

东证融汇汇选对冲 1 号集合资产管理计划 资产管理合同变更征询意见公告

尊敬的投资者：

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称“《管理办法》”）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称“《运作规定》”）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》（以下简称“《格式指引》”）、《证券期货经营机构私募资产管理计划备案办法》和集合计划运作过程中的实际业务发展情况，东证融汇证券资产管理有限公司作为东证融汇汇选对冲 1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）的管理人，经与托管人交通银行股份有限公司协商一致，拟对《东证融汇汇选对冲 1 号集合资产管理计划资产管理合同》、《东证融汇汇选对冲 1 号集合资产管理计划说明书》和《东证融汇汇选对冲 1 号集合资产管理计划风险揭示书》中的相关条款进行变更，上述变更后的法律文件详见本公告附件，请投资者仔细阅读。本次变更方案如下：

一、合同变更主要内容

根据《东证融汇汇选对冲 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（第二次修订），本次合同变更涉及的重点条款包括但不限于：

(1) 本集合计划业绩报酬的计提方法及公告方式发生

变化；(2)本集合计划参与、退出的开放日进一步明确；(3)本集合计划锁定期由 90 个自然日变更为 180 个自然日。

本次产品合同变动条款详见本公告第四部分“修改对照明细表”及变更后的法律文件。

二、合同变更流程

管理人在公司网站公告本集合计划合同变更事宜，向投资者征询本次合同变更的意见。投资者不同意变更的，应在 2025 年 6 月 25 日提出退出本集合计划的申请；投资者未在征询意见发出后的 5 个工作日即 2025 年 6 月 25 日前回复意见且未提出退出申请的，投资者未退出的计划份额将被视为同意本合同变更。投资者意见答复不同意变更且逾期未退出的，管理人有权在期限届满后将相关份额强制退出计划；投资者回复意见不明确的，视为该投资者不同意变更，按照上述相应程序处理。投资者不同意变更的，所持有份额的退出不受锁定期的限制。

管理人已履行通知投资者义务，投资者可通过管理人指定网站公告了解本次产品合同相关变动条款。投资者由于自身及第三方原因导致未收到产品变更相关信息所产生的全部后果及责任，由投资者自行承担。

三、合同变更的效力

本公告发出后的第 5 个工作日（即 2025 年 6 月 25 日）日终，如同意本次合同变更的投资者人数达到集合计划的存续条件（投资者不少于 2 人），本集合计划将继续运作，本次合同变更将于 2025 年 6 月 26 日生效。否则，本集合计划

进入终止程序。

本次合同变更生效后，本公告将构成变更后合同的组成部分。投资者、管理人和托管人无需就本次合同变更另行签字。合同变更后，投资者、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。

东证融汇证券资产管理有限公司客户服务电话：021-80105551，客户可通过拨打咨询电话答复意见。

四、《东证融汇汇选对冲1号集合资产管理计划资产管理合同》修改对照明细表

序号	位置	原条款	现条款
1	二、释义	<p>业绩报酬计提基准 本集合计划各业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准 (K_{i1}、K_{i2}...K_{i, n_i}) 及业绩报酬计提比例 (G_{i1}、G_{i2}...G_{i, n_i}) 以管理人公告为准，业绩报酬计提比例不得超过 60%。其中，第一个业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准及比例以销售公告为准，后续如调整业绩报酬计提基准及比例，管理人将于开放期之前公告，不调整则不公告。本集合计划的业绩报酬计提基准仅作为管理人收取业绩报酬的基准，不作为实际收益分配的依据本集合计划的业绩报酬计提基准仅作为管理人收取业绩报酬的基准，不作为实际收益分配的依据</p> <p>...</p> <p>开放期 本集合计划自成立之日起每周开放不超过 3 个工作日，开放期内接受投资者的参与、退出申请。具体</p>	<p>业绩报酬计提基准 本集合计划各业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准 (K_i) 及业绩报酬计提比例 (G_i) 以管理人公告为准，业绩报酬计提比例不得超过 60%。其中，本计划第二次修订生效后的第一个业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准及比例以管理人相关公告为准，后续如调整业绩报酬计提基准及比例，管理人将另行公告，不调整则不公告。</p> <p>...</p> <p>开放期 本集合计划自第二次修订生效之日起每周开放不超过三天，一般情况下每周一、三、五开放（如遇非</p>

