

# 关于第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划 合同变更的公告

尊敬的投资者：

由我司作为管理人，江苏银行股份有限公司深圳分行作为托管人的第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2022 年 7 月 26 日成立。管理人拟对《第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》、《第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划说明书》和《第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书》进行变更。主要变更内容详见本公告附件。

根据相关法律法规，为保证投资者的利益，本计划合同变更需取得投资者和托管人同意。本计划变更事宜已经获得托管人的书面同意确认。投资者如不同意本次合同变更的应在本计划开放日 2025 年 4 月 14 日提出退出申请。未提出退出申请的，视同投资者已经同意本次合同变更。截止 2025 年 4 月 14 日，若同意合同变更的投资者数量不少于 2 人（含 2 人），则我司约定 2025 年 4 月 16 日为合同变更生效日；若同意合同变更的客户数量少于 2 人，则本计划将终止。

特此公告。

附件 1：第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划资产管理  
合同变更明细表

附件 2：第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划说明书变  
更明细表

附件 3：第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示  
书变更明细表

第一创业证券股份有限公司

二〇二五年四月十一日

附件 1：第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同变更明细表

序号	位置	原合同	变更后合同
1	“四、当事人及权利义务” “（二）管理人”	联系人：莫维亚 联系电话：0755-23838537	联系人：钟东彤 联系电话：0755-23838292
2	“五、资产管理计划的基本情况” “（五）资产管理计划的投资目标、投资范围、投资比例”	/	2、投资范围  （5）期货和衍生品类资产：增加“股指期货”
3	“八、资产管理计划的参与、退出与转让” “（五）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出资产管理计划”	2、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的条件  （3）本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、退出本计划的，应当提前 5 个工作日以公告或其他方式通知全体委托人，并书面征求托管人同意。委托人不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的，应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请；未提出退出申请的，视同委托人已经同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出。	2、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的条件  （3）本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、退出本计划的，应当提前 5 个工作日以公告或其他方式通知全体委托人，并通过邮件或双方认可的其他形式征求托管人同意。委托人不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的，应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请；未提出退出申请的，视同委托人已经同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出。  增加  4、自有资金参与、退出相关事项 授权联系邮箱  管理人： <a href="mailto:zgyypublic@fcsc.com">zgyypublic@fcsc.com</a>  托管人：

序号	位置	原合同	变更后合同
4	“十一、资产管理计划的投资” “（二）资产管理计划的 投资范围及投资比例”	/	1、投资范围  （5）期货和衍生品类资产：增加 “股指期货”
5	“十一、资产管理计划的 投资” “（七）资产管理计划的 投资策略”	3、管理人投资管理的方法和标准  （5）金融衍生品类资产 的投资策略  本产品不直接持有期货 合约，管理人可根据需要 利用开立的期货账户进行 现金管理。	3、管理人投资管理的方法和标准  （5）期货投资策略及相关安排  1）交易目的  本集合计划根据市场情况变化，择机进行套保和投机交易，以期提升产品收益表现。  2）风险控制  由于期货交易尤其是进行投机交易会涉及到对行情进行判断，因而存在着较高的市场风险，管理人会对以投机为目的的交易进行严格的控制和监管。首先，严格控制投机交易的规模，不得突破管理人有关规定及合同约定进行交易；其次，管理人将对期货的风险敞口进行监控。  3）责任承担  管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定，因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，管理人不得

