

《东方财富证券周周添利3号集合资产管理计划资产管理合同》

合同变更及征询公告

尊敬的投资者：

由东方财富证券股份有限公司（以下简称“我公司”）担任管理人、平安银行股份有限公司上海分行担任托管人的东方财富证券周周添利3号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）自成立以来，坚持规范运作，稳健运营。根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令〔第203号〕）《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2023〕2号）相关监管精神以及资产管理计划资管合同中相关条款规定，我公司拟对《东方财富证券周周添利3号集合资产管理计划资产管理合同》进行变更，具体变更内容见附件《东方财富证券周周添利3号集合资产管理计划资产管理合同变更对照表》。

根据《东方财富证券周周添利3号集合资产管理计划资产管理合同》第二十四章第（一）款“资产管理合同的变更”相关约定，我公司与托管人已对资产管理合同变更内容协商一致，现对合同变更内容向全体投资者公告。本次变更内容将于2025年6月19日起生效。投资者对合同变更内容有异议的，可在本合同变更生效前的最近一次退出开放日（即2025年6月18日）申请退出本计划。

本次业绩报酬计提基准变更前及变更后均采用分段方式计算业绩报酬，即，本次业绩报酬计提基准的变更将触发一次分段计算。分段计算方式为：在业绩报酬计提日，投资者的每笔份额在持有期间不同计提区间的期间年化收益率超过对应区间的业绩报酬计提基准时，提取对应每段超额部分的 S 作为业绩报酬。分段计提的业绩报酬之和即为管理人的业绩报酬。业绩报酬从分红资金、退出资金或清算资金中提取。请继续持有本计划的投资者特别知悉。

投资者可通过本公司官网（www.18.cn）或本集合计划推广营业部网点了解本次公告情况。如有任何疑问，请咨询本集合计划推广机构网点工作人员。

衷心感谢您一直以来对我司产品的大力支持。

特此公告。

东方财富证券股份有限公司



附件：《东方财富证券周周添利3号集合资产管理计划资产管理合同变更对照表》

东方财富证券周周添利 3 号集合资产管理计划

资产管理合同变更对照表

根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令〔第 203 号〕）《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2023〕2 号）相关监管精神以及资产管理计划资管合同中相关条款规定，《东方财富证券周周添利 3 号集合资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》）本次合同变更内容对照如下：

1、更新《资产管理合同》项下第二章“释义”中第 40 点“流动性受限资产”，更新如下：

变更前	变更后
40、流动性受限资产：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）、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或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。	40、流动性受限资产：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或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。

2、对《资产管理合同》项下第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”第（六）款“管理人自有资金参与、退出”变更为“证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与其自身或者其子公司管理的单个集合资产管理计划的条件、方式、金额、比例以及自有资金退出的条件”，变更如下：

变更前	变更后
<p>（六）管理人自有资金参与、退出</p> <p>1、管理人自有资金参与、退出的条件、程序</p> <p>（1）在满足《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》和本合同以及其他有关规定对自有资金参与的规定的的前提下，管理人可自主决定以自有资金参与集合计划。在同时满足以下条件时，管理人自有资金可以参与、退出本集合计划：</p> <p>①管理人以自有资金参与和退出本集合计划时，应当提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意；</p> <p>②管理人以自有资金参与集合计划的份额持有期限不得少于 6 个月。</p> <p>（2）管理人以自有资金参与和退出本</p>	<p>（六）证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与其自身或者其子公司管理的单个集合资产管理计划的条件、方式、金额、比例以及自有资金退出的条件</p> <p>1、自有资金参与、退出的条件与方式</p> <p>（1）自有资金参与、退出的条件</p> <p>在满足《指导意见》《管理办法》《运作规定》和本合同以及其他有关规定对自有资金参与的规定的的前提下，证券期货经营机构及其子公司可自主决定以自有资金参与资产管理计划。在同时满足以下条件时，证券期货经营机构及其子公司自有资金可以参与、退出本计划：</p> <p>1）证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与和退出本计划时，应当提前 5 个</p>

集合计划时，需提前 5 个工作日以邮件方式征询托管人，并通过管理人网站向投资者发出征询公告。如果投资者和托管人未在征询发出后的 3 个工作日内提出异议的，应视为投资者和托管人同意管理人自有资金参与和退出本集合计划的安排。若投资者不同意的，管理人保障其退出本集合计划的权利。不同意的投资者可在公告日起至管理人自有资金参与和退出本集合计划日（含）之间的退出开放日退出本集合计划。如在公告日起至管理人自有资金参与和退出本集合计划日（含）之间无退出开放日，则管理人将设置临时开放期，临时开放期设置以管理人届时公告为准。未在前述时间回复意见，以及未在开放期内退出的投资者，均视为同意管理人自有资金的参与和退出安排。投资者明确表示不同意管理人以自有资金参与和退出本集合计划的，有权在管理人发出征询公告时规定的开放期内提出退出申请。投资者承诺，若其未提出退出申请，则视为同意管理人以自有资金参与和退出本计划的安排。

（3）为应对本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，管理人及其子公司以自有资金参与及其后续退出本计划可不受上述限制，但应及时告知投资者和托管人，并向管理人所在地中国证监会派出机构报告。

2、管理人自有资金参与的方式、金额与比例

管理人及其子公司以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本计划总份额（含管理人自有资金参与份额）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管理人及其子公司以自有资金参与本集合计划的份额合计被动超过本计划总份额的 50%，管理人应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时调整达标。

3、管理人自有资金参与部分的收益分配

管理人自有资金参与份额与投资者持

工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意；

2) 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与资产管理计划的份额持有期限不得少于 6 个月。

（2）自有资金参与、退出的程序与方式

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与和退出本计划时，需提前 5 个工作日以邮件或其他双方认可的方式征询托管人，并以公告或其他双方认可的方式征询投资者。投资者不同意的，应当在管理人征询公告或双方认可的征询方式中披露的证券期货经营机构及其子公司自有资金参与和退出的开放日（含）之前的任意一个退出开放期或为保障投资者退出权利而设置的临时开放期办理其持有本计划全部份额的退出事宜。前述日期设置以管理人届时公告或双方认可的征询方式中披露的为准。未在前述期限内退出其持有本计划全部份额的，均视为该投资者同意证券期货经营机构及其子公司可以按照前述管理人征询公告或双方认可的征询方式中披露的情况安排自有资金的参与和退出。管理人应当披露自有资金的参与、退出情况及持有期限等信息。

2、证券期货经营机构自有资金参与、调整的金额与比例

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与其自身或其子公司管理的单个集合资产管理计划的份额合计不得超过该资产管理计划总份额的 50%（含证券期货经营机构自有资金参与份额），其中管理人东方财富证券股份有限公司以自有资金参与本计划的份额不得超过本计划总份额的 40%。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。因资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，证券期货经营机构应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时调整达标。

3、因本计划规模变动等客观因素导致证券期货经营机构及其子公司自有资金参与比例被动超标，证券期货经营机构及其子公司需要退出自有资金可不受上述 1 的限

有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也有承担与计划份额相对应损失的责任。

4、风险揭示

(1) 管理人以自有资金参与本集合计划的份额，与其他投资者持有的同类份额享有同等权益、承担相同风险，且不对集合计划投资者承担任何补偿责任，也不对其他投资者的本金和收益构成承诺或担保。请投资者注意投资风险。