		<p>开放期以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束开放期。开放期的具体日期以管理人公告为准。</p> <p>本集合计划对每份份额自参与日（初始募集期参与的，为本集合计划成立日；申购参与的，为参与日）起设置90个自然日的锁定期，锁定期内不办理该份额的退出业务。每份份额锁定期届满后，可在之后的每个开放期办理退出业务，法律法规及合同另有规定或约定的除外。本计划不接受违约退出。</p> <p>...</p>	<p>工作日不顺延，如遇特殊情况，管理人可调整上述开放日。）开放期内接受投资者的参与、退出申请。管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束开放期，开放期的具体日期以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p> <p>本集合计划对每份份额自参与日（初始募集期参与的，为本集合计划成立日；申购参与的，为参与日）起设置180个自然日的锁定期，锁定期内不办理该份额的退出业务。每份份额锁定期届满后，可在之后的每个开放期办理退出业务，法律法规及合同另有规定或约定的除外。</p> <p>特别地，锁定期内，管理人调整业绩报酬计提基准或比例的，投资者可在业绩报酬计提基准或比例调整前的最近一个或多个开放期申请退出，不受锁定期的限制，具体适用的开放期以管理人公告为准。</p> <p>若出现其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p> <p>除因合同变更、监管规则修订等情形，为保障投资者选择退出本集合资产管理计划权利外，本集合计划原则上不设定临时开放期。</p>
2	五、资产管理计划的基本情况	<p>（三）资产管理计划的运作方式</p> <p>开放式</p> <p>本集合计划自成立之日起每周开放不超过3个工作日，开放期内接受投资者的参与、退出申请。具体开放期以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束开放期。开放期的具体日期以管理人公告为准。</p> <p>本集合计划对每份份额自参与日（初</p>	<p>（三）资产管理计划的运作方式</p> <p>开放式</p> <p>本集合计划自第二次修订生效之日起每周开放不超过三天，一般情况下每周一、三、五开放（如遇非工作日不顺延，如遇特殊情况，管理人可调整上述开放日。）开放期内接受投资者的参与、退出申请。管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束开放期，开放期的具体日期以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视</p>

	<p>始募集期参与的，为本集合计划成立日；申购参与的，为参与日）起设置90个自然日的锁定期，锁定期内不办理该份额的退出业务。每份份额锁定期届满后，可在之后的每个开放期办理退出业务，法律法规及合同另有规定或约定的除外。本计划不接受违约退出。</p> <p>...</p> <p>(八) 资产管理计划的费用</p> <p>...</p> <p>6、管理人的业绩报酬（如有）</p> <p>在符合业绩报酬计提条件时，在计划分红日、投资者退出日和计划终止日计提业绩报酬。在投资者退出、计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金、清算资金中扣除。在计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。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> <p>对于每一个D_i ($i=1, 2, \dots, n$)，若投资者该笔份额参与期间的年化收益率(R) 低于或等于该笔计划资产对应的业绩报酬计提基准 (K_{i1}) (年化)，则业绩报酬计算结果为0；若投资者该笔份额参与期间的年化收益率(R) 高于该笔计划资产对应的业绩报酬计提基准 (K_{i1}) (年化)，则按超额收益的相应计提比例分段计算业绩报酬。</p> <p>本集合计划各业绩报酬计算周期的业</p>	<p>为履行了告知义务。</p> <p>本集合计划对每份份额自参与日(初始募集期参与的，为本集合计划成立日；申购参与的，为参与日)起设置180个自然日的锁定期，锁定期内不办理该份额的退出业务。每份份额锁定期届满后，可在之后的每个开放期办理退出业务，法律法规及合同另有规定或约定的除外。</p> <p>特别地，锁定期内，管理人调整业绩报酬计提基准或比例的，投资者可在业绩报酬计提基准或比例调整前的最近一个或多个开放期申请退出，不受锁定期的限制，具体适用的开放期以管理人公告为准。</p> <p>...</p> <p>(八) 资产管理计划的费用</p> <p>...</p> <p>6、管理人的业绩报酬（如有）</p> <p>在符合业绩报酬计提条件时，在计划分红日、投资者退出日和计划终止日计提业绩报酬。在投资者退出、计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金、清算资金中扣除。在计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。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> <p>本集合计划各业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准 (K_i) 及业绩报酬计提比例 (G_i) 以管理人公告为准，业绩报酬计提比例不得超过60%。其中，本计划第二次修订生效后的第一个业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准及比例以管理人相关公告为准，后续如调整业绩报酬计提基准及比例，管理人将另行公告，不调整则不公告。</p> <p>...</p>
--	---	---