序号	位置	原合同	变更后合同
			<p>承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议（如有）为准。</p> <p>4）期货保证金的流动性应急处理机制</p> <p>①应急触发条件</p> <p>管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。</p> <p>②保证金补充机制</p> <p>如出现保证金不足的情况时，管理人将首先运用集合计划资产从市场上拆借资金，如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现集合计划资产，变现时应重点考虑变现资产的流动性，以最大限度的降低损失。</p> <p>③损失责任承担</p> <p>因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿，但管理人不承担受托资产的变现损失及未及时追加保证金的损失（包括穿仓损失）。对于其他相关方的原因给投资者</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
			造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议（如有）为准。
6	“十四、利益冲突及关联交易” “（四）资产管理计划的关联交易”	<p>1、关联方范围</p> <p>（7）本计划财产以本计划关联方或者以本条第（4）、（5）、（6）项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款等）；</p> <p>（8）本计划财产以本计划关联方或者以本条第（4）、（5）、（6）项规定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产交易；</p> <p>（9）监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的（如本计划财产开展逆回购交易的，将交易对手、质押券等统一纳入管</p>	<p>1、关联方范围</p> <p>（7）本计划财产以本计划关联方或者以本条第（4）、（5）、（6）项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款、逆回购交易等）；</p> <p>（8）本计划财产以本计划关联方或者以本条第（4）、（5）、（6）项规定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产交易；</p> <p>（9）本计划财产开展逆回购交易，质押券为管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）发行的证券；</p> <p>（10）监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		理), 管理人遵照执行。	
7	“十五、投资经理的指定与变更” “（一）投资经理的指定”	<p>2、本计划投资经理</p> <p>本计划投资经理是傅婉丽</p> <p>本计划投资经理简介： 傅婉丽，毕业于中国人民大学，经济学硕士，7 年金融行业从业经验，于 2016 年加入第一创业证券，长期从事券商资管业务，熟悉资管产品投资方法，参与债券投资、基金投资业务，在券商资产管理领域积累了丰富经验。</p>	<p>2、本计划投资经理</p> <p>本计划投资经理是傅婉丽、祝嘉伟、周家生。</p> <p>本计划投资经理简介：傅婉丽，毕业于中国人民大学，经济学硕士，7 年金融行业从业经验，于 2016 年加入第一创业证券，长期从事券商资管业务，熟悉资管产品投资方法，参与债券投资、基金投资业务，在券商资产管理领域积累了丰富经验。具备基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>祝嘉伟，理学学士，FRM。于 2019 年加入第一创业证券，长期从事券商资管业务，擅长债券投资策略、量化建模、公募基金研究等，研究经验丰富。具备基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>周家生，华中科技大学数量经济学硕士，于 2021 年加入第一创业证券，长期从事券商资管业务，在量化策略开发、策略配置等方面具有丰富的经验。具备基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p>
8	“十八、交易及交收清算安排”	/	<p>增加</p> <p>“（三）期货投资的清算交收安排</p> <p>本计划相关期货投资的具体操作</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
			按照管理人、托管人及期货经纪机构签署的《期货投资操作备忘录》（以实际名称为准）的约定执行。”
9	“十九、越权交易的界定” “（三）托管人对管理人投资运作的监督”	/	1、托管人仅对以下投资范围及投资比例、投资限制进行监督：  （1）投资范围  5）期货和衍生品类资产：增加“股指期货”
10	“二十、资产管理计划财产的估值和会计核算” “3、估值方法”	/	（6）金融衍生品的估值方法  交易所交易的金融衍生品（增加“股指期货”）
11	“二十三、信息披露与报告” “（一）定期报告”	/	2、本计划的季度报告和年度报告  （1）本计划的资产管理季度报告  增加“集合计划投资期货的，管理人应当在资产管理季度报告中披露资产管理计划参与相关标的的有关情况。若监管机构对资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。”  （2）本计划的资产管理年度报告和托管年度报告  增加“集合计划投资期货的，管理人应当在资产管理年度报告中披露资



