误后执行。

（五）投资银行存款的特别约定

1、本集合计划投资银行存款前，应与存款银行签署投资银行存款协议。

2、本集合计划投资银行存款，必须采用管理人和托管人认可的方式办理。

3、管理人投资银行存款或办理存款支取时，应及时通知托管人，以便托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。

4、因投资需要在托管银行以外的其他银行开立活期账户进行投资的，且该存款行要求管理人、托管人和存款行需在投资前另行签署三方存款协议的，托管人应配合签署三方存款协议。

（六）开放式基金投资的清算交收安排
开放式基金申购（认购）相应的资金划拨由托管人依据管理人的划款指令逐笔划付。管理人申购（认购）开放式基金时，应将划款指令连同基金申购（认购）申请单一并通过托管网银、电子直联、传真或邮件等双方认可的其他形式发送至托管人。托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行。管理人应实时调整当日可用资金余额。管理人在收到基金申购（认购）确认回单后，应立即通过托管网银、电子直联、传真或邮件等双方认可的其他形式发送至托管人。

管理人在收到赎回确认回单后，应及时

通过托管网银、电子直联、传真或邮件等双方认可的其他形式发送至托管人。为确保本集合计划财产会计核算及估值的及时处理，管理人应于开放式基金交易（包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红等）的确认日及时获取确认单等单据的传真件，要求并督促基金管理公司于当日传真给管理人，管理人收到后应立即通过托管网银、电子直联、传真或邮件等双方认可的其他形式发送至托管人。

（七）参与、退出的资金清算

管理人和托管人应当按照本合同等有关约定，在集合计划参与和退出的时间、场所、方式、程序、价格、费用、收款或付款等各方面相互配合，积极履行各自的义务，保证集合计划的参与和退出工作能够顺利进行。集合计划的参与、退出款，按照本合同的约定由托管人办理资金清算，集合计划份额的登记由管理人或管理人指定的机构办理。

（八）资金前端控制安排

根据上海证券交易所、深圳证券交易所、中登公司证券交易资金前端风险控制业务规则等有关规定，证券交易所、中登公司对管理人、托管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，管理人、托管人需按照规定进行最高额度及自设额度的申报，通过证券交易所对本集合计划实施资金前端控制。如因管理人或托管人原因导致额度申报出现异常，并进而导致本集合计划无法交易，造成损失的，由过错方承担相应责任。

（九）资金、证券账目及交易记录的核对

管理人和托管人应定期对账。

对计划财产的资金账目，以管理人与托

	<p>管人约定方式核对，确保相关各方账账相符。</p> <p>对计划财产的证券账目，由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。</p> <p>对计划财产的交易记录，管理人与托管人核对估值结果之前，应保证所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致，如果实际交易记录与会计账簿记录不一致，造成会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由管理人承担。</p>
<p>十九、资产管理计划财产的估值和会计核算</p>	
<p>.....</p> <p>19.3 集合计划财产的估值方法:</p> <p>19.3.1 固定收益品种的估值方法</p> <p>(1) 证券交易所上市的有价证券的估值:</p> <p>交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;</p> <p>交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值;</p> <p>交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价;</p> <p>交易所上市不存在活跃市场的有价证券，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值;</p> <p>对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，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估值日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日</p>	<p>.....</p> <p>(四) 集合计划财产的估值方法及其调整</p> <p>1、对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。</p> <p>2、对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。</p> <p>对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。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、对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价;实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。</p> <p>4、对于未上市或未挂牌转让且不存在</p>

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，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

(2) 首次公开发行未上市的债券，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值，在第三方估值机构还未提供估值净价前按成本估值。

(3) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。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。对银行间市场未上市，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，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。

(4) 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。

(5) 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。

.....

19.3.3 基金的估值方法

(1) 非上市基金的估值

- ①非货币市场基金按所投资基金估值日的份额净值估值。
- ②货币市场基金按所投资基金前一估值日至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

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。

5、对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息，或者有其他可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，第三方估值基准服务机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。管理人在与托管人协商一致后，可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。

.....