		<p>绩报酬计提基准 (K_{i1}、K_{i2}...K_{i, n_i}) 及业绩报酬计提比例 (G_{i1}、G_{i2}...G_{i, n_i}) 以管理人公告为准, 业绩报酬计提比例不得超过 60%。其中, 第一个业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准及比例以销售公告为准, 后续如调整业绩报酬计提基准及比例, 管理人将于开放期之前公告, 不调整则不公告。本集合计划的业绩报酬计提基准仅作为管理人收取业绩报酬的基准, 不作为实际收益分配的依据。</p> <p>...</p>	
3	八、资产管理计划的参与、退出与转让	<p>(一) 资产管理计划的参与</p> <p>...</p> <p>2、参与的办理时间</p> <p>(1) 初始募集期参与</p> <p>初始募集期是指本集合计划自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 个自然日的期间, 具体募集时间以本集合计划销售公告为准。</p> <p>(2) 存续期参与</p> <p>本集合计划自成立之日起每周开放不超过 3 个工作日, 开放期内接受投资者的参与、退出申请。具体开放期以管理人公告为准, 管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。管理人可以根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束开放期。开放期的具体日期以管理人公告为准。</p> <p>本集合计划对每份份额自参与日(初始募集期参与的, 为本集合计划成立日; 申购参与的, 为参与日)起设置 90 个自然日的锁定期, 锁定期内不办理该份额的退出业务。每份份额锁定期届满后, 可在之后的每个开放期办理退出业务, 法律法规及合同另有规定或约定的除外。本计划不接受违约退出。若出现其他特殊情况, 管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调</p>	<p>(一) 资产管理计划的参与</p> <p>...</p> <p>2、参与的办理时间</p> <p>(1) 初始募集期参与</p> <p>初始募集期是指本集合计划自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 个自然日的期间, 具体募集时间以本集合计划销售公告为准。</p> <p>(2) 存续期参与</p> <p>本集合计划自第二次修订生效之日起每周开放不超过三天, 一般情况下每周一、三、五开放(如遇非工作日不顺延, 如遇特殊情况, 管理人可调整上述开放日。)开放期内接受投资者的参与、退出申请。管理人可以根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束开放期, 开放期的具体日期以管理人公告为准, 管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p> <p>本集合计划对每份份额自参与日(初始募集期参与的, 为本集合计划成立日; 申购参与的, 为参与日)起设置 180 个自然日的锁定期, 锁定期内不办理该份额的退出业务。每份份额锁定期届满后, 可在之后的每个开放期办理退出业务, 法律法规及合同另有规定或约定的除外。</p>