(2) 管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响集合计划收益。管理人将认真履行管理人职责，关注集合计划规模变动情况，控制流动性风险。

制，但事后应当及时告知投资者和托管人。

4、为应对资产管理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，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本计划可不受上述 1-2 的限制，但事后应及时告知投资者和托管人，并向管理人所在地中国证监会派出机构报告。

5、自有资金参与部分的收益分配

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额与投资者持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也有承担与计划份额相对应损失的责任。

6、风险揭示

(1) 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额，与其他投资者持有的同类份额享有同等权益、承担相同风险，且不对资产管理计划投资者承担任何补偿责任，也不对其他投资者的本金和收益构成承诺或担保。请投资者注意投资风险。

(2) 证券期货经营机构及其子公司自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响资产管理计划收益。管理人将认真履行其职责，关注资产管理计划规模变动情况，控制流动性风险。

7、全体投资者、托管人同意，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，管理人以本合同约定的方式告知投资者和托管人相关事宜。

3、对《资产管理合同》项下第十四章“利益冲突及关联交易”作如下变更：

变更前	变更后
<p>十四、利益冲突及关联交易</p> <p>(一) 本计划存在或可能存在的利益冲突情形</p> <p>1、本计划的关联方包括管理人、托管人及前述机构控股股东、实际控制人或者其他关联方。前述关联方按照《企业会计准则》的规定确定。投资者可于交易所最新公开披露的年报查询管理人和托管人具体关联方名单。</p> <p>2、本计划的关联交易情形包括但不限于：</p> <p>(1) 管理人可以在符合本计划投资范</p>	<p>十四、利益冲突及关联交易</p> <p>(一) 资产管理计划存在或可能存在利益冲突的情形</p> <p>1、本计划的关联方包括管理人、托管人及前述机构控股股东、实际控制人或者其他重大利害关系的公司。前述关联方按照《企业会计准则》的规定确定。管理人、托管人的关联方名单以年报等公开信息为准，投资者可通过年报等公开信息查询管理人、托管人关联方名单。</p> <p>2、在符合法律、行政法规、中国证监会和本计划投资范围和投资限制等相关规</p>

围的前提下，以资产管理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；

(2) 管理人可以在符合本计划投资范围的前提下，以资产管理计划资产投资于本计划关联方所设立的资产管理产品（管理人发行设立的除外）；

(3) 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或其他关联方均有权参与本计划。

符合前述第（1）项的关联交易情形，以及与关联方发生交易金额在 3000 万元以上且占公司最近一期经审计净资产绝对值 5% 以上的关联交易情形为重大关联交易。重大关联交易以外的其它关联交易情形为一般关联交易。管理人在遵守法律法规的前提下制定以上重大关联交易与一般关联交易的范围及划分标准，除法律法规明确规定的标准以外系管理人公司制度的规定，如该等制度发生修改或变更导致上述范围及划分标准调整的，管理人将根据本合同约定通过管理人网站发布公告向投资者充分披露。

(二) 利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容及披露频率

管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，采取有效措施，做好充分的信息披露和利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范和管控可能的利益冲突。具体安排包括：

1、事前管理人应履行内部适当审批程序，遵守维护投资者权益、公平和诚信、披露和报备以及合法性原则，投资经理对关联交易承担第一责任，公司按照内部制度规范指定相关决策机构或相关部门对关联交易的合法合规性以及公允性进行审核。

2、管理人以资产管理计划资产从事重大关联交易，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，采取逐笔公告确认的方式事先取得投资者同意，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。管理人应于重大关联交易完成后 5 日内通过管理人网站以公告方式向

定的前提下，管理人以资产管理计划从事关联交易，包括但不限于下列情形：

(1) 资产管理计划投资于管理人、托管人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；

(2) 资产管理计划投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理计划；

(3) 与关联方开展证券等交易，交易对手方、质押券涉及关联方；

(4) 其他依据法律、行政法规或监管规定应当认定为关联交易的情形。

以资产管理计划资产从事重大关联交易的情形为：1) 运用资产管理计划资产从事前款第（1）项所述的关联交易；2) 运用资产管理计划资产从事前款（2）-（4）项所述的关联交易，交易金额在 3000 万元以上且单笔关联交易超过本计划资产净值 20%（含）；3) 运用资产管理计划资产从事前款（2）-（4）项所述的关联交易，交易金额在 3000 万元以上且占管理人最近一期经审计净资产绝对值 5% 以上。以资产管理计划资产从事一般关联交易的情形为：运用资产管理计划资产从事关联交易，但未达到重大关联交易条件的其它关联交易情形。管理人在遵守法律法规的前提下制定以上重大关联交易与一般关联交易的范围及划分标准，除法律法规明确规定的标准以外系管理人制度的规定，如该等制度发生修改或变更导致上述范围及划分标准调整的，管理人将以公告、邮件或其他双方认可的方式告知投资者和托管人。

3、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或其他关联方均有权参与本计划。

(二) 利益冲突的处理方式

管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本计划资产，采取有效措施，做好充分利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范和管控可能的利益冲突。具体包括：

1、对价确定机制：定价机制方面，原则上关联标的应当按照市场公允价值进行定价，因市场交易不活跃等原因无法确定市

投资者和托管人披露，并向中国证监会相关派出机构报告

3、投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人以资产管理计划资产从事一般关联交易，资产管理人无需就此分别取得投资者的个别授权，但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待受托财产，并依据相关要求履行信息披露和监管报告义务。管理人应于一般关联交易完成后5个工作日内通过管理人网站以公告方式向投资者和托管人披露，并向中国证监会相关派出机构报告。

(三) 特别风险提示

1、关于重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，逐笔通过公告的方式征询投资者，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

2、关于一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的划分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐笔征询并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(四)关于关联交易划分标准及披露要求等约定，如遇有关法律、法规、监管文件作出调整且与本合同约定不一致时，由管理人依据新的规定执行并向投资者充分披露。

场公允价值的，管理人应当披露该关联交易价格的确定原则及其方法，并对该定价的公允性作出说明。

2、决策审批程序：管理人以资产管理计划资产从事关联交易应当符合本计划合同约定的投资目标及策略，并遵照公司制度要求进行决策和审批程序，遵守维护投资者权益、公平和诚信、披露和报备以及合法性原则，公司按照内部制度规范指定相关决策机构或相关部门对关联交易的合法合规性以及公允性进行审核。

(三) 利益冲突的披露方式、披露内容及披露频率

1、管理人以资产管理计划资产从事重大关联交易，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，采取逐笔征求意见或者公告确认等其他双方认可的方式事先取得投资者同意，事后5日内以公告、邮件或其他双方认可的方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

若投资者不同意该笔重大关联交易的，应当按照前述管理人征询通知要求的方式并在管理人征询通知中限定的期限内及时向管理人明确反馈不同意的意见。

若投资者未按照前述管理人征询通知中要求的方式进行反馈，或未在管理人征询通知中限定的期限内及时反馈，或在反馈中意见表示不明确的，则均视为投资者同意该笔重大关联交易。