7、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

8、基金（含比照公募基金管理的资产管理产品）的估值方法

(1) 非上市基金的估值

- ①非货币市场基金按所投资基金估值日的份额净值估值。
- ②货币市场基金按所投资基金前一估值日至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。

(2) 交易所上市基金的估值

- ①ETF 基金按所投资 ETF 基金估值日的收盘价估值。
- ②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上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。
- ④上市交易型货币市场基金，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

(2) 交易所上市基金的估值

- ①ETF 基金按所投资 ETF 基金估值日的收盘价估值。
- ②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上市定期开放式基金、封闭式基金, 按所投资基金估值日的收盘价估值。
- ④上市交易型货币市场基金, 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。

19.5 估值程序

集合计划资产净值和集合计划份额单位资产净值由管理人负责计算, 托管人对集合计划资产净值、集合计划份额单位资产净值进行复核, 法律法规有明确规定的除外。管理人应于每个工作日结束后计算得出当日的集合计划资产净值、单位资产净值。托管人应在收到集合计划资产净值估值结果后对净值计算结果进行复核, 并以双方约定的方式将复核结果传送给管理人; 如果托管人的估值结果与管理人的估值结果存在差异, 且双方经协商未能达成一致, 管理人有权按照其对集合计划净值的计算结果对外予以公布, 由此产生的估值错误, 由过错方承担相应赔偿责任, 托管人有权将相关情况报集合计划管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证监会业协会备案。

如管理人或托管人发现估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护委托人利益的情形, 应立即通知对方, 共同查明

金收益。

(五) 估值程序

集合计划资产净值和集合计划份额单位资产净值由管理人负责计算, 托管人对集合计划资产净值、集合计划份额单位资产净值进行复核, 法律法规有明确规定的除外。管理人应于每 T+2 个工作日结束后计算得出 T 日的集合计划资产净值、单位资产净值。托管人应在收到集合计划资产净值估值结果后对净值计算结果进行复核, 并以双方约定的方式将复核结果传送给管理人; 如果托管人的估值结果与管理人的估值结果存在差异, 双方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对; 如果仍无法达成一致, 管理人有权按照其对集合计划净值的计算结果对外予以公布, 由此产生的估值错误, 由过错方承担相应赔偿责任, 托管人有权将相关情况报管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及协会备案或按监管要求报备。

如管理人或托管人发现集合计划资产估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护委托人利益的情形, 应立即通知对方, 共同查明原因, 双方协商解决。

原因，双方协商解决。

二十一、资产管理计划的费用与税收

.....

20.4 管理人业绩报酬

本集合计划在集合计划分红日、委托人份额退出或集合计划终止清算时，管理人根据实际年化收益率提取业绩报酬。原则上业绩报酬的提取频率不超过每6个月一次，因委托人退出本集合计划提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

本集合计划的业绩报酬计提基准设定为6%，对于集合计划实际年化收益率大于对应份额业绩报酬计提基准的部分，管理人按照20%的比例计提业绩报酬。业绩报酬计提基准是管理人通过深入分析国内外宏观经济形势、社会资金及金融市场利率走势，依据所投资品种综合收益预测，并不是管理人向委托人承诺的预期收益或保证收益，委托人将自行承担投资风险。

20.4.2 业绩报酬计算方法：

以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（以下简称“上一个业绩报酬计提日”，如未发生业绩报酬计提，初始募集期内认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内认购的，以认购当日为上一个业绩报酬计提日，下同）到本次业绩报酬计提日为计提区间计算年化收益率R。

年化收益率计算公式如下：

$$R=100%*(P1-P0)/(P*D)*(当年天数)$$

P1为业绩报酬计提日的单位累计净值；
P0为上一业绩报酬计提日的单位累计净值；
P为上一业绩报酬计提日的单位净值；
D为计提区间存续天数；
R为年化收益率；

.....

