

野村东方国际双季利享 6 个月滚动集合资产管理计划说明书

2025 年 2 月

特别提示

为规范资产管理业务的运作，保护投资者合法权益，明确资产管理合同当事人的权利与义务，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国证券法》、《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《运作管理规定》）、《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》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称《内容与格式指引》），和其他有关法律法规，投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立《野村东方国际双季利享 6 个月滚动集合资产管理计划资产管理合同》（下称“本合同”）。

订立本合同的原则是资产管理合同当事人应遵循平等自愿、诚实信用、公平的原则订立本合同，充分维护本合同各方当事人的合法权益，不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

投资者保证资产管理计划财产的来源及用途合法，并在签订本合同前，已经过了风险承受能力测评，签署了风险揭示书，投资者阅知本合同全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险。

管理人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。管理人对委托资产未来的收益预测仅供投资者参考，不构成管理人保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

托管人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务，但不保证委托资产本金不受损失或取得最低收益。

管理人应对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”）进行备案。证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表证券投资基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

第 1 节 基本信息

序号	项目	条款				
1.1	计划名称	野村东方国际双季利享 6 个月滚动集合资产管理计划				
1.2	计划类型	固定收益类集合资产管理计划				
1.3	风险收益特征	本计划具有中风险（R3）特征。				
1.4	风险承担安排	投资者自行承担风险和损失。本计划不以任何形式保本保收益。				
1.5	管理人	野村东方国际证券有限公司				
1.6	托管人	南京银行股份有限公司				
1.7	投资经理	本计划的投资经理由管理人指定。 <table><tr><td>盛丽君</td><td>管理学硕士，10 年以上固定收益投资交易经历。曾任东吴证券债券投资部高级经理，宏信证券销售交易部总经理、资本市场部总经理。现任野村东方国际证券资产管理部固收业务负责人兼投资经理。</td></tr><tr><td>方靖</td><td>金融学硕士，5 年以上固定收益投资研究经验。曾任鹏华资产管理公司债券研究员，2019 年加入野村东方国际证券，主要从事固定收益研究，具备扎实的公司经营分析和风险识别能力。现任野村东方国际证券资产管理部投资经理。</td></tr></table> 上述投资经理已取得基金业从业资格，投资经理资格，具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备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，且无在外兼职情形。	盛丽君	管理学硕士，10 年以上固定收益投资交易经历。曾任东吴证券债券投资部高级经理，宏信证券销售交易部总经理、资本市场部总经理。现任野村东方国际证券资产管理部固收业务负责人兼投资经理。	方靖	金融学硕士，5 年以上固定收益投资研究经验。曾任鹏华资产管理公司债券研究员，2019 年加入野村东方国际证券，主要从事固定收益研究，具备扎实的公司经营分析和风险识别能力。现任野村东方国际证券资产管理部投资经理。
盛丽君	管理学硕士，10 年以上固定收益投资交易经历。曾任东吴证券债券投资部高级经理，宏信证券销售交易部总经理、资本市场部总经理。现任野村东方国际证券资产管理部固收业务负责人兼投资经理。					
方靖	金融学硕士，5 年以上固定收益投资研究经验。曾任鹏华资产管理公司债券研究员，2019 年加入野村东方国际证券，主要从事固定收益研究，具备扎实的公司经营分析和风险识别能力。现任野村东方国际证券资产管理部投资经理。					
1.8	投资顾问	无				
1.9	收益分配方式	本计划的默认分红方式为现金分红，投资者可以选择现金分红或者红利再投资分红方式				
1.10	收益分配频率	管理人决定资产管理计划收益分配的频率、方式、比例、金额、基准日与发放日；				
1.11	计划存续期限	本计划管理期限为自计划成立日起 10 年				
1.12	初始份额面值	人民币 1.00 元				

第 2 节 管理人与托管人情况

序号	项目	条款
2.1	管理人简况	名称：野村东方国际证券有限公司
		住所：上海市黄浦区淮海中路 381 号中环广场 10 楼
		通信地址：上海市黄浦区淮海中路 381 号中环广场 10 楼
		法人代表：北村充隆(KITAMURA MITSUTAKA)
		官方网站： https://www.nomuraoi-sec.com
		联系人：陈偲
		联系电话：021-66199083
2.2	托管人简况	名称：南京银行股份有限公司
		住所：南京市建邺区江山大街 88 号
		通信地址：南京市建邺区江山大街 88 号
		负责人：朱群力
		联系人：杨琿
		联系电话：025-83177279

第 3 节 认购事项

序号	项目	条款
3.1	募集机构	直销机构（管理人）和代销机构（管理人委托的符合法律法规及监管机构规定的销售机构）（如有）。管理人可根据情况变更或增减募集机构。具体募集机构名单、联系方式以管理人公告为准。
3.2	募集对象	本资产管理计划仅向符合《运作管理规定》规定的“合格投资者”募集。 “合格投资者”指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于本计划不低于人民币 30 万元（不含认购费或参与费）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织： 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； 2. 最近 1 年末净资产不低于 1,000 万元的法人单位； 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、在证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构； 4. 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； 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）； 6. 中国证监会视为合格投资者的其他情形。
		法律法规、监管机构、自律组织对于合格投资者认定将来另有规定的，从其规定。
3.3	募集期限	本计划初始募集期自本计划份额发售之日起不超过 60 天。开放募集具体时间由管理人届时在官方网站上披露。 管理人有权根据认购情况提前结束募集期。管理人决定提前终止募集，并在管理人网站及时公告，即视为履行完毕提前终止募集的程序。管理人发布公告提前结束募集的，本计划自公告之时起不再接受认购申请。
3.4	认购程序和确认	1. 募集机构受管理人委托，进行投资者适当性调查，及投资者人数的穿透核查，以确认合格投资者身份和人数； 2. 投资者在遵守本合同的前提下，在规定的时间和处理规则内进行认购申请，签署本合同，提交相应的文件，办理手续，在指定账户中备足用于认购的货币资金，届时以募集机构的具体规定为准； 3. 募集机构受理认购申请仅代表该募集机构收到了认购申请，并不表示对该申请的确认，申请是否有效以注册登记机构的确认为准。认购申请采取时间优先、金额优先原则进行确认。投资者于 T 日提交认购申请后，一般可于 T+2 日后在募集机构查询认购确认情况。投资者应当及时查询和确认认购申请的相关信息。 4. 确认无效的认购申请，募集机构将退还投资者已缴纳的款项。 5. 认购申请一经受理，不得撤销。
3.5	合规投资者人数上限	本计划仅向合格投资者募集，并按《运作管理规定》第三条的规定合并计算投资者人数，本计划的合格投资者人数不得超过 200 名。若法律法规将来另有规定的，从其规定。
3.6	认购价格	本计划认购采用金额申请的方式。认购价格为人民币 1.00 元/份额。
3.7	认购费用	本计划无认购费。
3.8	认购份额的计算	本计划采用金额认购的方式，认购份额的计算方法如下：