2、投资者签署资产管理合同即视为已经充分理解并同意管理人以资产管理计划资产从事一般关联交易，管理人无需就此分别取得投资者的个别授权，但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待受托财产，并依据相关要求履行信息披露和监管报告义务。管理人应于一般关联交易完成后及时以公告、邮件或其他双方认可的方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

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资产管理计划，应向投资者充分披露，对本计划账户进行监控，并及时向中国

	<p>证监会相关派出机构报告。</p> <p>(四) 特别风险提示</p> <p>1、关于以资产管理计划资产从事重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，采取逐笔征求意见或者公告确认等其他双方认可的方式事先取得投资者同意，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。</p> <p>2、关于以资产管理计划资产从事一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的区分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易采用事先统一授权同意模式，投资者存在未被逐笔征求意见并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。</p> <p>(五) 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，管理人以公告、邮件或其他双方认可的方式告知投资者和托管人相关事宜。</p>
--	--

4、对《资产管理合同》项下第十五章“投资经理的指定与变更”作如下变更：

变更前	变更后
<p>十五、投资经理的指定与变更</p> <p>本计划的投资经理由管理人负责指定。本计划的投资经理为陶照、王海涛。</p> <p>陶照，北京大学光华管理学院金融学硕士，CFA 三级，具备 8 年金融行业从业经验。曾在中国金融期货交易所从事衍生品产品设计与宏观研究工作。2015 年入职证券公司后从事交易与投资研究相关工作，参与交易量上千亿，具备丰富的债券组合管理经验。</p> <p>王海涛，上海交通大学金融学硕士，7 年债券投研经验。曾任寰富投资咨询(上海)有限公司交易员、中证鹏元资信评估有限公司证券评级分析师、圆信永丰基金管理有限公司信用研究员、可转债研究员、专户投资经理等职。</p> <p>本计划投资经理无外部兼职、已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。资产管理计划</p>	<p>十五、投资经理的指定与变更</p> <p>本计划的投资经理由管理人负责指定。本计划的投资经理为鲍兵、杜喻言、李娜。</p> <p>鲍兵，男，复旦大学管理学院金融工程硕士。曾任兴业国际信托有限公司资产管理部投资经理、东亚前海证券有限责任公司资产管理部投资经理。现任东方财富证券资产管理总部投资经理。</p> <p>杜喻言，男，美国波士顿大学金融数学硕士，CPA、CFA 三级。曾任东亚前海证券有限责任公司资产管理部交易员、固收研究员。现任东方财富证券资产管理总部投资经理。</p> <p>李娜，女，美国杜兰大学金融学硕士。历史任职于恒泰长财证券债券融资部、海通证券固定收益部、东海基金专户理财二部和海通期货资产管理部，拥有丰富的固收投资交易经历，擅长信用债投资机会挖掘。现任东方财富证券资产管理总部投资经理。</p>

<p>的投资经理不得同时办理证券自营业务。</p> <p>若因投资经理人事变动、被监管机构采取重大行政监管措施及行政处罚等原因，管理人可以根据投资及管理需求变更本计划的投资经理。投资经理变更后，管理人应在五日内在管理人网站进行公告，并及时报送中国证监会相关派出机构、中国证券投资基金业协会。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者和托管人通知的义务。</p>	<p>本计划投资经理无外部兼职、已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。资产管理计划的投资经理不得同时办理证券自营业务。</p> <p>若因投资经理人事变动、被监管机构采取重大行政监管措施及行政处罚等原因，管理人可以根据投资及管理需求变更本计划的投资经理。投资经理变更后，管理人应在五日内在管理人网站进行公告，并及时报送中国证监会相关派出机构、中国证券投资基金业协会。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者和托管人通知的义务。</p>
---	--

5、对《资产管理合同》项下第十九章“资产管理计划财产的估值和会计核算”第（五）款“估值程序”作如下变更：

变更前	变更后
<p>(五) 估值程序</p> <p>T日管理人对T日受托资产进行估值，托管人负责进行复核。估值原则应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》、企业会计准则及其他法律、法规的规定。管理人应于估值日将净值计算结果以邮件等双方认可的方式发送给托管人。托管人于当日对净值计算结果复核后，以邮件等双方认可的方式传送给管理人，由管理人每周披露。</p> <p>资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。因此，就与受托资产有关的会计问题，本受托资产的会计责任方是管理人。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见，以管理人对资产净值的计算结果为准，但托管人有权向监管部门报告。</p> <p>本计划份额净值的计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。</p>	<p>(五) 估值程序</p> <p>T日管理人对T日受托资产进行估值，托管人负责进行复核。估值原则应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》、企业会计准则及其他法律、法规的规定。管理人应于估值日将净值计算结果以邮件等双方认可的方式发送给托管人。托管人于当日对净值计算结果复核后，以邮件等双方认可的方式传送给管理人，由管理人每周披露。</p> <p>资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。因此，就与受托资产有关的会计问题，本受托资产的会计责任方是管理人。如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见，以管理人对资产净值的计算结果为准，但托管人有权向监管部门报告。</p> <p>本计划份额净值的计算，精确到0.000001元，小数点后第七位四舍五入。</p>

6、对《资产管理合同》项下第二十章“资产管理计划的费用与税收”第（一）款第2条第（2）点“业绩报酬”作如下变更：

变更前	变更后
<p>(2) 业绩报酬</p> <p>在管理人业绩报酬计提日，管理人有权根据投资者持有的每笔受托份额期间年化收益率（R）情况收取业绩报酬。</p> <p>1) 业绩报酬的计提原则</p>	<p>(2) 业绩报酬</p> <p>1) 业绩报酬的计提原则</p> <p>①业绩报酬应当从分红资金、退出资金或清算资金中提取，从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次。</p>

①业绩报酬应当从分红资金、退出资金或清算资金中提取，从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次。

②本计划业绩报酬计提日为本计划收益分配登记日、投资者份额退出日或本计划终止清算分配日。在收益分配登记日和本计划终止清算分配日，对本计划符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬；在投资者份额退出日，按照先进先出原则对退出份额中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬。

③本计划收益分配登记日和本计划终止清算分配日符合业绩报酬计提条件的，管理人先计提业绩报酬，再分配收益或剩余资金。在投资者份额退出日符合业绩报酬计提条件的，管理人应先将投资者申请退出的份额所对应的业绩报酬从退出金额中扣除后，再向投资者分配退出款。

④业绩报酬提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的60%。

2) 业绩报酬的计提基准与提取比例

管理人于业绩报酬计提日，按份额认购时间的不同，针对投资者每笔份额分别核算其业绩报酬核算期。业绩报酬核算期是指针对投资者所持有的每笔份额，自上一个业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日期间。

本计划的业绩报酬计提基准为B。管理人根据当个业绩报酬核算期的受托人每笔份额期间年化收益率(R)对期间年化收益率(R)超过B的部分按照S的比例收取本计划业绩报酬。

业绩报酬计提基准是基于本计划投资范围、配置策略及相应投资品种的投资研究做出的综合评估，仅供投资者参考，业绩报酬计提基准限用于计算管理人业绩报酬，不代表管理人对本计划产品业绩做出的承诺和保证，也不构成管理人对投资者保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。