（二）费率、计提标准、计提方式与支付方式

4、管理人业绩报酬

本集合计划在集合计划分红日、委托人份额退出或集合计划终止清算时，管理人根据集合计划份额的实际年化收益率提取业绩报酬，业绩报酬应当计入总管理费。从分红资金中提取业绩报酬的提取频率不超过每6个月一次。

本集合计划的业绩报酬计提基准设定为6%，对于集合计划实际年化收益率大于对应份额业绩报酬计提基准的部分，管理人按照20%的比例计提业绩报酬。业绩报酬计提基准是管理人通过深入分析国内外宏观经济形势、社会资金及金融市场利率走势设定的提取业绩报酬的基准，并不是管理人向委托人承诺的预期收益或保证收益，委托人将自行承担投资风险。

随着宏观经济和利率水平变化，管理人有权调整业绩报酬计提基准，并提前在管理人网站上进行公告。委托人和托管人签署本合同即视为同意并授权管理人可以直接调低业绩报酬计提比例或调高业绩报酬计提基准，并在管理人指定网站公告。但若管理人拟调高业绩报酬计提比例或调低业绩报酬计提基准，应事先按照资产管理合同的约定履行合同变更程序。（2）业绩报酬计算方法：

以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（以下简称“上一个业绩报酬计提日”，如未发生业绩报酬计提，初始募集期内认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内

<p>业绩报酬的计算公式为： $E=K*(R-R_0)*20\%*D/(当年天数)$ E=业绩报酬； R₀=业绩报酬计提基准； K=业绩报酬计提日对应的份额×上一业绩报酬计提日单位资产净值。</p> <p>20.4.3 当集合计划份额分红、退出或集合计划终止时，托管人根据管理人指令，将应付给管理人的业绩报酬从托管账户中划拨给管理人。</p> <p>20.5 集合计划的税收 本集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规执行。</p> <p>.....</p>	<p>认购的，以认购当日为上一个业绩报酬计提日，下同）到本次业绩报酬计提日为计提区间计算年化收益率 R。 年化收益率计算公式如下： $R=100\%*(P_1-P_0)/(P*D)*(当年天数)$ P₁ 为业绩报酬计提日的单位累计净值； P₀ 为上一业绩报酬计提日的单位累计净值； P 为上一业绩报酬计提日的单位净值； D 为计提区间存续天数； R 为年化收益率； 业绩报酬的计算公式为： $E=K*(R-R_0)*20\%*D/(当年天数)$ E=业绩报酬； R₀=业绩报酬计提基准； K=业绩报酬计提日对应的份额×上一业绩报酬计提日单位资产净值。 R-R₀≤0 时，E=0</p> <p>(3) 当集合计划份额分红、委托人份额退出或集合计划终止清算时，托管人根据管理人指令，将应付给管理人的业绩报酬从托管账户中划拨给管理人。由于涉及份额注册登记，管理人负责计算业绩报酬，托管人不复核，仅负责按照管理人出具的划款指令进行划款并配合进行账务处理。</p> <p>5、增值税等应纳税费 本集合计划运营过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，法律法规有其他规定的，从其规定；本集合计划运营过程中发生的增值税及附加税费在本集合计划受托资产中列支，集合计划应每月计征应交增值税及附加税费，由管理人、托管人根据规定在纳税申报期结束前将应交增值税及附加税费款项划至管理人指定的缴税账户，管理人按规定缴纳增值税及附加</p>
---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>税费。法律法规及其他规范性文件对资产管理计划运营过程中发生的应税行为另有规定的，管理人根据规定执行。受托资产运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律法规执行。</p> <p>(三) 不列入资产管理业务费用的项目 集合计划成立前发生的费用以及存续期间发生的与募集有关的费用，及管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失，以及处理与集合计划运作无关的事项或不合理事项所发生的费用等不列入集合计划费用。</p> <p>(四) 管理费、业绩报酬、托管费银行账户</p> <p>1、托管费划入托管人指定的银行账户，账户信息如下： 户名：证券公司客户资产管理计划托管业务收入 账号：399410191675000100 大额支付行号：309581000070 开户银行：兴业银行广州分行</p> <p>2、管理费、业绩报酬、税费、交易佣金划入管理人指定的银行账户，账户信息如下： 户名：东莞证券股份有限公司 账号：2010021319900008088 开户银行：工商银行东莞市分行营业部</p>
二十一 资产管理计划的收益分配	
<p>21.1 可供分配利润的构成 可供分配利润包括：集合计划投资所得债券利息、买卖证券收益、银行存款利息及其他合法收入。</p> <p>21.2 可供分配利润：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收益的孰低数。</p> <p>21.3 收益分配原则</p>	<p>(一) 可供分配利润的构成 本集合计划可供分配利润为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收益的孰低数。 资产管理计划收益包括集合计划投资所得债券利息、买卖证券收益、银行存款利息及其他合法收入。</p> <p>(二) 收益分配原则</p>