		$\text{认购份额} = \frac{\text{净认购金额} + \text{募集期利息}}{\text{认购价格}}$
		认购份额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入资产管理计划财产。
3.9	认购资金的管理及利息处理方式	管理人应当将资产管理计划募集期间投资者的认购资金存入资产管理计划募集结算专用账户，在资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用。投资者的认购参与款项（不含认购费用）加计其在募集期间形成的利息在资产管理合同生效后折算成相应的计划份额归投资者所有，其中利息折算份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。
3.10	最低认购金额	本计划最低认购金额为人民币 30 万元，追加认购的最低金额为人民币 30 万元。上述认购金额均为净认购金额，不包含认购费用。认购资金应以人民币货币资金形式交付。 本计划直销清算账户和募集机构委托募集账户（如有）等信息，具体以募集机构网站公示、相关业务办理说明或通知为准。
3.11	认购资金支付方式	认购资金应以人民币货币资金形式交付。

第 4 节 计划的成立与备案

序号	项目	条款
4.1	计划的成立条件	1. 募集金额达到本合同约定的初始募集规模，且不低于人民币 1,000 万元； 2. 投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人（符合条件的员工持股计划不穿透计算员工人数）； 3. 募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。
4.2	计划成立与备案	资产管理计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人公告资产管理计划成立，并书面通知资产托管人。管理人应在资产管理计划成立起 5 个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、资产缴付证明等材料报证券投资基金业协会备案。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。
4.3	计划未达到成立条件的处理	资产管理计划募集期届满，未达到成立条件的，管理人应当承担的责任： 1. 以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用； 2. 在募集期届满后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息，具体以注册登记机构记录为准。

第 5 节 参与、退出与转让

序号	项目	条款
5.1	参与和退出场所	本计划运作期间的销售机构：直销机构（管理人）和代销机构（管理人委托的销售机构）（如有）。管理人可根据情况变更或增减资产管理计划的销售机构。具体销售机构名单、联系方式以管理人公告为准。 投资者/份额持有人应当在销售机构办理资产管理计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理资产管理计划份额的参与和退出。
5.2	参与和退出开放日	本计划对每份认购/参与份额设置 6 个月滚动锁定期，该份额可在锁定期届满后的最近一个退出开放日申请退出，届时若该份额未申请退出，则自动进入下一个锁定期。第一个锁定期到期日指计划成立日/份额参与申请日满 6 个月后的对日，第二个锁定期到期日指计划成立日/份额参与申请日满 12 个月后的对日，如果投资者多次参与本计划份额，则其持有的计划份额对应的退出开放时间可能不同。 1. 参与开放日： 本计划成立后每个自然月的 7 日和 21 日（如遇非工作日，顺延到下一个工作日）为份额参与开放日，投资者/份额持有人可在参与开放日办理资产管理计划份额的参与业务。具体开放安排以管理人公告为准。 2. 退出开放日： 本计划成立后每周第一个工作日为份额退出开放日。管理人仅接受处于锁定期届满的份额的退出申请，仍处于锁定期部分的份额，管理人将拒绝该部分的份额退出申请。 本计划遵循“先进先出”原则，按照投资者持有本计划份额登记日期的先后次序进行顺序份额确认。 若中国证监会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，管理人将视情况对上述开放日进行相应的调整并告知投资者。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。
5.3	临时开放日	在法律法规、监管规定及自律规则发生修订，或者存在其他监管机构允许情形时，管理人有权设置临时退出开放日，临时退出开放日内份额持有人仅可办理退出业务，不得办理参与业务。 临时开放日的具体安排以管理人公告为准。
5.4	参与的出资方式	本计划的参与出资方式以人民币货币资金形式交付。
5.5	参与和退出的方式、价格及程序	1. 投资者于存续期首次参与本计划的，应在参与申请前与管理人、托管人签署本合同； 2. 投资者参与本计划份额，应在参与开放日 15:00 点前提交参与申请，在直销机构参与的投资者还应在开放日 15:00 点前将参与资金从在中国境内开立的自有银行账户划转至直销机构指定账户，在代销机构处参与的投资者按该销售机构的规定缴付资金。份额持有人退出本计

划份额，应在退出开放日 15:00 点前提交退出申请；

3. 本计划以参与开放日收盘后的份额净值作为计划份额参与的价格，退出开放日收盘后的份额净值作为计划份额退出的价格；
4. 投资者参与资产管理计划份额时，遵循“时间优先、金额优先”原则，若接受全部投资者的参与申请，将使本计划的份额持有人人数超过 200 人，则在份额持有人人数不超过 200 人的范围内，提交参与申请在先的优先予以确认，同时提交参与申请的，则参与金额大的优先予以确认；
5. 投资者在提交参与申请时须按照销售机构规定的方式全额支付参与资金，在提交退出申请时须持有足够的资产管理计划份额余额，否则所提交的参与、退出申请无效而不予确认；
6. 参与申请可以在参与申请提出之日 15:00 点前撤销，在参与申请提出之日 15:00 点后不得撤销；退出申请可以在退出申请提出之日 15:00 点前撤销，在退出申请提出之日 15:00 点后不得撤销。

销售机构受理参与或退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了参与或退出申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对投资者（份额持有人）参与、退出申请的有效性进行确认。

5.6 参与和退出申请的确认

1. 管理人在 T+1 日内对 T 日（此处的 T 日指参与开放日）参与申请的有效性进行确认，投资者可在 T+2 日于销售机构处查询其申请是否成功。若参与申请不成功，管理人应在 T+1 日（不含）起 5 个工作日内返还投资者已缴纳的款项（不含期间利息）；
2. 管理人在 T+1 日内对 T 日（此处的 T 日指退出开放日）退出申请的有效性进行确认，若份额持有人退出申请确认成功，管理人应在 T+2 个工作日内将退出款项从托管账户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各销售机构，由销售机构向份额持有人支付。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定办理；
3. 管理人在不损害投资者/份额持有人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 10 个工作日告知投资者/份额持有人。管理人网站发布公告即视为履行了告知义务。

5.7 参与和退出的金额限制

在资产管理计划存续期参与开放日，投资者首次参与金额应不低于人民币 30 万元（不含参与费用。具体首次参与最低金额以投资者参与时管理人最新公告的金额为准）且符合合格投资者标准，对于份额持有人在资产管理计划存续期参与开放日追加参与的，追加参与金额不低于人民币 30 万元（不含参与费用）。