3) 业绩报酬的计算方法

业绩报酬的具体计算及支付如下：

②本计划业绩报酬计提日为本计划收益分配登记日、投资者份额退出日或本计划终止清算分配日。在收益分配登记日和本计划终止清算分配日，对本计划符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬；在投资者份额退出日，按照先进先出原则对退出份额中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬。

③本计划收益分配登记日和本计划终止清算分配日符合业绩报酬计提条件的，管理人先计提业绩报酬，再分配收益或剩余资金。在投资者份额退出日符合业绩报酬计提条件的，管理人应先将投资者申请退出的份额所对应的业绩报酬从退出金额中扣除后，再向投资者分配退出款。

④业绩报酬提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的60%。

2) 业绩报酬的计提基准与提取比例

管理人于业绩报酬计提日，针对投资者每笔份额分别核算其业绩报酬。在业绩报酬计提日，投资者的每笔份额在持有期间不同计提区间的期间年化收益率(R_n , $n=1, 2, 3, \dots$)超过每期的业绩报酬计提基准(B_n , $n=1, 2, 3, \dots$)时，提取对应每段超额部分的 S_n ($n=1, 2, 3, \dots$)作为业绩报酬。分段计提的业绩报酬之和即为管理人的业绩报酬。业绩报酬从分红资金、退出资金或清算资金中提取。

本计划业绩报酬计提基准(B_1)为2.30%，业绩报酬计提比例(S_1)为50%。本计划运作期间，管理人有权根据市场及运作情况调整业绩报酬计提基准(B_n , $n=2, 3, 4, \dots$)以及业绩报酬计提比例 S_n ($n=2, 3, 4, \dots$)，并在调整前向投资者公告。业绩报酬计提基准的变化，可能对投资者的利益产生不利影响。已持有本计划份额的投资者，如不同意调整业绩报酬计提基准，可在调整生效前的开放期退出本计划；如投资者未在开放期选择退出，则视为投资者同意以管理人届时公告的业绩报酬计提基准作为新的业绩报酬计提基准。

业绩报酬计提基准是基于本计划投资范围、配置策略及相应投资品种的投资研究做出的综合评估，仅供投资者参考，业绩报

$$R = \frac{P_1^* - P_0^*}{P_0^* \times D} \times 365 \times 100\%$$

其中：

R 为期间年化收益率；

P_1^* 为本计划业绩报酬计提日的单位累计净值；

P_0^* 为本计划上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的单位累计净值；

P_0 为本计划上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的单位净值。

若不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，投资者初始募集期参与的，以本计划成立日为上一业绩报酬计提日；投资者存续期参与的，以投资者参与确认当日为上一业绩报酬计提日。如本集合计划存续期由于变更合同条款且涉及业绩报酬计提日调整的，以管理人届时的调整公告为准。

管理人业绩报酬

$$Y = \begin{cases} 0, & \text{当 } R \leq B \text{ 时} \\ (R-B) \times S \times G \times D / 365, & \text{当 } R > B \text{ 时} \end{cases}$$

其中：

Y 为管理人应计提的业绩报酬；

G 为投资者该笔份额的成本 = P_0 * 当个业绩报酬计提日的投资者每笔份额数量；

D 为本计划上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数；

$B=3.00\%$ ，为业绩报酬计提基准。

$S=50\%$ ，为业绩报酬提取比例。

业绩报酬的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入计划资产。

4) 业绩报酬的支付方式

由于业绩报酬计算涉及注册登记数据，管理人业绩报酬的计算工作由管理人完成。业绩报酬在业绩报酬计提日计提并支付，由

酬计提基准限用于计算管理人业绩报酬，不代表管理人对本计划产品业绩做出的承诺和保证，也不构成管理人对投资者保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。

3) 业绩报酬的计算方法

$$\text{期间年化收益率 } R_n = (NAV'' - NAV') \div NAV \times 365 \div t, (n=1, 2, 3 \dots)$$

NAV' 为每笔份额上次成功计提日（即本次计提持有期内，第一个调整周期内计提或者无变更时，当历史未计提，则为成立日或参与日的累计净值）或本区间业绩报酬计提基准调整日（当本计提持有期内存在一个或者多个调整基准日，从第二个区间计提时，都使用本区间的计提基准调整日）的累计净值；

NAV'' 为业绩报酬计提日（本次计提周期内无基准日调整，或者存在基准日调整时最后一次调整日至本次计提日区间段计提时）或者下一个业绩报酬计提基准调整日（即存在基准日调整时，本调整生效周期内计提时）的累计净值；

NAV 为每笔份额上次成功计提日（即本次计提持有期内，第一个调整周期内计提或者无变更时，当历史未计提，则为成立日或参与日的单位净值）或本区间业绩报酬计提基准调整日（当本计提持有期内存在一个或者多个调整基准日，从第二个区间计提时，都使用本区间的计提基准调整日）的单位净值；

t 为每笔份额计提时 NAV'' 对应的累计净值日期（投资者退出时，以该笔份额退出确认日计算）与 NAV' 对应的累计净值日期（第一个调整周期内计提或者无变更时，以上次成功计提日计提，当历史未计提，则以成立日或参与确认日计算）之间的实际天数。

$$\text{业绩报酬总金额 } Y = Y_1 + Y_2 + \dots + Y_n, (n=1, 2, 3 \dots)$$

不同计提区间业绩报酬的具体计算方式为：

年化收益率 (R_n)	管理人业绩报酬 (Y_n) 计提规则
$R_n \leq B_n$	$Y_n = 0$

<p>管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额, 托管人据此计提应付管理人业绩报酬。由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令, 托管人应在收到指令的五个工作日内从本计划资产中一次性支付给管理人, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。管理人收取业绩报酬的账户同上述管理人收款账户。</p>	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="text-align: center; width: 50%;">$R_n > B_n$</td> <td style="text-align: center; width: 50%;">$Y_n = (R_n - B_n) \times S_n \times G \times t / 365$</td> </tr> </table> <p>其中: Y 为管理人应计提的业绩报酬; B_n 为每期的业绩报酬计提基准; S_n 为每期的业绩报酬计提比例; G 为该笔份额的成本 = $NAV \times$ 当个业绩报酬计提日该笔份额数量; 业绩报酬的计算保留到小数点后两位, 小数点精确位数后的部分四舍五入, 由此带来的收益和损失归入计划资产。</p> <p>4) 业绩报酬的支付方式</p> <p>由于业绩报酬计算涉及份额登记数据, 管理人业绩报酬的计算工作由管理人完成。业绩报酬在业绩报酬计提日计提并支付, 由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额, 托管人据此计提应付管理人业绩报酬。由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令, 托管人应在收到指令的五个工作日内从本计划资产中一次性支付给管理人, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。业绩报酬收款账户同管理费收款账户。</p>	$R_n > B_n$	$Y_n = (R_n - B_n) \times S_n \times G \times t / 365$
$R_n > B_n$	$Y_n = (R_n - B_n) \times S_n \times G \times t / 365$		

7、对《资产管理合同》项下第二十三章“风险揭示”第（一）款“特定风险揭示”增加第9条“业绩报酬计提基准、业绩报酬计提比例调整的风险”、第（二）款“一般风险揭示”第7条“关联交易风险”变更为“从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险”、第（三）款“其他风险揭示”增加第6条“管理人以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司从而导致管理人主体变更的风险”及第7条“本计划份额净值精度披露风险”，变更如下：