<p>集合计划收益分配应遵循下列原则：</p> <p>21.3.1 每一份份额享有同等的分配权；</p> <p>21.3.2 收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于初始面值；</p> <p>21.3.3 T日参与的计划份额不享有当日分红权益，自下一工作日起享有分红权益；</p> <p>21.3.4 集合计划收益分配次数每年不超过2次；每次收益分配占可供分配利润的50%以上；具体分配基准、比例、时间等以管理人公告为准；</p> <p>21.3.5 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p> <p>21.4 收益分配方案的确定与通知 收益分配方案由管理人公布并实施，收益分配方案须载明集合计划收益分配对象、分配时间、分配方式等内容。收益分配方案由管理人拟定并通知托管人，由管理人公告确定。收益分配时发生的银行转账等手续费用由持有人自行承担。</p> <p>21.5 收益分配的执行方式 本集合计划收益分配方式为现金分红，由管理人进行分配。管理人将现金红利款划往推广机构账户，再由推广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。托管人根据合同约定，对收益分配方案中的收益范围、分配方式、分配金额等要素进行核对，法律法规另有规定的从其规定。</p>	<p>集合计划收益分配应遵循下列原则：</p> <p>1、收益分配方式：委托人可选择现金分红或将现金红利按除权日的份额净值自动转为计划份额进行再投资。本集合计划收益分配方式默认为现金分红；如委托人选择红利再投资，则红利再投资的资产管理计划份额的锁定期与原持有资产管理计划份额相同。</p> <p>2、每一份份额享有同等的分配权；</p> <p>3、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于初始面值；</p> <p>4、T日参与的计划份额不享有当日分红权益，自下一工作日起享有分红权益；</p> <p>5、集合计划收益分配次数每年不超过2次；具体分配基准、比例、时间等以管理人公告为准；</p> <p>6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p> <p>（三）收益分配方案的确定、通知和实施</p> <p>1、收益分配方案由管理人公布并实施，收益分配方案须载明集合计划收益分配对象、分配时间、分配方式等内容。</p> <p>2、收益分配方案由管理人拟定并通知托管人，托管人复核金额，由管理人公告确定。收益分配时发生的银行转账等手续费用由委托人自行承担。</p> <p>3、收益分配的执行方式 收益分配方式若为现金分红的，管理人将现金红利款划往推广机构账户，再由推广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。 收益分配方式若为红利再投资形式的，分红资金在扣除管理人业绩报酬（如有）后，按分红除权日的集合计划每份</p>
-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>额净值转成集合计划份额（红利再投资不受本合同约定的最低参与金额的限制）。</p> <p>托管人根据合同约定，对收益分配方案中的收益范围、分配方式、分配金额等要素进行核对，法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p>二十三、信息披露与报告</p>	
<p>22.3.4 对账单</p> <p>管理人应当每个季度以电子邮件方式向委托人寄送对账单。对账单内容应包括委托人持有集合计划份额的数量及净值，认购、退出明细，以及收益分配等情况。如委托人提供的通讯地址或联系方式不正确等原因导致对账单未能成功送达时，委托人应当联系推广机构，更新通讯地址或联系方式。委托人亦可以直接登录本集合计划管理人网站（www.dgzq.com.cn）进行查阅。</p> <p>22.4 托管人履职报告</p> <p>22.4.1 托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人出具托管人履职报告。管理人根据本合同约定的方式向投资者披露本集合计划的季度报告、年度报告。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。</p> <p>22.4.2 管理人应当在每季度结束后一个月内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于5个工作日内向管理人反馈复核意见。</p> <p>22.4.3 管理人应当在每年度结束后四个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，</p>	<p>（四）托管人履职报告</p> <p>1、托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人出具托管人履职报告。管理人根据本合同约定的方式向投资者披露本集合计划的季度报告、年度报告。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。</p> <p>2、管理人应当在每季度结束后20日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有），以供托管人复核。托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告（如有）中的财务数据后，于5日内向管理人反馈复核意见。</p> <p>3、管理人应当在每年度结束后3个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告，以供托管人复核。托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于15个工作日内向管理人反馈复核意见。</p> <p>4、因资产管理计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月，管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告或者年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。</p>