管理人可自行调整（包括调高或调低）投资者首次参与金额，但不应低于人民币 30 万元，具体以管理人发布的公告为准。管理人发布公告即以发布公告的方式向投资人履行了告知义务。投资者签署本合同，认购/参与本资产管理计划份额，即视为已经充分理解并同意该事项。

		份额持有人持有的本计划份额对应的资产净值高于人民币 30 万元时，可以选择全部或部分退出；份额持有人在部分退出后持有的本计划份额对应的资产净值低于人民币 30 万元（不含）的，管理人将该份额持有人所持份额（包括仍在锁定期的份额）一次性做全部退出处理。
5.8	参与和退出的费用	本计划不收取参与、退出费。
5.9	参与份额的计算	参与份额的计算公式如下： $\text{参与份额} = \text{参与金额} / \text{参与价格}$ 参与价格为参与开放日本计划的份额净值。参与份额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入资产管理计划财产。
5.10	退出金额的计算	退出金额的计算公式如下： $\text{退出金额} = (\text{退出份额} \times \text{退出价格}) - \text{业绩报酬}$ 退出价格为退出开放日/临时开放日本计划的份额净值。退出金额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入资产管理计划财产。
5.11	巨额退出的认定	单个退出开放日内，本计划净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之余额）超过上一日计划份额总份数的 20%，即认为是发生了巨额退出。
5.12	巨额退出处理方式	当本计划出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分延期退出、延期支付。 1. 全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序执行； 2. 部分延期退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者的退出申请可能对本计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出计划份额不低于上一日计划总份额的 20%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未受理部分，份额持有人在提交退出申请时可以选择延期退出或取消退出。选择延期退出的，将自动转入下一个开放日（含临时开放日）继续退出，直到全部退出为止；选择取消退出的，当日未获受理的部分退出申请将被全部撤销。延期的退出申请与下一开放日（含临时开放日）退出申请（如有）一并处理，无优先权并以下一个开放日（含临时开放日）的资产管理计划财产份额净值为基础计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。本计划不就延期退出份额的相应款项计算利息。如份额持有人在提交退出申请时未作明确选择，份额持有人未能退出部分作自动延期退出处理； 3. 延期支付：当管理人认为支付份额持有人的退出申请有困难或认为因支付份额持有人的退出申请而进行的财产变现可能会对资产管理计划净值造成较大损害时，管理人可以选择接受全部的退出申请，同时延缓支付退出款项，延缓支付的期限为开放日后 10 个工作日（含）

		内，如需额外延缓支付退出款，管理人可与份额持有人另行约定，并应以书面或其他形式通知提交退出申请的份额持有人。
5.13	部分延期退出与延迟支付的通知	当发生上述部分延期退出或延期支付时，管理人应在 3 个工作日内在管理人网站公告，并说明有关处理方法。
5.14	连续巨额退出	1. 连续巨额退出的认定 如果本计划连续 2 个开放日发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。 2. 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付 本计划发生连续巨额退出，管理人可按本合同规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在管理人网站上进行公告。
5.15	拒绝投资者的参与申请的情形	1. 如接受该笔申请，将导致本份额持有人人数超过 200 人； 2. 当投资者不符合合格投资者的规定，违反反洗钱、制裁及打击恐怖融资、反贪污贿赂及其他金融犯罪等相关法律法规，未向资产管理计划销售机构或管理人提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，未配合资产管理计划销售机构或管理人进行的尽职调查与反洗钱工作或管理人审核后认为其不合格的其他情形； 3. 当接受参与申请对现有份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，管理人应当采取设定单一投资者参与金额上限或单日净参与比例上限、拒绝大额参与措施，切实保护现有份额持有人的合法权益。管理人基于投资运作与风险控制的需要，可以采取上述措施对资管计划规模予以控制。 4. 根据市场情况，管理人无法找到合适的投资标的，或其他可能对资产管理计划业绩产生负面影响，从而损害现有份额持有人的利益的情形； 5. 法律法规规定或中国证监会规定的及本合同约定的其他情形。
5.16	暂停投资者的参与申请的情形	1. 管理人认为会有损于现有份额持有人利益； 2. 管理人基于投资运作与风险控制的需要，对资管计划规模予以控制； 3. 发生本合同规定的暂停资产管理计划财产估值的情形； 4. 因不可抗力导致管理人无法受理与处理投资者的参与申请的情形； 5. 法律法规规定或中国证监会规定的及本合同约定的其他情形。 管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知投资者。在暂停参与的情形消除时，管理人应及时恢复参与业务的办理并告知投资者。投资者参与申请被拒绝的，相关参与款项将无息退还给投资者。
5.17	暂停份额持有人的退出申请的情形	1. 交易场所非正常停市； 2. 非管理人原因导致的计划无法正常运转；

		3. 因不可抗力导致管理人无法支付退出金额情形; 4. 出现连续巨额退出, 或者其他原因, 导致本计划现金支付困难时; 5. 发生本合同规定的暂停资产管理计划财产估值的情形; 6. 法律法规规定或中国证监会规定的及本合同约定的其他情形。 发生上述情形之一且管理人决定暂停退出的, 管理人应当及时通知(在管理人网站进行信息披露)投资者。已接受的退出申请, 管理人应当足额支付退出金额; 如暂时不能足额支付, 应当按单个申请退出的份额持有人经确认的退出金额占所有申请退出的份额持有人经确认的退出总金额的比例将可支付金额公平地分配给申请退出的份额持有人, 其余部分将延迟至本计划通过变现资产足以支付未付清部分时支付。 在暂停退出的情况消除时, 管理人应及时恢复退出业务的办理并及时通知(在管理人网站进行信息披露)投资者。
5.18	未在锁定期到期日后的最近一个退出开放日提出退出申请的处理	未在锁定期届满后的最近一个退出开放日提出退出申请的份额, 将自动进入下一个锁定期, 下一个锁定期期间内投资者提出退出申请的, 管理人将不予以确认。
5.19	计划份额转让	在不违反法律法规及监管部门的相关规定的前提下, 份额持有人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资产管理计划份额, 份额转让应遵守交易场所相关规定及要求, 并按规定办理份额变更登记手续。转让期间及转让后, 本计划投资者人数合计不得超过 200 人。
5.20	计划份额的非交易过户	非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式, 将一定数量的资产管理计划份额按照一定的规则从某一份额持有人账户转移到另一份额持有人账户的行为。非交易过户包括继承、捐赠、司法强制执行以及其他符合规定的情况, 对于符合条件的非交易过户的申请按登记结算机构的有关规定办理, 非交易过户期间及过户后, 本计划投资者人数合计不得超过 200 人。
5.21	管理人自有资金的认购/参与和退出	1. 管理人自有资金的认购/参与方式和比例和退出的条件: 1) 管理人可以自有资金认购/参与本计划。 2) 为满足管理人内部统一管理要求, 对本资产管理计划自有资金参与比例进行目标动态管理, 管理目标为自有资金参与比例不超过产品规模的 8%。 3) 管理人自有资金参与本计划份额的持有期限不少于 6 个月, 在符合法律、行政法规等关于自有资金退出规定和本合同约定的情况下, 可以与其他投资者同样办理退出业务。 4) 因本计划在开放日因投资者赎回份额造成本计划规模变动等客观因素导致前述 2) 中比例被动超标的, 自有资金将同步退出, 以满足上述自有资金参与比例管理标准。事后, 管理人向投资者披露自有资金退出的份额、金额, 以及退出后自有资金占比。