变更前	变更后
<p style="text-align: center;">（一）特定风险揭示</p> <p>1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险</p> <p>本合同是基于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（试行）》而制定的，管理人根据自身实际情况对合同指引相关内容做出了合理的调整，可能导致本合同被证券投资基金业协会认定为与合同指引不完全一致，从而要求管理人重新修订完善的风险。管理人将及时根据证券投资基金业协会的要求提交说明材料，如涉及投资者相关权利义务</p>	<p style="text-align: center;">（一）特定风险揭示</p> <p>1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险</p> <p>本合同是基于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（试行）》而制定的，管理人根据自身实际情况对合同指引相关内容做出了合理的调整，可能导致本合同被证券投资基金业协会认定为与合同指引不完全一致，从而要求管理人重新修订完善的风险。管理人将及时根据证券投资基金业协会的要求提交说明材料，如涉及投资者相关权利义务</p>

的，管理人及时在指定网站进行信息披露，相关内容以披露的信息为准。

2、本集合计划有托管，不存在未托管所涉风险

3、本集合计划委托募集所涉风险

管理人可以委托在中国证监会注册取得公开募集证券投资基金销售资格并成为证券投资基金业协会会员的机构代销本集合计划，代销机构可能存在违法违规地公开宣传、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作等行为导致基金投资者合法权益受损的风险。

4、本集合计划无外包事项，不存在外包事项所涉风险

5、本集合计划不聘请投资顾问，不存在聘请投资顾问所涉风险

6、本集合计划份额转让所涉风险

本集合计划不接受份额转让，若开通份额转让功能，将以公告为准。如若开通份额转让功能，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。所涉及的风险包括但不限于：

(1) 操作系统风险。办理转让操作的系统可能因为认为或客观原因出现故障，影响转让业务办理。

(2) 折溢价风险。办理份额转让时，份额的交易价格可能与份额单位净值发生偏离的风险。

7、本集合计划不设置份额持有人大会，不存在设置份额持有人大会所涉风险

8、本集合计划存在募集完成后未在证券投资基金业协会完成备案或证券投资基金业协会不予备案的情形，本计划在前述情形下存在需修改合同、不能投资运作或提前终止的风险。请投资者注意。

9、其他特殊风险

集合计划可能存在其他上述未列举的风险。

的，管理人及时在指定网站进行信息披露，相关内容以披露的信息为准。

2、本集合计划有托管，不存在未托管所涉风险

3、本集合计划委托募集所涉风险

管理人可以委托在中国证监会注册取得公开募集证券投资基金销售资格并成为证券投资基金业协会会员的机构代销本集合计划，代销机构可能存在违法违规地公开宣传、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作等行为导致基金投资者合法权益受损的风险。

4、本集合计划无外包事项，不存在外包事项所涉风险

5、本集合计划不聘请投资顾问，不存在聘请投资顾问所涉风险

6、本集合计划份额转让所涉风险

本集合计划不接受份额转让，若开通份额转让功能，将以公告为准。如若开通份额转让功能，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。所涉及的风险包括但不限于：

(1) 操作系统风险。办理转让操作的系统可能因为认为或客观原因出现故障，影响转让业务办理。

(2) 折溢价风险。办理份额转让时，份额的交易价格可能与份额单位净值发生偏离的风险。

7、本集合计划不设置份额持有人大会，不存在设置份额持有人大会所涉风险

8、本集合计划存在募集完成后未在证券投资基金业协会完成备案或证券投资基金业协会不予备案的情形，本计划在前述情形下存在需修改合同、不能投资运作或提前终止的风险。请投资者注意。

9、业绩报酬计提基准、业绩报酬计提比例调整的风险

管理人有权根据市场情况及本计划运作情况，调整本计划的业绩报酬计提基准、业绩报酬计提比例。投资者可能面临业绩报酬计提基准、业绩报酬计提比例调整的风险。已持有本计划份额的投资者，如不接受

	<p>调整后的业绩报酬计提基准的，有权于业绩报酬计提基准调整前的开放期退出本计划；在开放期后投资者继续持有本计划份额的，视为对调整后的业绩报酬计提基准无异议。</p> <p>同时，本计划的业绩报酬计提基准是基于本计划投资范围、配置策略及相应投资品种的投资研究做出的综合评估，仅供投资者参考，业绩报酬计提基准限于计算管理人业绩报酬，不代表管理人对本计划产品业绩做出的承诺和保证，也不构成管理人对投资者保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。</p> <p>10、其他特殊风险</p> <p>集合计划可能存在其他上述未列举的风险。</p>
<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>7、关联交易风险</p> <p>本计划可以将受托资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、实际控制人或其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或进行其他关联交易等。此种投资、交易行为构成关联交易，存在被监管层否定的政策风险和相应的关联交易风险。若本计划投资运作中发生此类关联交易，管理人将按照资产管理合同约定的方式向投资者进行披露。</p>	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>7、从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险</p> <p>(1) 本计划从事重大关联交易所涉风险：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，采取逐笔征求意见或者公告确认等其他双方认可的方式事先取得投资者同意，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。</p> <p>(2) 本计划从事一般关联交易所涉风险：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的区分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易采用事先统一授权同意模式，投资者存在未被逐笔征求意见并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。</p> <p>管理人无法确保选择进行关联交易的实际交易结果（就投资结束后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际结果更优，该类交易资产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。</p>
<p>(三) 其他风险揭示</p> <p>1、投资者无法参与或被暂停退出的风险</p> <p>(1) 管理人认定不能接受新的参与申</p>	<p>(三) 其他风险揭示</p> <p>1、投资者无法参与或被暂停退出的风险</p> <p>(1) 管理人认定不能接受新的参与申</p>

请时，投资者具有无法参与及投资者无法追加参与的风险。

(2) 本计划关于暂停退出的情况及处理方式的安排中，管理人可以暂停接受投资者的退出申请，因此，投资者可能面临份额暂时不能退出的风险。请投资者注意。

(3) 本计划存续期间，集合计划终止条件触发，或管理人根据本合同决定终止集合计划，投资者可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险，存续期内，符合资产管理合同规定情形，导致本计划提前终止。

2、使用电子签名合同的风险

本计划《集合资产管理合同》如采用电子签名方式签署，所以在集合计划的交易过程当中，可能存在以下风险：

(1) 由于互联网和移动通讯网络数据传输等原因，交易指令可能会出现中断、停顿、延迟、数据错误等情况；

(2) 投资者账号及密码信息泄露或客户身份可能被仿冒；

(3) 由于互联网和移动通讯网络上存在黑客恶意攻击的可能性，网络服务器可能会出现故障及其他不可预测的因素，交易信息可能会出现错误或延迟；

(4) 投资者的网络终端设备及软件系统可能会受到非法攻击或病毒感染，导致电子签名合同数据无法传输或传输失败。

3、突发事件风险

(1) 因业务竞争压力可能产生的风险；或者管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

(2) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划投资者利益受损。

其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

1) 发生可能导致集合计划短时间内发生巨额退出的情形；

2) 集合计划终止时，证券资产无法变

请时，投资者具有无法参与及投资者无法追加参与的风险。

(2) 本计划关于暂停退出的情况及处理方式的安排中，管理人可以暂停接受投资者的退出申请，因此，投资者可能面临份额暂时不能退出的风险。请投资者注意。

(3) 本计划存续期间，集合计划终止条件触发，或管理人根据本合同决定终止集合计划，投资者可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险，存续期内，符合资产管理合同规定情形，导致本计划提前终止。