<p>托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于15个工作日内向管理人反馈复核意见。</p> <p>22.4.4 因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。</p>	
--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--

二十三、风险揭示

<p>23.2 特殊风险揭示</p> <p>23.2.1 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</p> <p>管理人发起设立集合资产管理计划后5个工作日内，应当将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报中国证券投资基金业协会备案，监管部门将根据监管规定对集合计划发起设立情况进行审查，集合计划可能无法通过备案。若集合计划备案不成功，管理人将进行合同变更、终止集合计划或根据监管要求进行处理，由此给本集合计划带来不确定性的风险。</p> <p>23.2.2 资产管理计划委托募集所涉风险</p> <p>委托人可通过代销机构认可的平台参与或退出本集合计划，受不可抗力、交易所或者交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、交易平台系统故障、银行数据交换系统故障等其他因素的影响，委托人可能面临参与款或退出款项无法及时划付的风险或由此导致的其他损失。</p> <p>23.2.3 本计划投资于其他产品的风险</p> <p>(1) 本集合计划为基金中的基金(FOF)，主要投资于公募基金或其他资产管理产品，管理人对发行基金的管理人公司信息可能获取不全，所投基金</p>	<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>1、资产管理合同与协会合同指引不一致所涉风险</p> <p>本集合计划合同依据协会《合同内容与格式指引》及相关法律法规制定，根据管理人自身实际情况对相关内容做出了合理调整。本集合计划合同中对《合同内容与格式指引》规定内容之外的部分事项进行约定，也可能存在个别内容与《合同内容与格式指引》不完全一致，或不适用《合同内容与格式指引》中个别规定的情形，从而可能而临本合同被协会要求管理人重新修订完善的风险。</p> <p>2、资产管理计划委托募集所涉风险</p> <p>管理人可委托具有基金销售资格的机构代理销售资产管理计划，若销售机构不具备提供相关服务的条件和技能、或发生管理不善、操作失误等，或存在公开或变相公开宣传、虚假宣传、未履行合格投资者适当性审查义务、挪用侵占产品财产、以保本保收益引诱投资者购买资产管理产品等违法违规行为，将给投资者带来风险。</p> <p>3、募集失败风险</p> <p>本资产管理计划的成立需符合相关法律法规的规定，本资产管理计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。</p> <p>募集失败时管理人的责任承担方式：</p>
----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