投资者和托管人签署本合同,并且投资者认购/参与本资产管理计划份额,即视为投资者和托管人已经充分理解并同意上述安排。

- 5) 除上述 4) 情形之外,管理人自有资金参与、退出本计划的,为保护投资者权益,管理人应当提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人,并取得其同意,具体方式为:

由管理人和托管人事先书面达成一致后,于管理人网站向投资者信息披露,并且管理人须在信息披露后 5 个工作日内以书面或者通过管理人网站(由管理人决定)向本计划投资者发送或者刊登征询意见函,投资者应在征询意见函指定的日期内按指定的形式回复书面意见,管理人采取如下权利保障措施及安排:

- i. 投资者不同意的,管理人保障其退出权利,投资者应在征询意见函发出后的 5 个工作日内或最近一个开放日按照管理人届时具体安排提出退出本计划的申请;
 - ii. 投资者不同意且逾期未申请退出的,则管理人有权在征询意见函中说明的意见回复期届满后将其持有的全部资产管理计划份额强制退出本计划(退出价格为强制退出当日资产管理计划财产份额净值),由此发生的相关税费、或有损失由该投资者自行承担;
 - iii. 投资者在征询意见函规定期限内未回复意见且逾期未退出的,视同该投资者同意,管理人不再另行通知;
 - iv. 投资者回复意见不明确的,则视为该投资者不同意,按照以上 i、ii 投资者不同意的方式处理。
2. 为应对集合资产管理计划巨额退出以解决流动性风险,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,管理人以其自有资金参与及后续的退出可以不受上述第 1 条第 3) 款、第 5) 款的约定的限制。出现上述情形时,管理人应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。

第 6 节 计划的投资

序号	项目	条款
6.1	投资目标	通过主要投资于中国境内市场固定收益类证券,寻求低波动中的投资机会,力争在可控风险的范围内,提升本计划财产的收益回报。
6.2	业绩比较基准	本计划不设业绩比较基准。
6.3	投资方法	- 根据管理人内部综合风险评价模型评估、识别本合同约定的投资范围内可投资资产的风险,设立拟投资标的备选库; - 采用“自上而下”的分析方法,预判投资范围内拟投资标的类别的市场收益率情况,设置绝对收益的目标;

6.4	投资范围	3. 在本合同的限制条件下平衡风险与预期收益,通过资产优化模型制定战略资产配置比例,据此设定资产配置。 1. 固定收益类资产:国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、短期融资券(含超短期融资券)、次级债、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券(含非公开发行的可转换债券)、可交换债券(含非公开发行的可交换债券)、债券逆回购、资产支持证券优先级、资产支持票据优先级、银行存款、现金、同业存单; 2. 权益类资产:可转换债券转股或可交换债券换股形成的股票及其派发的权证,不从二级市场买入股票与权证; 3. 公开募集证券投资基金:货币型基金、债券型基金、债券型的基金中的基金(FOFs); 4. 债券正回购。
6.5	特别揭示	本计划将参与证券回购。
6.6	投资比例	1. 本计划投资于固定收益类资产占计划总资产比例不低于 80% (含); 2. 本计划投资于权益类资产占计划总资产比例低于 20% (不含)。 本计划投资于其他资产管理产品的,本计划按照穿透原则合并计算投资同类资产的金额,并符合《管理办法》及中国证监会相关规定。本计划应按照所投资其他资产管理产品披露投资组合的频率,及时更新计算本计划所投资资产的金额或比例。
6.7	投资比例超限处理	本计划因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素致使资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的,管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易起的 20 个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的,管理人应及时向中国证监会派出机构报告。
6.8	投资限制	本资产管理计划财产严格按照《管理办法》、自律规则、其他有关规定,及本合同约定的投资范围进行投资,其中: 1. 本计划债券正回购资金余额不超过上一日本计划资产净值的 100%。逆回购资金余额不超过上一日本计划资产净值的 100%。本计划总资产不得超过净资产的 200%; 2. 本计划投资于同一资产的资金,不得超过本计划资产净值的 25%,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%,银行活期存款、国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债等中国证监会认可的投资品种除外; 3. 本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本计划资产净值 50%的,本计划总资产不得超过本计划资产净值的 120%,国

债、央行票据、政策性金融债、地方政府债等中国证监会认可的投资品种除外；

4. 本计划参与债券、可转换公司债、可交换公司债券等发行申购时，本计划所申报的金额不得超过本计划总资产，本计划所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；
5. 本计划投资于企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、中期票据、次级债、非公开定向债务融资工具、可转换债券(含定向可转换债券)的债项或发行人主体或担保人主体信用评级不低于 AA；短期融资券(含超短期融资券)发行人主体评级不低于 AA；资产支持证券/资产支持票据的债项评级不低于 AA；投资于可交换债券(含非公开发行可交换债)主体或债项不低于 AA-或初始担保比例不低于 100%。中债资信不纳入参考；
6. 本计划开放退出期内，本计划资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值不低于本计划资产净值的 10%。其中，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；
7. 本计划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计划资产净值的 20%。流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、资产支持证券(票据)、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产；
8. 本计划不可投资于管理人及其关联方发行或承销期内承销的证券；
9. 法律法规及监管部门规定的其它投资限制。

6.9 投资策略

1. 债权类资产投资策略
 - a) 平均久期配置：通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析，预测未来的利率趋势，判断债券市场对上述变量和政策的反应，并据此对债券组合的平均久期进行调整，提高债券组合的总投资收益。
 - b) 期限结构配置：对债券市场收益率期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，预测收益率期限结构的变化方式，选择确定期限结构配置策略，配置各期限债权类品种的比例，以达到预期投资收益最大化的目的。
 - c) 类属配置：对不同类型债权类品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的