	<p>整并公告，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p> <p>...</p> <p>(二) 资产管理计划的退出</p> <p>1、退出场所 本集合计划在存续期间的退出将通过集合计划销售机构在销售机构指定的场所进行。</p> <p>2、退出的办理时间 本集合计划自成立之日起每周开放不超过 3 个工作日，开放期内接受投资者的参与、退出申请。具体开放期以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束开放期。开放期的具体日期以管理人公告为准。</p> <p>本集合计划对每份份额自参与日(初始募集期参与的，为本集合计划成立日；申购参与的，为参与日)起设置 90 个自然日的锁定期，锁定期内不办理该份额的退出业务。每份份额锁定期届满后，可在之后的每个开放期办理退出业务，法律法规及合同另有规定或约定的除外。本计划不接受违约退出。特别风险提示：本计划参与份额均设置 90 个自然日的锁定期，锁定期届满前，投资者存在无法退出的流动性风险，请投资者充分关注。</p> <p>...</p>	<p>特别地，锁定期内，管理人调整业绩报酬计提基准或比例的，投资者可在业绩报酬计提基准或比例调整前的最近一个或多个开放期申请退出，不受锁定期的限制，具体适用的开放期以管理人公告为准。</p> <p>若出现其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p> <p>...</p> <p>(二) 资产管理计划的退出</p> <p>1、退出场所 本集合计划在存续期间的退出将通过集合计划销售机构在销售机构指定的场所进行。</p> <p>2、退出的办理时间 本集合计划自第二次修订生效之日起每周开放不超过三天，一般情况下每周一、三、五开放（如遇非工作日不顺延，如遇特殊情况，管理人可调整上述开放日。）开放期内接受投资者的参与、退出申请。管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束开放期，开放期的具体日期以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p> <p>本集合计划对每份份额自参与日(初始募集期参与的，为本集合计划成立日；申购参与的，为参与日)起设置 180 个自然日的锁定期，锁定期内不办理该份额的退出业务。每份份额锁定期届满后，可在之后的每个开放期办理退出业务，法律法规及合同另有规定或约定的除外。</p> <p>特别风险提示：本计划参与份额均设置 180 个自然日的锁定期，锁定期届满前，投资者存在无法退出的流动性风险，请投资者充分关注。</p> <p>特别地，锁定期内，管理人调整业绩报酬计提基准或比例的，投资者可在</p>
--	--	---

			<p>业绩报酬计提基准或比例调整前的最近一个或多个开放期申请退出，不受锁定期的限制，具体适用的开放期以管理人公告为准。</p> <p>...</p>
4	十五、投资经理的指定与变更	<p>(一) 投资经理的指定</p> <p>1、投资经理的指定 集合计划投资经理由管理人负责指定。</p> <p>2、本计划投资经理 本计划投资经理为路滨、王帅。</p> <p>投资经理简历： 路滨先生，浙江大学数学学士、硕士，在衍生品和量化交易等相关领域具有较为丰富的研究经验。2012年4月至2015年4月先后在浙商期货总部研究中心、资产管理部担任分析师、产品经理等职务；2015年5月加入东北证券，先后在机构业务部、金融产品部、浙江分公司任职；2020年7月加入东证融汇证券资产管理有限公司，担任战略产品部总经理职务，并于2023年10月起兼任量化及创新投资部总经理职务，从事投资管理等相关工作。现任职东证融汇量化及创新投资部总经理、投资经理，无兼职工作。</p> <p>王帅先生，中国矿业大学管理学硕士，2004年开始从事证券行业相关工作。历任华泰证券煤炭分析师，凯基证券（亚洲）上海代表处核心分析师，东方证券首席煤炭分析师，农银汇理基金研究员、研究部副总经理、研究部负责人兼投决会委员、专户投资部副总经理。现任东证融汇证券资产管理有限公司量化及创新投资部投资经理，无兼职工作。</p> <p>...</p>	<p>(一) 投资经理的指定</p> <p>1、投资经理的指定 集合计划投资经理由管理人负责指定。</p> <p>2、本计划投资经理 本计划投资经理为魏江、王帅。</p> <p>投资经理简历： 魏江先生，上海财经大学金融工程硕士，2015年开始从事金融行业相关工作，具有丰富量化投研工作经验。2015年7月至2017年10月任通联数据股份公司量化研究员，负责多因子模型、风险模型的研发；2017年11月加入财通证券资产管理有限公司，担任投资经理助理职务，负责指数增强类策略的开发与“固收+”产品的实盘管理；2020年7月加入东证融汇证券资产管理有限公司，2020年7月至2025年5月担任公募投资管理部投资经理职务，负责量化产品的实盘管理；2025年6月起担任量化及创新投资部投资经理。现任职东证融汇量化及创新投资部投资经理，无兼职工作。</p> <p>王帅先生，中国矿业大学管理学硕士，2004年开始从事证券行业相关工作。历任华泰证券煤炭分析师，凯基证券（亚洲）上海代表处核心分析师，东方证券首席煤炭分析师，农银汇理基金研究员、研究部副总经理、研究部负责人兼投决会委员、专户投资部副总经理。现任东证融汇证券资产管理有限公司量化及创新投资部投资经理，无兼职工作。</p> <p>...</p>
5	十八、越权交易	<p>(三) 托管人对管理人的投资监督</p> <p>...</p> <p>(4) 托管人无投资责任，托管人已按照法律法规规定及本合同约定履行投资监督职责等托管人义务的，对任何管理人的投资行为（包括但不限于</p>	<p>(三) 托管人对管理人的投资监督</p> <p>...</p> <p>(4) 托管人无投资责任，托管人已按照法律法规规定及本合同约定履行投资监督职责等托管人义务的，对任何管理人的投资行为（包括但不限于其投资策</p>