的投资经理的知识、经验以及投资经理的变更等均会影响其产品的收益水平，从而产生风险。

(2) 本计划管理人按照本合同约定收取管理费、业绩报酬等费用，所投资的基金也会按照基金合同约定收取相关费用，委托人已知悉并认可该等收费方式。

(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交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

4、资产管理计划未在协会完成备案手续所涉风险

本集合计划成立之日起5个工作日内，管理人应当向协会履行备案手续或按监管要求报备。本集合计划完成备案前，除可以开展以现金管理为目的的有限品种投资外，无法完全按照本集合计划的投资范围与策略进行全面投资，从而可能对本集合计划的业绩表现造成一定的影响。特殊情况下，本集合计划可能存在无法完成备案的情况。若本集合计划无法完成备案，管理人将按规定终止本集合计划，由此导致本集合计划提前终止的风险。

5、份额转让所涉风险

本集合计划份额暂不可转让，如满足相关条件可以进行转让后，按管理人公告的条件和方式进行。因此，本集合计划存续期间可能存在不开放份额转让的风险。本集合计划如届时支持转让，可能存在难以找到交易对手或因交易双方未能就转让价格达成一致导致转让失败等风险。

6、关联交易风险

管理人可能运用受托管理资产从事关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、充分关注。

相关风险包括在关联交易的控制过程当中，由于关联方鉴定不准确、关联交易定价不合理、关联交易活动中断，或未经审核变更关联交易合同当中涉及权利义务的条款等原因导致的各种风

险。此外，托管人关联方名单由托管人提供，可能存在托管人不提供前述名单或提供的名单不完整的情形。投资者可能面临因本集合计划关联方名单的获取、界定、识别不准确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关关联交易，以至于本集合计划从事相关重大关联交易未事先再单独征询投资者意见及其他可能的相关风险。

(1) 一般关联交易风险

投资者签署本合同即代表投资者同意管理人从事重大关联交易以外的一般关联交易，不会另行逐笔事先征询投资者的意见，造成投资者无法事前知悉每笔一般关联交易的风险。

(2) 重大关联交易风险

管理人从事重大关联交易的，管理人会事先采取逐笔征求意见或公告确认等方式征得投资者的同意；如因投资者未按照管理人公告要求进行反馈，可能存在进行该笔重大关联交易与投资者主观意愿不相符的风险。在管理人就资产管理计划从事重大关联交易征求投资者意见时，若全体投资者中有部分投资者明确回复不同意该笔重大关联交易，其他同意该笔重大关联交易的投资者将面临由于部分投资者不同意、资产管理计划无法进行该笔重大关联交易的风险。

7、股票投资及股票价格波动风险

本计划投资的股票面临经济周期风险、政策风险、行业风险、上市公司经营风险等，这些都会导致股票价格发生波动，进而影响本计划的投资收益。本计划在投资管理中可能将维持部分股票投资比例，因此无法完全规避股票市场的下跌风险。投资者须在理性判断的基础上做出投资选择。

8、债券投资风险

本集合计划主要投资于债券类交易品种，因此将面临债券市场的特殊风险。

主要包括：

(1) 债券投资的交易品种的信用风险
投资于债券类交易产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，资产管理计划所投资的债券可能面临价格下跌风险，进而影响资产管理计划的净值；

(2) 债券投资的交易对手的信用风险
交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红，将对资产管理计划的资产净值造成不利影响的；

(3) 债券投资的流动性风险
债券市场的流动性受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，在某些时期成交活跃，流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，投资品种交易变现有可能增加变现成本，对资产管理计划造成不利影响的；

(4) 债券投资的市场风险
当债券市场收益率曲线出现向上移动的情形，资产管理计划所投资的债券可能出现价格下跌，进而影响资产管理计划的净值；

(5) 债券投资的估值风险
本资产管理计划的净值根据估值方法进行确定，由于债券市场流动性相对较弱，资产管理计划所投资的债券的估值价格与实际卖出的价格可能存在一定的差异，进而影响资产管理计划的净值；