的投资收益。

- d) 利率品种的投资策略：对国债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后，对债券的期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。
- e) 信用品种的投资策略与信用风险管理：对金融债、企业债、公司债和短期融资券等信用品种采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化分析方法对信用产品的信用风险溢价、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对利差走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指运用行业研究方法和公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。
- f) 回购策略：资产管理计划在基础组合的基础上，使用基础组合持有的债券进行回购融入短期资金滚动操作，投资于收益率高于融资成本的其它获利机会。
- g) 可转/交债投资策略：精选个券，结合转债对应的股票资质、价格以及转债自身条款、价格，选择性价比较高的转债配置和交易；转债、股票以及债券之间的复制套利，当三类资产出现估值不平价时，可以通过套利获利；转债发行、条款触发时点，转债与股票之间的波动性具备一定规律，或可以利用规律获利。

2. 现金管理策略

在确定总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性和预期收益水平、银行存款的期限、债券逆回购的预期收益率来确定现金类资产的配置，并定期对现金类资产组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。

6.10 投资禁止行为

- 1. 承销证券；
- 2. 直接投资于商业银行信贷资产；
- 3. 违反规定向他人贷款或提供担保；
- 4. 违规为地方政府及其部门提供融资，要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；
- 5. 直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外）；
- 6. 从事承担无限责任的投资；
- 7. 利用资产管理计划财产为资产管理计划持有人之外的任何第三方谋

取不正当利益、进行利益输送；

8. 利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人及其控股股东、实际控制人或其他关联方提供融资；
9. 为管理人或他人违规持有金融机构股权提供便利；
10. 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；
11. 不得开展明股实债投资；
12. 不得通过投资其他资产管理产品变相扩大投资范围或者规避监管要求；
13. 法律法规以及本合同规定禁止从事的其他行为。

6.11 建仓期

本计划的建仓期为自计划成立之日起不超过 6 个月。建仓期的投资活动，应当符合本计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种除外。建仓期结束后，管理人应当使本计划的投资组合的投向和比例符合以上约定。

第 7 节 计划的费用

序号	项目	条款
7.1	资产管理业务费用的种类	本资产管理计划运营涉及费用包括： 1. 管理人收取的固定管理费； 2. 托管人收取的托管费； 3. 管理人依据本合同收取的业绩报酬； 4. 资产管理计划相关账户的开立及维护费用； 5. 投资证券、证券投资基金等产生的交易费用； 6. 资产管理计划投资产生的增值税及附加税； 7. 资产管理计划成立后与资产管理计划有关的会计师费、审计费、律师费、仲裁费、诉讼费、保全费； 8. 资产管理计划成立后的资产管理计划信息披露费用； 9. 资产管理计划财产的银行汇划费用； 10. 按照法律法规及本合同的约定可以在资产管理计划财产中列支的其他费用。
7.2	管理费	管理费指支付给管理人的报酬，分为以资产管理计划财产净值作为计算基数按日以约定的管理费率提取的固定管理费，与以资产管理计划财产增值额作为计算基数的浮动管理费。为避免歧义，以下所述管理费特指固定管

		理费，浮动管理费称为业绩报酬。 固定管理费：费率为 0.7%/年，按每年 365 日，每日计提，按季支付。计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的固定管理费。 固定管理费计算公式： $H=E \times 0.7\% \div 365$ H 为每日应计提的固定管理费 E 为前一日的资产管理计划财产净值 固定管理费首日计提时，以本资产管理计划成立时的资产管理计划规模为计提基准。
7.3	托管费	托管费指支付给托管人的报酬。就托管人为资产管理计划所提供的托管服务，在其提供服务的期限内支付基于资产管理计划财产净值的托管费。本资产管理计划的托管费，费率为 0.02%/年，按每年 365 日，每日计提，逐日累计至每季季末，按季支付。计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的托管费。 托管费计算公式： $H=E \times 0.02\% \div 365$ H 为每日应计提的托管费 E 为前一日的资产管理计划财产净值 托管费首日计提时，以本资产管理计划成立时的资产管理计划规模为计提基准。
7.4	业绩报酬	以资产管理计划财产增值额作为计算基数的浮动管理费，按以下规定计提。
7.5	业绩报酬提取原则	本计划的管理人有权决定就投资者每笔认购/参与的资产管理计划份额，就超过业绩报酬计提基准部分按约定比例收取业绩报酬。业绩报酬计提基准日分别为退出申请日、收益分配登记日和计划终止日。业绩报酬提取时点为退出确认日、收益分配确认日、计划终止确认日。 资产管理计划业绩报酬计提按资产管理计划份额“先进先出”的原则计算，即按照资产管理计划份额认购/参与的先后次序进行顺序退出的方式确定该笔投资的认购/参与和退出的份额与对应的金额，且仅在资产管理计划财产分配金额中扣除，当分配金额低于应提取的业绩报酬时，业绩报酬以分配金额为限。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。
7.6	业绩报酬提取的频率	业绩报酬提取频率不超过每 6 个月一次。因投资者退出资产管理计划份额，或资产管理计划财产清算时，管理人按本合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。
7.7	业绩报酬计算期间	对于本计划投资者每笔认购/参与的份额而言，业绩报酬计算期间始于上一个成功计提的业绩报酬计提基准日次日，止于业绩报酬计提基准日。若

上一个成功计提的业绩报酬计提基准日不存在，则：

1. 若该笔资产管理计划份额通过认购进入本计划，则以资产管理计划成立日为该笔份额的上一个成功计提的业绩报酬计提基准日；
2. 若该笔资产管理计划份额通过参与进入本计划，则以该笔资产管理计划份额参与本计划的开放日为该笔份额的一个成功计提的业绩报酬计提基准日。

7.8 业绩报酬计提基准与计提比例

1. 本计划的业绩报酬计提基准为 3.3%（年化）；
2. 本计划业绩报酬计提比例为资产管理计划份额的期间收益超过同期业绩报酬计提基准部分的 60%。

7.9 业绩报酬计算方法

管理人就每笔业绩报酬计算期间对资产管理计划份额收益进行收益率的测算，若该笔份额取得的经单利年化后的收益率超过业绩报酬计提基准，则超出的部分经折算回业绩报酬计算期间的期间收益率，基于资产管理计划份额在上一个成功计提的业绩报酬计提基准日的净值按照业绩报酬计提比例计算出该笔资产管理计划份额应计提的业绩报酬。