2、使用电子签名合同的风险

本计划《集合资产管理合同》如采用电子签名方式签署，所以在集合计划的交易过程当中，可能存在以下风险：

(1) 由于互联网和移动通讯网络数据传输等原因，交易指令可能会出现中断、停顿、延迟、数据错误等情况；

(2) 投资者账号及密码信息泄露或客户身份可能被仿冒；

(3) 由于互联网和移动通讯网络上存在黑客恶意攻击的可能性，网络服务器可能会出现故障及其他不可预测的因素，交易信息可能会出现错误或延迟；

(4) 投资者的网络终端设备及软件系统可能会受到非法攻击或病毒感染，导致电子签名合同数据无法传输或传输失败。

3、突发事件风险

(1) 因业务竞争压力可能产生的风险；或者管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

(2) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划投资者利益受损。

其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

1) 发生可能导致集合计划短时间内发生巨额退出的情形；

2) 集合计划终止时，证券资产无法变

<p>现的情形；</p> <p>3) 相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；</p> <p>4) 交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行。</p> <p>4、适当性相关风险</p> <p>(1) 投资者有义务保证其提供的相关信息及材料真实、准确、完整。管理人及销售机构(如有)评定投资者的风险承受能力、作出适当性匹配意见系基于投资者提供的相关信息及证明材料真实、准确、完整的前提下作出；如投资者提供的信息及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，可能会导致投资者的风险承受能力评定、适当性匹配意见存在偏差、与实际不符的风险，管理人及销售机构(如有)有权拒绝为投资者提供服务或拒绝接受投资者的交易申请、业务申请，相关风险、责任、损失由投资者自行承担。</p> <p>管理人及销售机构(如有)禁止其工作人员为影响评估结果在投资者填写基本信息表、风险承受能力评估问卷时进行提示、暗示、诱导。投资者知晓管理人及销售机构(如有)工作人员存在前述行为，仍遵照配合致使所提供的信息及材料不真实、不准确、不完整，或存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏等情形的，视为投资者违反其应履行的适当性义务，投资者应承担由此产生的后果、损失、责任。</p> <p>(2) 投资者在其信息发生重要变化、可能影响管理人及销售机构(如有)对其作出的投资者类别划分、风险承受能力认定时，应主动告知管理人及销售机构(如有)，以便管理人及销售机构(如有)作出调整。若投资者未能及时有效告知管理人及销售机构(如有)，则存在适当性匹配意见与实际不符的风险，进而可能产生应由投资者自行承担的相应风险、责任、损失。</p> <p>(3) 投资者或产品的信息发生变化时，管理人及销售机构(如有)有权主动调整投资者的投资者分类、产品的风险等级以及适当性匹配意见。管理人及销售机构(如有)作出主动调整的，投资者的交易或者购买产品的资格可能受到影响，进而产生相应的风</p>	<p>现的情形；</p> <p>3) 相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；</p> <p>4) 交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行。</p> <p>4、适当性相关风险</p> <p>(1) 投资者有义务保证其提供的相关信息及材料真实、准确、完整。管理人及销售机构(如有)评定投资者的风险承受能力、作出适当性匹配意见系基于投资者提供的相关信息及证明材料真实、准确、完整的前提下作出；如投资者提供的信息及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，可能会导致投资者的风险承受能力评定、适当性匹配意见存在偏差、与实际不符的风险，管理人及销售机构(如有)有权拒绝为投资者提供服务或拒绝接受投资者的交易申请、业务申请，相关风险、责任、损失由投资者自行承担。</p> <p>管理人及销售机构(如有)禁止其工作人员为影响评估结果在投资者填写基本信息表、风险承受能力评估问卷时进行提示、暗示、诱导。投资者知晓管理人及销售机构(如有)工作人员存在前述行为，仍遵照配合致使所提供的信息及材料不真实、不准确、不完整，或存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏等情形的，视为投资者违反其应履行的适当性义务，投资者应承担由此产生的后果、损失、责任。</p> <p>(2) 投资者在其信息发生重要变化、可能影响管理人及销售机构(如有)对其作出的投资者类别划分、风险承受能力认定时，应主动告知管理人及销售机构(如有)，以便管理人及销售机构(如有)作出调整。若投资者未能及时有效告知管理人及销售机构(如有)，则存在适当性匹配意见与实际不符的风险，进而可能产生应由投资者自行承担的相应风险、责任、损失。</p> <p>(3) 投资者或产品的信息发生变化时，管理人及销售机构(如有)有权主动调整投资者的投资者分类、产品的风险等级以及适当性匹配意见。管理人及销售机构(如有)作出主动调整的，投资者的交易或者购买产品的资格可能受到影响，进而产生相应的风</p>
---	---

险。

5、资金前端控制风险

本计划按交易所、中登公司的要求，将对资金前端控制的额度进行设置，买入申报金额不符合资金前端控制相关额度限制的，交易所可能拒绝接受买入申报，造成交易失败，从而导致本计划资产受损的风险；或因资金前端控制异常情况交易所、中登公司采取的相关措施也可能造成本计划资产损失。

险。

5、资金前端控制风险

本计划按交易所、中登公司的要求，将对资金前端控制的额度进行设置，买入申报金额不符合资金前端控制相关额度限制的，交易所可能拒绝接受买入申报，造成交易失败，从而导致本计划资产受损的风险；或因资金前端控制异常情况交易所、中登公司采取的相关措施也可能造成本计划资产损失。

6、管理人以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司从而导致管理人主体变更的风险

在资产管理计划存续期间，管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司从而导致管理人主体变更。发生管理人主体变更时，将由上述的从事资产管理业务的公司承继和履行管理人权利义务。

7、本计划份额净值精度披露风险

本计划单位净值精确到 0.000001 元，小数点精确位数后的部分四舍五入。

本计划的销售机构是东方财富证券股份有限公司以及其他具有公开募集证券投资基金销售资格并与管理人签订代销协议的销售机构，销售机构可能因其自身技术约束等原因，存在无法如合同约定的净值精度完全展示资产管理计划份额净值的风险。

本计划以资产管理合同约定的份额净值精度为准计算参与份额及退出金额，销售渠道可能因展示净值精度不足从而导致数据计算存在尾差，请投资者充分知悉，具体以管理人最终确认数据为准。

8、对《资产管理合同》项下“附件一：风险揭示书”第二款第（一）条“特定风险揭示”增加第 9 点“业绩报酬计提基准、业绩报酬计提比例调整的风险”、第（二）条“一般风险揭示”第 7 点“关联交易风险”变更为“从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险”、第（三）条“其他风险揭示”增加第 6 点“管理人以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司从而导致管理人主体变更的风险”及第 7 点“本计划份额净值精度披露风险”，变更如下：