序号	位置	原合同	变更后合同
			产管理计划参与相关标的的有关情况。 若监管机构对资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。”
12	“二十四、 风险揭示” “(二) 一般风险揭示”	<p>15、其他风险</p> <p>(1) 关联交易的风险： 管理人可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易，管理人制定的划分标准、管控机制包括：</p> <p>1) 关联方范围 本计划所称关联方包括</p> <p>① 本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）；</p> <p>② 本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>③ 本计划的投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>④ 与管理人、本计划的托管人、投资顾问（如有）有其他重大利害关系的机构。</p>	<p>(1) 从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险</p> <p>按照资产管理合同约定，管理人在本计划存续期内可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易。</p> <p>管理人制定了关联交易内控管理制度，明确了关联交易的类型和范围、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并严格执行，但按照上述标准及机制进行关联交易管理时，需按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险；同时，本计划进行关联交易时虽然积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、防范利益输送，但仍可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时，管理人无法确保选择进行交易的实际交易结果（就投资完成后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，或者关联交易行为可能依</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>上述第①项为管理人全部资产管理计划的关联方第②③项为本计划的关联方。</p> <p>⑤ 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p> <p>2) 关联交易范围：本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p> <p>① 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）发行或者承销期内承销的证券；</p> <p>② 本计划财产投资于本计划托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>③ 本计划财产投资于其投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>④ 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方</p>	<p>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，从而可能影响受托资产的投资收益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。</p> <p>管理人从事一般关联交易的，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事一般关联交易。该等事先约定同意、事后统一披露的方式可能造成投资者无法及时知悉本计划从事一般关联交易并采取措施，投资者愿承担由此造成的参与财产损失。</p> <p>管理人从事重大关联交易的，可能因为重大关联交易金额或比例较高对本计划的投资运作产生较大影响。此外，对于重大关联交易，管理人将事先取得投资者同意，若投资者未及时更新有效联系方式，可能影响管理人征求意见的效率，进而可能影响本计划的投资策略实施。</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>⑤ 本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；</p> <p>⑥ 本计划财产投资于投资顾问（如有）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>⑦ 本计划财产以本计划关联方或者以本条第④、⑤、⑥项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款等）；</p> <p>⑧ 本计划财产以本计划关联方或者以本条第④、⑤、⑥项规定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产交易；</p> <p>⑨ 监管机构、基金业协</p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>会、管理人内部管理制度另有要求的（如本计划财产开展逆回购交易的，将交易对手、质押券等统一纳入管理），管理人遵照执行。</p> <p>3) 一般关联交易和重大关联交易</p> <p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易是指投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品的（本计划为 FOF 产品，或本计划投资于货币基金，或关联产品为公募基金、投资金额不超过该资管产品净值 10%且不超过公募基金份额 10%的除外）、与关联方及关联方产品为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20%或金额超过 2 亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10%或金额超过 3000 万元）的询价交易、以管理人及其关联</p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>方发行证券作为质押券开展的金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20%或金额超过 2 亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10%或金额超过 3000 万元）的逆回购交易等需强化审批、披露、报告的关联交易；一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监管机构和基金业协会的相关要求为准。</p> <p><b>委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于一般关联交易。</b>管理人将本计划财产投资于一般关联交易的，在交易完成后，定期书面告知委托人和托管人并向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p><b>管理人将本计划财产投资于重大关联交易的，应当</b></p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，逐笔通过公告等方式提前通知投资者，投资者约定时间内未提出异议的视为同意。</p> <p>委托人提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确。同时，管理人应事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>4) 关联交易的内控机制</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。管理人为此制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。</p> <p>5) 产品关联方名单披露</p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>方式</p> <p>本产品的关联方名单信息将通过公告的形式在管理人指定网站上披露或其他适当的方式通知委托人。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>管理人按照上述标准及机制进行关联交易管理时，需按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险，同时，本计划进行关联交易时可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。</p>	

附件：第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划说明书变更对照表

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
1	“基本信息” “投资范围及比例”	/	<p>1、投资范围</p> <p>（5）期货和衍生品类资产：增加“股指期货”</p>

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
2	“基金信息” “投资策略”	<p>(5) 金融衍生品类资产的投资策略</p> <p>本产品不直接持有期货合约，管理人可根据需要利用开立的期货账户进行现金管理。</p>	<p>(5) 期货投资策略及相关安排</p> <p>1) 交易目的</p> <p>本集合计划根据市场情况变化，择机进行套保和投机交易，以期提升产品收益表现。</p> <p>2) 风险控制</p> <p>由于期货交易尤其是进行投机交易会涉及到对行情进行判断，因而存在着较高的市场风险，管理人会对以投机为目的的交易进行严格的控制和监管。首先，严格控制投机交易的规模，不得突破管理人有关规定及合同约定进行交易；其次，管理人将对期货的风险敞口进行监控。</p> <p>3) 责任承担</p> <p>管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定，因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议（如有）为准。</p> <p>4) 期货保证金的流动性应急处理机制</p> <p>①应急触发条件</p> <p>管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。</p>



序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
			<p>②保证金补充机制</p> <p>如出现保证金不足的情况时，管理人将首先运用集合计划资产从市场上拆借资金；如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现集合计划资产，变现时应重点考虑变现资产的流动性，以最大限度的降低损失。</p> <p>③损失责任承担</p> <p>因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿，但管理人不承担受托资产的变现损失及未及时追加保证金的损失（包括穿仓损失）。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议（如有）为准。</p>
3	“管理人自有资金参与情况”	<p>2、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的条件</p> <p>（3）本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、退出本计划的，应当提前5个工作日以公告或其他方式通知全体委托人，并书面征求托管人同意。委托人不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的，应当在</p>	<p>2、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的条件</p> <p>（3）本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、退出本计划的，应当提前5个工作日以公告或其他方式通知全体委托人，并通过邮件或双方认可的其他形式征求托管人同意。委托人不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的，应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请；未提出退出申请的，视同委托人已经同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出。</p> <p>增加</p> <p>4、自有资金参与、退出相关事项授权联系邮箱</p>