1. 期间收益率的计算公式：

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

R 为业绩报酬计算期间资产管理计划份额经年化后的收益率；

P_1^* 为业绩报酬计提基准日资产管理计划份额的单位累计净值；

P_0^* 为上一成功计提的业绩报酬计提基准日资产管理计划份额的单位累计净值；

P_0 为上一成功计提的业绩报酬计提基准日资产管理计划份额的单位净值；

D 为业绩报酬计算期间的天数除以 365 天。

2. 业绩报酬计提公式如下：

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (I)
$R \leq 3.3\%$	0	0
$R > 3.3\%$	60%	$I = [(R - 3.3\%) \times 60\%] \times A \times S \times D$

其中：

R 为业绩报酬计算期间该笔份额经年化后的收益率；

		I 为对于该笔份额，管理人应计提的业绩报酬； A 为上一个业绩报酬计提基准日本计划单位净值； S 为业绩报酬计算期间该笔份额对应的份额数量； D 为业绩报酬计算期间的天数除以 365 天；
	业绩报酬提取程序	业绩报酬由管理人计算，托管人不承担复核义务，对于符合业绩报酬提取原则的部分，管理人于业绩报酬计算期之后的 5 个工作日内向托管人发送业绩报酬支付指令，托管人依据指令从资产管理计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。
7.10	计划的税收	1. 为避免歧义，本合同项下的价款和价外费用均包含增值税及附加税费，但当事人另有约定的除外。 2. 本计划运作涉及的相关税收由投资者承担。根据现行的中国税收征收规定，资产管理计划投资运营过程中发生的增值税应税行为，以资产管理计划管理人作为增值税纳税主体缴纳。本合同各方特别约定，管理人将根据现行有效的税收法规及解释履行对本计划纳税义务的代扣代缴。履行此类纳税责任或义务将导致资产管理计划财产净值降低。若相关税务法律、法规或实施细则发生变化，则经修订的税务法律、法规和实施细则相应适用。 3. 本计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按中国税收法律法规执行。投资者应根据相关法律法规自行缴纳或为其最终投资者代扣代缴税费。 4. 尽管已有前款规定，本计划、管理人保留根据现行或未来中国税收法律法规及解释的规定为投资者代扣代缴任何税收(如适用)的权利(包括这些税收法律法规及解释可能溯及既往的情况)。若本计划、管理人有义务根据现行或未来中国税收法律法规及解释的规定为投资者代扣代缴任何税费，投资者应当对全部各类税费或税务负责，包括就其投资于本计划相关义务施加的任何罚款或罚金，并且应当赔偿管理人就此遭受的任何损失和费用。本计划、管理人保留自投资者的账户中扣除相当于前述纳税义务和税费(包括管理人遭受的罚款或罚金以及损失或费用)款项的权利。如投资者的账户不足以支付此类款项，则不足部分由投资者偿还遭受损失的一方。 5. 本计划应承担的相关税收由托管人根据管理人指令自托管账户划付至管理人账户并由管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。

第 8 节 信息披露

序号	项目	条款
8.1	净值报告	本计划存续期内管理人于每周前三个工作日内在管理人网站上公布上周

最后一个工作日份额净值。

8.2 季度报告

管理人每季度向投资者提供资产管理计划季度报告,对报告期内资产管理计划财产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易等做出说明。资产管理计划季度报告由管理人编制,托管人在收到季度报告后 7 个工作日内完成复核,并将复核结果书面通知管理人。托管人复核内容为季度报告中的财务数据(托管人无复核义务的数据除外)。上述报告由管理人于每季度截止日后一个月内向投资者披露。

季度报告的内容,包括但不限于下列信息:

1. 管理人履职报告;
2. 托管人履职报告;
3. 资产管理计划投资表现;
4. 资产管理计划投资组合报告;
5. 资产管理计划运用杠杆情况(如有);
6. 资产管理计划支付的管理费(包括固定管理费和业绩报酬)、托管费等费用,包括计提基准、计提方式和支付方式;
7. 资产管理计划投资收益分配情况;
8. 投资经理变更、关联交易等涉及投资者权益的重大事项;
9. 中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的,管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告。

8.3 年度报告

管理人每年度向投资者提供一次准确、完整的资产管理计划年度报告,对报告期内资产管理计划财产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易等做出说明。资产管理计划年度报告由管理人编制,托管人在收到年度报告后 1 个月内完成复核,并将复核结果书面通知管理人。托管人复核内容为年度报告中的财务数据(本合同约定的托管人无复核义务的数据除外)。上述报告由管理人于每年度截止日后四个月内向投资者披露。

年度报告的内容,包括但不限于下列信息:

1. 管理人履职报告;
2. 托管人履职报告;
3. 资产管理计划投资表现;
4. 资产管理计划投资组合报告;
5. 资产管理计划运用杠杆情况(如有);
6. 资产管理计划财务会计报告;
7. 资产管理计划支付的管理费(包括固定管理费和业绩报酬)、托管费等费用,包括计提基准、计提方式和支付方式;

		8. 资产管理计划投资收益分配情况； 9. 投资经理变更、关联交易等涉及投资者权益的重大事项； 10. 中国证监会规定的其他事项。 资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制资产管理计划当期的年度报告。 资产管理计划年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格的会计师事务所审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。 为避免歧义，管理人向投资者提供的上述报告，不包括反映本计划交易过程的交易明细及交易凭证等信息。
8.4	临时报告	资产管理计划存续期间，发生对本计划持续运营、投资者利益、资产管理计划财产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起五日内向投资者披露； 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。
8.5	报告提供方式	采用下列一种或多种方式向投资者提供报告 1. 电子邮件：如投资者留有电子邮件的联系方式，管理人可通过电子邮件发送相关披露信息； 2. 管理人网站：管理人可通过管理人网站（https://www.nomuraoi-sec.com/）向投资者提供报告和信息查询，内容包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告、本计划运作的重要通知； 3. 管理人指定的其他信息披露途径或方式：管理人可通过管理人指定的其他信息披露途径或方式向投资者提供报告和信息查询，内容包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告、本计划运作的重要通知等； 4. 其他中国证监会以及证券投资基金业协会规定的信息披露途径或方式。

第 9 节 合同变更、终止与清算

序号	项目	条款
9.1	合同变更的条件	1. 因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券投资基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订，或相关监管机构或自律组织对本集合计划备案补正意见的要求涉及到合同修改； 2. 因以下事由，投资者和托管人签署本合同，且投资者认购/参与本计划，即视为资产管理计划投资者和托管人同意，由管理人全权处理本

计划合同的变更事宜：

- 1) 对本资产管理计划认购、参与、退出、资产管理计划份额转让和非交易过户业务规则进行调整；
- 2) 调低管理人的固定管理费费率，调低业绩报酬提取比例；
- 3) 按照法律法规或本合同规定，管理人有权变更本合同的其他情形。