9、投资债券回购的风险

本计划在进行债券正回购操作时，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。

本计划在进行债券逆回购操作时，可能由于逆回购对手方未能按时履约给投资者本金及收益带来风险。

10、可转换债券投资风险

(1) 正股价格波动的风险。可转换债券价格与股票市场价格有正向联动性，当股票市场价格下跌时，一定期间内可转换债券价格价格下跌甚至跌破票面价的情况也时有发生。虽然不影响到期收益，但正股价格一直下跌，会增加可转换债券的持有风险，也会增加持有的时间成本。

(2) 利息损失的风险。当可转换债券发行公司股价一直下跌，转股价（换股价）高于正股价格时，可转换债券持有人若大部分都不愿转股/换股，造成上市公司短期内面临巨大的偿债压力，最终偿付的利率可能不达预期。

(3) 提前赎回的风险。可转换债券发行人在发行可转换债券时就会明确在特定条件下将以某一价格赎回债券，而赎回债券往往限定了持有人收益率上限，计划投资可转换债券可能面临机会成本的损失。

11、公募基金投资风险

本资产管理计划为基金中基金（FOF），主要投资于公募基金（含比照公募基金管理资产管理产品），可能由于管理人对发行公募基金公司的内控信息获取不全，控制力不强，并且所投资公募基金的管理人的知识、经验、判断、决

策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如变更投资经理、管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响公募基金的收益水平，从而产生风险。

本集合计划可能投资于 QDII 基金，由于境外投资受到各个国家/地区宏观经济运行情况、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 QDII 基金资产面临潜在的风险。境外投资的成本、境外市场的波动性也可能高于国内市场，存在一定的市场风险。此外，受 QDII 基金估值频率、估值提供时间影响，本集合计划单位净值反应底层基金估值提供的最新净值、相对市场或存在延迟情况，从而使得本集合计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。

12、管理人计提业绩报酬的相关风险

本集合计划业绩报酬的计提，以上一个业绩报酬计提日（如未发生业绩报酬计提，初始募集期内认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内认购的，以认购当日为上一个业绩报酬计提日，下同）到本次业绩报酬计提日为计提区间计算年化收益率。在集合计划分红日、委托人份额退出或集合计划终止清算，管理人可能计提业绩报酬，该业绩报酬从委托人分红资金、份额退出资金或清算资金中扣除，本集合计划披露的单位净值尚未扣除可能产生的业绩报酬（如有），因此可能存在投资者实际得到的分红资金、份额退出资金或清算资金与其预期不一致的情形。同时由于各笔份额计提业绩报酬

的计提区间可能不同，在扣除业绩报酬（如有）后每笔集合计划份额实际得到的分红资金、份额退出资金或清算资金可能有所不同。

13、投资者参与、退出风险

（1）集合计划发生巨额退出或连续巨额退出而引起投资者无法全部退出或因暂停退出使投资者在一定时间内的退出申请被拒绝，从而导致投资者无法按时退出的风险。

（2）投资者需要部分退出本集合计划的，应确保其退出后持有的资产管理计划份额对应的资产净值应当不低于本合同约定的合格投资者最低参与金额，否则管理人有权自动将该投资者的集合计划全部份额一次性退出给投资者，从而导致投资者剩余份额被强制退出的风险。

（3）本集合计划每份额均设置最短持有期，最短持有期到期日前，集合计划份额持有人不能提出该份额的退出申请。在最短持有期满后，投资者可在开放期办理该份额退出业务。因此，投资者参与本集合计划时应充分认识每笔份额存在最短持有期内无法退出的风险。

14、资产管理计划运营事项涉及风险

本资产管理计划由中登公司提供份额登记服务，由东莞证券股份有限公司提供投资运营管理、估值与核算、信息技术等服务和支持，因中登公司、东莞证券股份有限公司经营风险、技术系统故障、操作失误等，可能使资产管理计划运营事项发生差错，从而为本集合资产管理计划的运营带来风险。