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
		管理人通知的退出开放日提出退出申请；未提出退出申请的，视同委托人已经同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出。	管理人：zgyypublic@fcsc.com 托管人：
4	“信息披露” “定期报告”	/	<p>2、本计划的季度报告和年度报告</p> <p>（1）本计划的资产管理季度报告</p> <p>增加“集合计划投资期货的，管理人应当在资产管理季度报告中披露资产管理计划参与相关标的的有关情况。若监管机构对资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。”</p> <p>（2）本计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>增加“集合计划投资期货的，管理人应当在资产管理年度报告中披露资产管理计划参与相关标的的有关情况。若监管机构对资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。”</p>

附件：第一创业稳进平衡 2 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书变更对照表

序号	位置	原风险揭示书	变更后风险揭示书
1	“（二）一般风险揭示”	<p>15、其他风险</p> <p>（1）关联交易的风险：</p> <p>管理人可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易，管理人制定的划分标准、管控机制包括：</p> <p>1）关联方范围</p> <p>本计划所称关联方包括：</p> <p>① 本计划管理人、管理人的</p>	<p>（1）从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险</p> <p>按照资产管理合同约定，管理人在本计划存续期内可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易。</p> <p>管理人制定了关联交易内部控制管理制度，明确了关联交易的类型和范围、审批程序、信息披露、关</p>

	<p>控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）；</p> <p>② 本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>③ 本计划的投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>④ 与管理人、本计划的托管人、投资顾问（如有）有其他重大利害关系的机构。上述第①项为管理人全部资产管理计划的关联方；第②、③项为本计划的关联方。</p> <p>⑤ 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p> <p>2）关联交易范围：本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p> <p>① 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）发行或者承销期内承销的证券；</p> <p>② 本计划财产投资于本计划托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p>	<p>联数据库管理、稽核审计等内控机制并严格执行，但按照上述标准及机制进行关联交易管理时，需按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险；同时，本计划进行关联交易时虽然积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、防范利益输送，但仍可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时，管理人无法确保选择进行交易的实际交易结果（就投资完成后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，或者关联交易行为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，从而可能影响受托资产的投资收益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。</p> <p>管理人从事一般关联交易的，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事一般关联交易。该等事先约定同意、事后统一披露的方式可能造成投资者无法及时知悉本计划从事一般关</p>
--	--	---

	<p>③ 本计划财产投资于其投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>④ 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>⑤ 本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；</p> <p>⑥ 本计划财产投资于投资顾问（如有）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>⑦ 本计划财产以本计划关联方或者以本条第④、⑤、⑥项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款等）；</p> <p>⑧ 本计划财产以本计划关联方或者以本条第④、⑤、⑥项规定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产交易；</p> <p>⑨ 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的</p>	<p>关联交易并采取措施，投资者愿承担由此造成的参与财产损失。</p> <p>管理人从事重大关联交易的，可能因为重大关联交易金额或比例较高对本计划的投资运作产生较大影响。此外，对于重大关联交易，管理人将事先取得投资者同意，若投资者未及时更新有效联系方式，可能影响管理人征求意见的效率，进而可能影响本计划的投资策略实施。</p>
--	---	---

	<p>（如本计划财产开展逆回购交易的，将交易对手、质押券等统一纳入管理），管理人遵照执行。</p> <p>3) 一般关联交易和重大关联交易</p> <p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。</p> <p>重大关联交易是指投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品的（本计划为 FOF 产品，或本计划投资于货币基金，或关联产品为公募基金、投资金额不超过该资管产品净值 10% 且不超过公募基金份额 10% 的除外）、与关联方及关联方产品为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20% 或金额超过 2 亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10% 或金额超过 3000 万元）的询价交易、以管理人及其关联方发行证券作为质押券开展的金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20% 或金额超过 2 亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10% 或金额超过 3000 万元）的逆回购交易</p>	
--	---	--

	<p>等需强化审批、披露、报告的关联交易；一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监管机构和基金业协会的相关要求为准。</p> <p><b>委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于一般关联交易。</b>管理人将本计划财产投资于一般关联交易的，在交易完成后，定期书面告知委托人和托管人并向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p><b>管理人将本计划财产投资于重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，逐笔通过公告等方式提前通知投资者，投资者约定时间内未提出异议的视为同意。</b>委托人提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确。同时，管理人应事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>4) 关联交易的内部控制</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行</p>	
--	---	--

	<p>交易，防范利益冲突，禁止利益输送。管理人为此制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与交联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与交联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。</p> <p>5) 产品关联方名单披露方式</p> <p>本产品的关联方名单信息将通过公告的形式在管理人指定网站上披露或其他适当的方式通知委托人。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>管理人按照上述标准及机制进行关联交易管理时，需按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险，同时，本计划进行关联交易时可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。</p>	
--	---	--