		其投资策略及决定)或其投资回报不承担任何责任。如果收到投资人的书面指示,托管人将对投资监督报告所述的违规行为提供有关资料。	略及决定)或其投资回报不承担任何责任。
6	十九、资产管理计划财产的估值和会计核算	<p>(一) 资产管理计划的估值</p> <p>4、估值方法及其调整</p> <p>...</p> <p>(3) 证券投资基金(含已按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》等规定完成规范及合同变更的比照公募基金管理的证券公司大集合产品)估值方法</p> <p>1) 持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等),按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值;如果估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考监管机构或行业协会有关规定,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。</p> <p>2) 持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF)),按估值日前一交易日的基金份额净值估值;估值日前一交易日基金份额净值无公布的,按此前最近交易日的基金份额净值估值。</p> <p>3) 持有的货币市场基金,按估值日前一交易日基金的每万份收益计算。</p> <p>...</p>	<p>(一) 资产管理计划的估值</p> <p>4、估值方法及其调整</p> <p>...</p> <p>(3) 证券投资基金(含已按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》等规定完成规范及合同变更的比照公募基金管理的证券公司大集合产品)估值方法</p> <p>1) 持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等),按估值日其所在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的收盘价估值;如果估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化的,将参考监管机构或行业协会有关规定,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。</p> <p>2) 持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF)及浮动净值型货币市场基金),按估值日前一交易日的基金份额净值估值;估值日前一交易日基金份额净值无公布的,按此前最近交易日的基金份额净值估值。</p> <p>3) 持有的非浮动净值型货币市场基金,按估值日前一交易日基金的每万份收益计算。</p> <p>...</p>
7	二十、资产管理计划的费用与税收	<p>(四) 管理人的业绩报酬</p> <p>2、业绩报酬的计提方法</p> <p>...</p> <p>E_i 计算过程如下:</p> <p>本集合计划各业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准 (K_{i1}、K_{i2}...K_{i, n_i}) 及业绩报酬计提比例 (G_{i1}、G_{i2}...G_{i, n_i}) 以管理人公告为准,业绩报酬计提比例不得超过</p>	<p>(四) 管理人的业绩报酬</p> <p>2、业绩报酬的计提方法</p> <p>...</p> <p>E_i 计算过程如下:</p> <p>本集合计划各业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准 (K_i) 及业绩报酬计提比例 (G_i) 以管理人公告为准,业绩报酬计提比例不得超过 60%。其中,本计划第二次修订生效后的第一个业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准及比例以管理人相关公告为准,后续如调</p>

60%。其中，第一个业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准及比例以销售公告为准，后续如调整业绩报酬计提基准及比例，管理人将于开放期之前公告，不调整则不公告。本集合计划的业绩报酬计提基准仅作为管理人收取业绩报酬的基准，不作为实际收益分配的依据本集合计划的业绩报酬计提基准仅作为管理人收取业绩报酬的基准，不作为实际收益分配的依据。