变更前	变更后
（一）特定风险揭示	（一）特定风险揭示

<p>1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险</p> <p>本合同是基于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（试行）》而制定的，管理人根据自身实际情况对合同指引相关内容做出了合理的调整，可能导致本合同被证券投资基金业协会认定为与合同指引不完全一致，从而要求管理人重新修订完善的风险。管理人将及时根据证券投资基金业协会的要求提交说明材料，如涉及投资者相关权利义务的，管理人及时在指定网站进行信息披露，相关内容以披露的信息为准。</p> <p>2、本集合计划有托管，不存在未托管所涉风险</p> <p>3、本集合计划委托募集所涉风险</p> <p>管理人可以委托在中国证监会注册取得公开募集证券投资基金销售资格并成为证券投资基金业协会会员的机构代销本集合计划，代销机构可能存在违法违规地公开宣传、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作等行为导致基金投资者合法权益受损的风险。</p> <p>4、本集合计划无外包事项，不存在外包事项所涉风险</p> <p>5、本集合计划不聘请投资顾问，不存在聘请投资顾问所涉风险</p> <p>6、本集合计划份额转让所涉风险</p> <p>本集合计划不接受份额转让，若开通份额转让功能，将以公告为准。如若开通份额转让功能，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。所涉及的风险包括但不限于：</p> <p>（1）操作系统风险。办理转让操作的系统可能因为认为或客观原因出现故障，影响转让业务办理。</p> <p>（2）折溢价风险。办理份额转让时，份额的交易价格可能与份额单位净值发生偏离的风险。</p> <p>7、本集合计划不设置份额持有人大会，不存在设置份额持有人大会所涉风险</p> <p>8、本集合计划存在募集完成后未在证</p>	<p>1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险</p> <p>本合同是基于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（试行）》而制定的，管理人根据自身实际情况对合同指引相关内容做出了合理的调整，可能导致本合同被证券投资基金业协会认定为与合同指引不完全一致，从而要求管理人重新修订完善的风险。管理人将及时根据证券投资基金业协会的要求提交说明材料，如涉及投资者相关权利义务的，管理人及时在指定网站进行信息披露，相关内容以披露的信息为准。</p> <p>2、本集合计划有托管，不存在未托管所涉风险</p> <p>3、本集合计划委托募集所涉风险</p> <p>管理人可以委托在中国证监会注册取得公开募集证券投资基金销售资格并成为证券投资基金业协会会员的机构代销本集合计划，代销机构可能存在违法违规地公开宣传、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作等行为导致基金投资者合法权益受损的风险。</p> <p>4、本集合计划无外包事项，不存在外包事项所涉风险</p> <p>5、本集合计划不聘请投资顾问，不存在聘请投资顾问所涉风险</p> <p>6、本集合计划份额转让所涉风险</p> <p>本集合计划不接受份额转让，若开通份额转让功能，将以公告为准。如若开通份额转让功能，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。所涉及的风险包括但不限于：</p> <p>（1）操作系统风险。办理转让操作的系统可能因为认为或客观原因出现故障，影响转让业务办理。</p> <p>（2）折溢价风险。办理份额转让时，份额的交易价格可能与份额单位净值发生偏离的风险。</p> <p>7、本集合计划不设置份额持有人大会，不存在设置份额持有人大会所涉风险</p> <p>8、本集合计划存在募集完成后未在证</p>
---	---

<p>券投资基金业协会完成备案或证券投资基金业协会不予备案的情形，本计划在前述情形下存在需修改合同、不能投资运作或提前终止的风险。请投资者注意。</p> <p>9、其他特殊风险</p> <p>集合计划可能存在其他上述未列举的风险。</p>	<p>券投资基金业协会完成备案或证券投资基金业协会不予备案的情形，本计划在前述情形下存在需修改合同、不能投资运作或提前终止的风险。请投资者注意。</p> <p>9、业绩报酬计提基准、业绩报酬计提比例调整的风险</p> <p>管理人有权根据市场情况及本计划运作情况，调整本计划的业绩报酬计提基准、业绩报酬计提比例。投资者可能面临业绩报酬计提基准、业绩报酬计提比例调整的风险。已持有本计划份额的投资者，如不接受调整后的业绩报酬计提基准的，有权于业绩报酬计提基准调整前的开放期退出本计划；在开放期后投资者继续持有本计划份额的，视为对调整后的业绩报酬计提基准无异议。</p> <p>同时，本计划的业绩报酬计提基准是基于本计划投资范围、配置策略及相应投资品种的投资研究做出的综合评估，仅供投资者参考，业绩报酬计提基准限用于计算管理人业绩报酬，不代表管理人对本计划产品业绩做出的承诺和保证，也不构成管理人对投资者保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。</p> <p>10、其他特殊风险</p> <p>集合计划可能存在其他上述未列举的风险。</p>
<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>7、关联交易风险</p> <p>本计划可以将受托资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、实际控制人或其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或进行其他关联交易等。此种投资、交易行为构成关联交易，存在被监管层否定的政策风险和相应的关联交易风险。若本计划投资运作中发生此类关联交易，管理人将按照资产管理合同约定的方式向投资者进行披露。</p>	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>7、从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险</p> <p>(1) 本计划从事重大关联交易所涉风险：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，采取逐笔征求意见或者公告确认等其他双方认可的方式事先取得投资者同意，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。</p> <p>(2) 本计划从事一般关联交易所涉风险：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的区分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易采用事先统一授权同意模式，投资者存在未被逐笔征求意见并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，</p>

	<p>在此提示投资者特别注意。</p> <p>管理人无法确保选择进行关联交易的实际交易结果(就投资结束后的实际损益情况而言)比进行类似的非关联交易的实际结果更优, 该类交易资产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。</p>
<p>(三) 其他风险揭示</p> <p>1、投资者无法参与或被暂停退出的风险</p> <p>(1) 管理人认定不能接受新的参与申请时, 投资者具有无法参与及投资者无法追加参与的风险。</p> <p>(2) 本计划关于暂停退出的情况及处理方式的安排中, 管理人可以暂停接受投资者的退出申请, 因此, 投资者可能面临份额暂时不能退出的风险。请投资者注意。</p> <p>(3) 本计划存续期间, 集合计划终止条件触发, 或管理人根据本合同决定终止集合计划, 投资者可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险, 存续期内, 符合资产管理合同规定情形, 导致本计划提前终止。</p> <p>2、使用电子签名合同的风险</p> <p>本计划《集合资产管理合同》如采用电子签名方式签署, 所以在集合计划的交易过程当中, 可能存在以下风险:</p> <p>(1) 由于互联网和移动通讯网络数据传输等原因, 交易指令可能会出现中断、停顿、延迟、数据错误等情况;</p> <p>(2) 投资者账号及密码信息泄露或客户身份可能被仿冒;</p> <p>(3) 由于互联网和移动通讯网络上存在黑客恶意攻击的可能性, 网络服务器可能会出现故障及其他不可预测的因素, 交易信息可能会出现错误或延迟;</p> <p>(4) 投资者的网络终端设备及软件系统可能会受到非法攻击或病毒感染, 导致电子签名合同数据无法传输或传输失败。</p> <p>3、突发事件风险</p> <p>(1) 因业务竞争压力可能产生的风险; 或者管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产, 或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责, 可能导</p>	<p>(三) 其他风险揭示</p> <p>1、投资者无法参与或被暂停退出的风险</p> <p>(1) 管理人认定不能接受新的参与申请时, 投资者具有无法参与及投资者无法追加参与的风险。</p> <p>(2) 本计划关于暂停退出的情况及处理方式的安排中, 管理人可以暂停接受投资者的退出申请, 因此, 投资者可能面临份额暂时不能退出的风险。请投资者注意。</p> <p>(3) 本计划存续期间, 集合计划终止条件触发, 或管理人根据本合同决定终止集合计划, 投资者可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险, 存续期内, 符合资产管理合同规定情形, 导致本计划提前终止。</p> <p>2、使用电子签名合同的风险</p> <p>本计划《集合资产管理合同》如采用电子签名方式签署, 所以在集合计划的交易过程当中, 可能存在以下风险:</p> <p>(1) 由于互联网和移动通讯网络数据传输等原因, 交易指令可能会出现中断、停顿、延迟、数据错误等情况;</p> <p>(2) 投资者账号及密码信息泄露或客户身份可能被仿冒;</p> <p>(3) 由于互联网和移动通讯网络上存在黑客恶意攻击的可能性, 网络服务器可能会出现故障及其他不可预测的因素, 交易信息可能会出现错误或延迟;</p> <p>(4) 投资者的网络终端设备及软件系统可能会受到非法攻击或病毒感染, 导致电子签名合同数据无法传输或传输失败。</p> <p>3、突发事件风险</p> <p>(1) 因业务竞争压力可能产生的风险; 或者管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产, 或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责, 可能导</p>