3. 对投资者利益无实质性不利影响或修改不涉及本资产管理计划投资者权利义务关系的合同修改；

4. 除上述第 1 至 3 款的规定外，因其他原因需要变更本合同的，经全体投资者、管理人和托管人协商一致后，可对资产管理合同内容进行变更，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。

9.2 合同变更程序

1. 因上述合同变更的条件 1 的原因变更本合同的，经管理人与托管人协商一致后，可以对本计划合同与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，或根据相关监管机构或自律组织备案补正意见的要求对本合同进行修改，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。变更后的资产管理合同由管理人于管理人网站披露，披露时长不低于 2 个工作日，合同变更于管理人指定的合同变更生效日生效，合同变更生效日不得早于披露届满日；

2. 因上述合同变更的条件 2 的原因变更合同的，管理人通过管理人网站披露变更事项并以书面形式通知托管人，披露时长不低于 2 个工作日，合同变更于管理人指定的合同变更生效日生效，合同变更生效日不得早于披露届满日；

3. 因上述合同变更的条件 3 变更本合同的，由管理人和托管人书面协商一致后处理本资产管理计划合同的变更事宜，但管理人有权自行决定变更的事项除外。管理人通过管理人网站披露变更事项，披露时长不低于 2 个工作日，合同变更于管理人指定的合同变更生效日生效，合同变更生效日不得早于披露届满日；

4. 因前款合同变更的条件 4 的原因变更合同的，为保护投资者权益，由管理人和托管人事先书面达成一致后，于管理人网站向投资者信息披露，并且管理人须在信息披露后 5 个工作日内以书面或者通过管理人网站（由管理人决定）向本计划投资者发送或者刊登合同变更征询意见函，投资者应在合同变更征询意见函指定的日期内按指定的形式回复书面意见，管理人采取如下权利保障措施及安排：

1) 投资者不同意变更的，管理人保障其退出权利，投资者应在征询意见函发出后的 5 个工作日内或最近一个开放日按照管理人届时具体安排提出退出本计划的申请；

2) 投资者不同意变更且逾期未申请退出的，则管理人有权在征询意见函中说明的意见回复期届满后将其持有的全部资产管理计

		划份额强制退出本计划（退出价格为强制退出当日资产管理计划财产份额净值），由此发生的相关税费、或有损失由该投资者自行承担； 3) 投资者在征询意见函规定期限内未回复意见且逾期未退出的，视同该投资者同意本合同此次变更，管理人不再另行通知； 4) 投资者回复意见不明确的，则视为该投资者不同意合同变更，按照以上 1)、2) 投资者不同意变更的方式处理。 合同变更征询意见函规定的回复期届满，管理人已履行完成对投资者的权利保障措施与安排，且管理人宣布此次合同变更生效之日起生效。管理人于本次合同变更生效日当日以发送合同变更生效公告扫描件的方式通知托管人。
9.3	管理人和托管人的更换程序	当发生“（1）管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他管理人承接；（2）托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他托管人承接”情形时，管理人和托管人的更换程序如下： 1. 管理人的更换程序 1) 经全体投资者协商一致，可选择符合条件的其他管理人承接本计划项下管理人相关权利义务。 2) 原管理人应做出处理资产管理计划事务的报告，并向新任管理人办理资产管理计划事务的移交手续；新任管理人应与托管人核对资产管理计划财产资产总值和资产净值。 3) 管理人更换后，应按其要求替换或删除资产管理计划名称中原管理人名称的字样，并对合同进行变更。 2. 托管人的更换程序 1) 经全体投资者及管理人协商一致，可选择符合条件的其他托管人承接本计划项下托管人相关权利义务。 2) 原托管人应做出处理资产管理计划事务的报告，并与新任托管人进行资产管理计划资产托管事务的移交手续；新任托管人应与管理人核对资产管理计划财产总值和净值。 3) 合同变更后，投资者、管理人和新任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。
9.4	计划的展期	1. 展期的条件 1) 资产管理计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和资产管理合同的约定； 2) 资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形； 3) 展期符合资产管理计划的成立条件； 4) 中国证监会规定的其他条件。

		2. 展期的方式 在法律、法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会允许的范围内以及不损害拒绝参与计划展期的投资者利益的前提下，管理人可以按合同变更的方式就展期事宜向投资者征询意见。为保护投资者权益，管理人应当为拒绝参与本计划展期的投资者提供妥善、合理的权利保障措施及安排。 3. 展期的程序 按照合同变更程序的规定办理。
9.5	计划终止的情形	下列任意情形出现，本计划终止： 1. 资产管理计划存续期届满且不展期； 2. 经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的； 3. 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解算、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接； 4. 托管人被依法撤销基金托管资格或依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接； 5. 全部份额持有人提出退出全部份额的申请，或持续五个工作日投资者少于 2 人（不含）的； 6. 本资产管理计划资产净值低于人民币一千万元，且管理人决定终止本资产管理计划（为免歧义，本资产管理计划资产净值低于人民币一千万元的情况下，本资产管理计划并不必然终止，届时管理人可酌情决定是否终止本资产管理计划）； 7. 未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形； 8. 法律、行政法规、中国证监会规定及资产管理合同约定的其他情形。
9.6	计划财产清算	本计划在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划财产清算的有关事项。
9.7	清算小组	1. 本计划财产清算小组成员由管理人、托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员； 2. 本计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。
9.8	清算程序	1. 本计划终止情形发生后，由清算小组统一接管资产管理计划财产； 2. 根据资产管理计划财产的情况确定清算期限； 3. 对资产管理计划财产进行清理和确认； 4. 对资产管理计划财产进行估价和变现； 5. 管理人制作除末次清算外各次清算的清算方案（若进行二次或多次清算的）、末次清算报告并经托管人复核其中财务数据（本合同约定的托管人无复核义务的数据除外）；