对于每一个 D_i ($i=1, 2, \dots, n$)，若投资者该笔份额参与期间的年化收益率 (R) 低于或等于该笔计划资产对应的业绩报酬计提基准 (K_{i1}) (年化)，则业绩报酬计算结果为 0；若投资者该笔份额参与期间的年化收益率 (R) 高于该笔计划资产对应的业绩报酬计提基准 (K_{i1}) (年化)，则按超额收益的相应计提比例分段计算业绩报酬。公式如下：

每笔份额的年化收益率 R	每笔份额应计提的业绩报酬 (E_i)
$R \leq K_{i1}$	0
$K_{i1} < R \leq K_{i2}$	$(R - K_{i1}) \times G_{i1} \times (D_i / 365) \times P \times M$
$K_{i2} < R \leq K_{i3}$	$[(K_{i2} - K_{i1}) \times G_{i1} + (R - K_{i2}) \times G_{i2}] \times (D_i / 365) \times P \times M$
...	...
$K_{i,n-1} < R \leq K_{i,n}$	$[(K_{i2} - K_{i1}) \times G_{i1} + (K_{i3} - K_{i2}) \times G_{i2} + \dots + (K_{i,n-1} - K_{i,n-2}) \times G_{i,n-2} + (R - K_{i,n-1}) \times G_{i,n-1}] \times (D_i / 365) \times P \times M$
$R > K_{i,n}$	$[(K_{i2} - K_{i1}) \times G_{i1} + (K_{i3} - K_{i2}) \times G_{i2} + \dots + (K_{i,n} - K_{i,n-1}) \times G_{i,n-1} + (R - K_{i,n}) \times G_{i,n}] \times (D_i / 365) \times P \times M$

注：M 表示投资者每笔参与在上一个业绩报酬计提日对应的集合计划份额。
P 表示上一个业绩报酬计提日的单位净值。
...

3、业绩报酬计提基准仅作为业绩报酬计算的基准，供投资者的参考，不作为实际收益分配的依据，管理人未对本集合计划的收益作出任何承诺或保证。
管理人有权根据市场情况调高业绩报酬计提基准，并及时通过公告形式向

整业绩报酬计提基准及比例，管理人将另行公告，不调整则不公告。本集合计划的业绩报酬计提基准仅作为管理人收取业绩报酬的基准，不作为实际收益分配的依据本集合计划的业绩报酬计提基准仅作为管理人收取业绩报酬的基准，不作为实际收益分配的依据。

对于每一个 D_i ($i=1, 2, \dots, n$)，若投资者该笔份额参与期间的年化收益率 (R) 低于或等于该笔计划资产对应的业绩报酬计提基准 (K_i) (年化)，则业绩报酬计算结果为 0；若投资者该笔份额参与期间的年化收益率 (R) 高于该笔计划资产对应的业绩报酬计提基准 (K_i) (年化)，则按超额收益的相应计提比例计算业绩报酬。公式如下：

$$E_i = (R - K_i) \times G_i \times (D_i / 365) \times P \times M$$

注：M 表示投资者每笔参与在上一个业绩报酬计提日对应的集合计划份额。
P 表示上一个业绩报酬计提日的单位净值。
...

3、业绩报酬计提基准仅作为业绩报酬计算的基准，供投资者的参考，不作为实际收益分配的依据，管理人未对本集合计划的收益作出任何承诺或保证。
...