<p>致受托资产的损失，从而带来风险。</p> <p>(2) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划投资者利益受损。</p> <p>其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：</p> <p>1) 发生可能导致集合计划短时间内发生巨额退出的情形；</p> <p>2) 集合计划终止时，证券资产无法变现的情形；</p> <p>3) 相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；</p> <p>4) 交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行。</p> <p>4、适当性相关风险</p> <p>(1) 投资者有义务保证其提供的相关信息及材料真实、准确、完整。管理人及销售机构(如有)评定投资者的风险承受能力、作出适当性匹配意见系基于投资者提供的相关信息及证明材料真实、准确、完整的前提下作出；如投资者提供的信息及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，可能会导致投资者的风险承受能力评定、适当性匹配意见存在偏差、与实际不符的风险，管理人及销售机构(如有)有权拒绝为投资者提供服务或拒绝接受投资者的交易申请、业务申请，相关风险、责任、损失由投资者自行承担。</p> <p>管理人及销售机构(如有)禁止其工作人员为影响评估结果在投资者填写基本信息表、风险承受能力评估问卷时进行提示、暗示、诱导。投资者知晓管理人及销售机构(如有)工作人员存在前述行为，仍遵照配合致使所提供的信息及材料不真实、不准确、不完整，或存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏等情形的，视为投资者违反其应履行的适当性义务，投资者应承担由此产生的后果、损失、责任。</p> <p>(2) 投资者在其信息发生重要变化、可能影响管理人及销售机构(如有)对其作出的投资者类别划分、风险承受能力认定时，应主动告知管理人及销售机构(如有)，</p>	<p>致受托资产的损失，从而带来风险。</p> <p>(2) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划投资者利益受损。</p> <p>其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：</p> <p>1) 发生可能导致集合计划短时间内发生巨额退出的情形；</p> <p>2) 集合计划终止时，证券资产无法变现的情形；</p> <p>3) 相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；</p> <p>4) 交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行。</p> <p>4、适当性相关风险</p> <p>(1) 投资者有义务保证其提供的相关信息及材料真实、准确、完整。管理人及销售机构(如有)评定投资者的风险承受能力、作出适当性匹配意见系基于投资者提供的相关信息及证明材料真实、准确、完整的前提下作出；如投资者提供的信息及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，可能会导致投资者的风险承受能力评定、适当性匹配意见存在偏差、与实际不符的风险，管理人及销售机构(如有)有权拒绝为投资者提供服务或拒绝接受投资者的交易申请、业务申请，相关风险、责任、损失由投资者自行承担。</p> <p>管理人及销售机构(如有)禁止其工作人员为影响评估结果在投资者填写基本信息表、风险承受能力评估问卷时进行提示、暗示、诱导。投资者知晓管理人及销售机构(如有)工作人员存在前述行为，仍遵照配合致使所提供的信息及材料不真实、不准确、不完整，或存在虚假记载、误导性陈述、重大遗漏等情形的，视为投资者违反其应履行的适当性义务，投资者应承担由此产生的后果、损失、责任。</p> <p>(2) 投资者在其信息发生重要变化、可能影响管理人及销售机构(如有)对其作出的投资者类别划分、风险承受能力认定时，应主动告知管理人及销售机构(如有)，</p>
--	--

以便管理人及销售机构（如有）作出调整。若投资者未能及时有效告知管理人及销售机构（如有），则存在适当性匹配意见与实际不符的风险，进而可能产生应由投资者自行承担的相应风险、责任、损失。

（3）投资者或产品的信息发生变化时，管理人及销售机构（如有）有权主动调整投资者的投资者分类、产品的风险等级以及适当性匹配意见。管理人及销售机构（如有）作出主动调整的，投资者的交易或者购买产品的资格可能受到影响，进而产生相应的风险。

5、资金前端控制风险

本计划按交易所、中登公司的要求，将对资金前端控制的额度进行设置，买入申报金额不符合资金前端控制相关额度限制的，交易所可能拒绝接受买入申报，造成交易失败，从而导致本计划资产受损的风险；或因资金前端控制异常情况交易所、中登公司采取的相关措施也可能造成本计划资产损失。

以便管理人及销售机构（如有）作出调整。若投资者未能及时有效告知管理人及销售机构（如有），则存在适当性匹配意见与实际不符的风险，进而可能产生应由投资者自行承担的相应风险、责任、损失。

（3）投资者或产品的信息发生变化时，管理人及销售机构（如有）有权主动调整投资者的投资者分类、产品的风险等级以及适当性匹配意见。管理人及销售机构（如有）作出主动调整的，投资者的交易或者购买产品的资格可能受到影响，进而产生相应的风险。

5、资金前端控制风险

本计划按交易所、中登公司的要求，将对资金前端控制的额度进行设置，买入申报金额不符合资金前端控制相关额度限制的，交易所可能拒绝接受买入申报，造成交易失败，从而导致本计划资产受损的风险；或因资金前端控制异常情况交易所、中登公司采取的相关措施也可能造成本计划资产损失。

6、管理人以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司从而导致管理人主体变更的风险

在资产管理计划存续期间，管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司从而导致管理人主体变更。发生管理人主体变更时，将由上述的从事资产管理业务的公司承继和履行管理人权利义务。

7、本计划份额净值精度披露风险

本计划单位净值精确到 0.000001 元，小数点精确位数后的部分四舍五入。

本计划的销售机构是东方财富证券股份有限公司以及其他具有公开募集证券投资基金销售资格并与管理人签订代销协议的销售机构，销售机构可能因其自身技术约束等原因，存在无法如合同约定的净值精度完全展示资产管理计划份额净值的风险。

本计划以资产管理合同约定的份额净值精度为准计算参与份额及退出金额，销售渠道可能因展示净值精度不足从而导致数据计算存在尾差，请投资者充分知悉，具体以管理人最终确认数据为准。



10013514