		6. 若进行二次或多次清算的，对除末次清算外的清算分配，根据各次清算方案将已变现资产进行分配； 7. 管理人将除末次清算外各次清算的清算方案（若进行二次或多次清算的）、末次清算报告报相关监管机构并公告； 8. 对资产管理计划剩余财产进行分配。 本计划终止后，资产管理计划财产中仍持有可流通非现金资产的，在 5 个交易日内（含计划终止日当日）由管理人进行强制变现处理；资产管理计划财产中持有的流通受限证券，如未到期回购、未上市新股等，自限制条件解除日起（含解除当日）3 个交易日内完成变现。未变现资产于清算期间损益由全体投资者享有或承担。
9.9	清算费用	清算费用是指清算小组进行资产管理计划财产清算过程中发生的合理费用，清算费用优先从资产管理计划财产中支付。清算费用包括但不限于： 1. 聘请律师以及其他工作人员等所发生的报酬（若有）； 2. 资产管理计划资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用； 3. 信息披露所发生的费用； 4. 仲裁、保全等维护资产管理计划财产利益所发生的费用； 5. 其他与清算事项有关的费用。 清算期间，本计划仍需收取固定管理费、托管费。 除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外，所有清算费用由管理人向托管人出具指令，由托管人根据管理人符合本合同约定的指令办理支付。
9.10	清算剩余财产清偿顺序	资产管理计划财产清算剩余财产按下列顺序依次清偿： 1. 支付清算费用； 2. 交纳所欠税款； 3. 清偿计划债务（包括但不限于固定管理费、托管费、业绩报酬（如有）等）； 4. 按投资者持有的计划份额比例进行分配。 清算剩余财产未按本款 1 至 3 项约定清偿前，不分配给投资者。
9.11	账册保管	资产管理计划财产清算账册及文件由管理人自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年。

第 10 节 投资者的权利与义务

序号	项目	条款
10.1	投资者的权利	1. 分享资产管理计划财产收益； 2. 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产； 3. 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额； 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； 5. 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况； 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。
10.2	投资者的义务	1. 认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法； 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受能力问卷，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； 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，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源； 4. 认真阅读并签署风险揭示书； 5. 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（包括固定管理费和业绩报酬）、托管费、审计费、税费等合理费用； 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； 7. 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资料及身份证明文件，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； 8. 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为； 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及托管人托管的其他资产合法权益的活动； 10. 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动； 11. 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。

第 11 节 利益冲突事项

本计划关联方范围：

- (1) 管理人、托管人及其控股股东、实际控制人、子公司；及，
- (2) 管理人控股股东或实际控制人控制的其他企业；及，
- (3) 托管人控股股东或实际控制人控制的其他企业；及，
- (4) 根据企业会计准则及各类监管规定认定的其他关联方。

本计划的关联方名单可能将予不时有效的修订与补充，具体以管理人发布的最新公告为准，届时管理人网站上发布公告即以发布公告的方式向投资者履行了告知义务。投资者签署本合同，认购/参与本资产管理计划份额，即视为已经充分理解并同意该事项。

托管人应事前向管理人提供其关联方名单，并在不时更新后及时提供给管理人。

本计划关联交易的定义

- (1) 关联交易，指本计划与本计划关联方发生的交易，包括但不限于：
 - i 买卖本计划关联方发行的证券或承销期内承销的证券；
 - ii 以本计划关联方为交易对手进行的场外、银行间或交易所市场的交易；
 - iii 通过本计划关联方席位或交易单元开展的交易；
 - iv 向本计划关联方支付报酬；
 - v 投资于管理人及其关联方管理的其他产品；
 - vi 其他导致本计划与本计划关联方之间利益转移的活动。
- (2) 重大关联交易
 - i 买卖本计划关联方发行的证券或承销期内承销的证券；
 - ii 除接受关联方提供本合同约定的服务外，本计划单笔或多笔合计关联交易超过该计划交易时点的资产净值 20%（含）的关联交易；
 - iii 存在突破一般商事条款定价，或存在不公允对待疑虑的关联交易；
 - iv 根据实质重于形式原则认定的其他重大关联交易。
- (3) 一般关联交易

未被认定为重大关联交易的关联交易为一般关联交易。

本计划关联交易的批准

一般关联交易的批准

本计划开展关联交易应获得投资者事先同意。投资者签署本合同，认购/参与本资产管理计划份额，即视为已经充分理解前述一般关联交易和重大关联交易情形，并同意一般关联交易的开展，管理人无需就前述具体的一般关联交易再行分别取得投资者的单独、逐笔授权，但该等一般关联交易由投资团队发起关联交易申请并明确相关交易内容，经由资产管理部门审批后执行。一般关联交易应当按照市场通行的方式和条件参与，公平对待本计划财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。

重大关联交易的批准

管理人运用本计划财产拟开展重大关联交易，需经过管理人资产管理部门下设委员会、资管业务分管高管、总经理分级审批后，征询全体投资者意见，获得一致同意后方可开展重大关联交易。

关联交易的定价机制

关联交易的定价应当公允，具体定价方法按以下顺序适用：有政府定价的适用政府定价；有政府指导价的，可在政府指导价的范围内合理确定；没有政府定价或政府指导价，而有公开市场价格的参考该价格；没有公开市场价格的，按照可比非受控价格定价；既没有市场价格，也不适用可比非受控价格的，按照成本加成定价。

本计划关联交易的界定标准、审批流程和定价机制，或因相关法律、法规及管理人内控制度进行不时有效修订与补充，具体以管理人发布的最新公告为准。届时管理人网站上发布公告即以发布公告的方式向投资者履行了告知义务。投资者签署本合同，认购/参与本资产管理计划份额，即视为已经充分理解并同意该事项。

特别风险提示

一般关联交易风险提示

一般关联交易广泛存在于本计划日常的经营管理中，并不必然存在利益冲突，有损本计划财产，但关联交易也不必然不会产生利益冲突。投资者知悉，管理人保证其本身及其关联方将遵循公平、公正原则，平等对待所管理的所有投资产品，并保证不会在这些投资产品之间人为地故意输送利益，公平处理管理的其他投资产品与本资产管理计划的利益冲突。在发生该等利益冲突时，管理人将视具体利益冲突情形选择在向投资者的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对投资者利益的影响等。但是，管理人并不保证本计划在投资收益或投资风险方面会优于所管理的投资范围与本计划存在重叠和交叉的其他投资产品。管理人管理的其他投资产品的投资损失或投资收益未达预期并不意味着本计划不会出现投资损失或投资收益未达预期的类似情况。投资者不得因为本计划投资收益劣于管理人管理的其他类似投资产品，而向管理人提出任何损失或损害赔偿的要求。

重大关联交易风险提示

重大关联交易对本计划财产构成较为复杂的或显著的潜在不利影响，虽该等影响不必然导致本计划财产综合利益受损，但投资者应审慎对待管理人提交的开展重大关联交易提案，审慎回复对本计划是否同意开展该等事项的决定。

虽然管理人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、积极防范利益冲突，但仍可能因管理人运用本计划财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响投资者的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。此外，管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响本计划财产的投资收益。

第 12 节 风险揭示与特别说明

序号	项目	条款
12.1	投资风险揭示	详见《野村东方国际双季利享 6 个月滚动集合资产管理计划风险揭示书》
12.2	特别说明	本说明书作为本合同的重要组成部分，与本合同具有同等法律效力。

管理人：野村东方国际证券有限公司



2024 年 2 月 17 日