		<p>投资者披露，无须另行征询投资者、托管人的意见。</p> <p>...</p>	
8	二十二、信息披露与报告	<p>(三) 不定期报告</p> <p>不定期报告包括业绩报酬计提基准公告；开放期公告；临时退出开放期公告；关联方信息（如需）。</p> <p>1、业绩报酬计提基准公告</p> <p>本集合计划各业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准（K_{i1}、K_{i2}...K_{i, n_i}）及业绩报酬计提比例（G_{i1}、G_{i2}...G_{i, n_i}）以管理人公告为准，业绩报酬计提比例不得超过 60%。其中，第一个业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准及比例以销售公告为准，后续如调整业绩报酬计提基准及比例，管理人将于开放期之前公告，不调整则不公告。</p> <p>2、开放期公告</p> <p>管理人在开放期之前通过网站公布开放期相关信息。</p> <p>...</p>	<p>(三) 不定期报告</p> <p>不定期报告包括业绩报酬计提基准公告；开放期公告；临时退出开放期公告；关联方信息（如需）。</p> <p>1、业绩报酬计提基准公告</p> <p>本集合计划各业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准（K_i）及业绩报酬计提比例（G_i）以管理人公告为准，业绩报酬计提比例不得超过 60%。其中，本计划第二次修订生效后的第一个业绩报酬计算周期的业绩报酬计提基准及比例以管理人相关公告为准，后续如调整业绩报酬计提基准及比例，管理人将另行公告，不调整则不公告。</p> <p>2、开放期公告</p> <p>本计划一般情况下每周一、三、五开放，管理人不再公告此开放期。如遇特殊情况，管理人调整上述开放日时，将通过网站另行公告开放期相关信息。</p> <p>...</p>
9	二十三、风险揭示	<p>(一) 特殊风险</p> <p>...</p> <p>20、无法退出风险</p> <p>本集合计划自成立之日起每周开放不超过 3 个工作日，开放期内接受投资者的参与、退出申请。具体开放期以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束开放期。开放期的具体日期以管理人公告为准。</p> <p>本集合计划对每份份额自参与日（初始募集期参与的，为本集合计划成立日；申购参与的，为参与日）起设置 90 个自然日的锁定期，锁定期内不办理该份额的退出业务。每份份额锁定期</p>	<p>(一) 特殊风险</p> <p>...</p> <p>20、无法退出风险</p> <p>本集合计划自第二次修订生效之日起每周开放不超过三天，一般情况下每周一、三、五开放（如遇非工作日不顺延，如遇特殊情况，管理人可调整上述开放日。）开放期内接受投资者的参与、退出申请。管理人可根据资产配置安排和集合计划已有投资者利益的考虑进行额度控制。管理人可以根据情况宣布提前结束或延期结束开放期，开放期的具体日期以管理人公告为准，管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p> <p>本集合计划对每份份额自参与日（初始募集期参与的，为本集合计划成立日；申购参与的，为参与日）起设置 180 个自然日的锁定期，锁定期内不办理该份</p>

		<p>届满后，可在之后的每个开放期办理退出业务，法律法规及合同另有规定或约定的除外。</p> <p>若出现其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p> <p>投资者需注意封闭期及锁定期内无法退出的风险。</p> <p>...</p>	<p>额的退出业务。每份份额锁定期届满后，可在之后的每个开放期办理退出业务，法律法规及合同另有规定或约定的除外。</p> <p>特别地，锁定期内，管理人调整业绩报酬计提基准或比例的，投资者可在业绩报酬计提基准或比例调整前的最近一个或多个开放期申请退出，不受锁定期的限制，具体适用的开放期以管理人公告为准。</p> <p>若出现其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。</p> <p>除因合同变更、监管规则修订等情形，为保障投资者选择退出本集合资产管理计划权利外，本集合计划原则上不设定临时开放期。</p> <p>投资者需注意封闭期内无法退出的风险。</p> <p>...</p>
--	--	---	--

《东证融汇汇选对冲 1 号集合资产管理计划说明书》和《东证融汇汇选对冲 1 号集合资产管理计划风险揭示书》相应内容同步调整。

感谢投资者一贯的支持。

附件：

- 1、东证融汇汇选对冲 1 号集合资产管理计划资产管理合同（第二次修订）
- 2、东证融汇汇选对冲 1 号集合资产管理计划说明书（第

二次修订)

3、东证融汇汇选对冲 1 号集合资产管理计划风险揭示书（第二次修订）

东证融汇证券资产管理有限公司

2025 年 6 月 18 日