二十四五、资产管理合同的变更、终止与财产清算	
<p>24.1 资产管理合同的变更</p> <p>.....</p> <p>24.1.3 委托人对合同变更事项有异议的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：委托人可在管理人指定的临时开放期提出退出本集合计划的申请。</p> <p>.....</p> <p>24.3.2 展期的程序</p> <p>（3）不同意展期的委托人所持有份额的处理办法</p> <p>展期经管理人指定网站公告后，不同意展期的委托人，可以在征询意见发出后在管理人公告指定的临时开放期办理退出申请；委托人未办理退出申请的，管理人为保障委托人到期合法终止合同的权利，管理人将在本集合计划原存续期届满之日将该部分委托人份额全部退出，并分配收益。具体办理要求和相关事项以管理人公告为准。</p> <p>.....</p>	<p>（一）（一）资产管理合同的变更</p> <p>（二）1、管理人经与托管人书面协商一致，可以对本合同内容进行变更，本合同另有约定的除外，资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意。更新或修改的内容在管理人网站公告，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询意见。委托人应在征询意见发出后的5个工作日内给出书面或其他约定方式的答复。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。</p> <p>（三）2、因监管规则变化或证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则等要求发生变化而需要变更资产管理合同的，经管理人与托管人协商一致，可以对资产管理合同内容进行变更，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。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网站公告满3个工作日后生效。</p> <p>（四）3、委托人对合同变更事项有异议的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：委托人可在管理人指定的临时开放期提出退出本集合计划的申请。若因锁定期问题无法退出的，由管理人对委托人持有的全部份额做强制退出处理。具体办理要求和相关事项以管理人公告为准。</p> <p>（五）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</p>

	<p>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>(六) 4、合同变更生效日以管理人公告为准，管理人应当及时通知托管人合同变更生效日。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。</p> <p>(七) 5、委托人、管理人和托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失的责任。</p> <p>(八) 6、资产管理合同发生变更的，管理人应当自资产管理合同变更之日起5个工作日内报协会备案或按监管要求报备。</p> <p>.....</p>
--	-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

注：本次合同变更，管理人按照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》对《东莞证券德宝1号FOF集合资产管理计划资产管理合同》（第一次合同变更）进行了重述；以上表格列举本次合同变更的核心条款对照，并未包括全部变更内容，具体以《东莞证券德宝1号FOF集合资产管理计划资产管理合同（第二次合同变更）》为准。

附件 2

关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划 合同变更意见回复函

本委托人于此声明和承诺已详细、认真阅读并知悉《关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同变更的公告》（以下简称《公告》）的相关内容，清楚相关投资风险。本委托人书面答复“同意内容变更”或在“同意内容变更”栏目进行勾选，则视为委托人同意本次合同变更，并愿意根据《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同（第二次合同变更）》《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书（第二次合同变更）》《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书（第二次合同变更）》和《公告》的规定享有收益和自行承担损失，承担相应的决策后果。本委托人书面答复“不同意内容变更”或在“不同意内容变更”栏目进行勾选，则视为委托人不同意本次合同变更，要求退出本集合计划，并承担相应的决策后果。

本委托人于此声明和承诺本委托人的决策行为及本委托人据以实施决策行为的权限是合法的、正当的、完全的，不存在任何法律法规、已生效或即将生效的任何合同、协议、承诺等方面的约束和障碍。

意见	同意内容变更	不同意内容变更
签字/盖章		
年 月 日		

如委托人为自然人

姓名：

所属网点：

资金/TA 账号：

身份证件号码：

联系地址：

邮政编码：

联系电话：

电子邮件：

如委托人为机构客户

名称：

所属网点：

资金/TA 账号：

法定代表人/授权签字人姓名：

营业执照号码：

住所地：

邮政编码：

联系电话：

电子邮件：