

中金启明星健康集合资产管理计划

法律文件变更提示公告

尊敬的投资者：

中国国际金融股份有限公司作为管理人于2022年6月23日发起设立中金启明星健康集合资产管理计划（以下简称“本计划”、“本集合计划”）。根据本计划投资运作安排，经与托管人协商一致，现需对《中金启明星健康集合资产管理计划资产管理合同》（下称《资产管理合同》）、《中金启明星健康集合资产管理计划说明书》（下称《说明书》）和《中金启明星健康集合资产管理计划风险揭示书》（下称《风险揭示书》）中投资策略、投资比例、业绩比较基准及确定依据等条款进行修改，具体详见本公告附件2-4。

为保证不同意合同变更的委托人退出集合计划的权利，本次法律文件变更设置异议期（2025年10月27日——2025年10月31日），投资者应在异议期内回复意见。投资者回复同意且未在异议期发起退出申请的，视为投资者同意合同变更；投资者回复不同意的，应在异议期内提出退出申请，管理人将按照附件中的处理方式办理退出申请；如投资者未明确回复或回复不同意但未在异议期内提出退出申请的，则管理人将在本次合同变更生效日前一个工作日（2025年11月3日）对该部分投资者持有的集合计划份额进行强制退出，管理人将参照附件1中的处理方式办理强制退出。

如异议期结束，本集合计划满足法律规定存续条件，变更后的《资产管理合同》、《说明书》、《风险揭示书》自2025年11月4日生效，同意变更的份额持有人无需就合同变更与管理人、托管人另行签署变更后的合同或关于合同变更的补充协议，经管理人公告的合同变更内容自变更生效时起自动成为变更后合同的组成部分，对合同各方均具有法律效力。

特征询投资者意见。

中国国际金融股份有限公司

2025年10月23日

附件 1：异议期退出处理方式

（一）退出的方式、价格、程序及确认

1、退出的方式和价格

（1）本集合计划采取“份额退出”原则，即退出以份额申请，申请退出份额精确到小数点后两位。

（2）本集合计划退出采用“未知价”原则，即退出价格以开放日（T 日）的集合计划份额净值为基准进行计算，该份额净值【T+1】日公布，遇暂停估值情形按照本合同约定办理。

（3）份额持有人退出集合计划份额时，按先进先出的方式处理，即对份额持有人在销售机构参与的集合计划份额进行退出处理时，参与确认日期在先的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出。

（4）如管理人对某一开放日（T 日）内投资者提出的退出申请进行确认后导致本集合计划的投资者少于两人，管理人有权决定不予确认委托人于 T 日及之后提出的退出申请，并终止本集合计划。在上述情况下，如管理人决定提前终止本集合计划的，本集合计划于【T+1】日提前终止，进入清算程序。对投资者于 T 日及之后提出的退出申请，管理人将不予确认；但对在 T 日前提出的退出申请，管理人将按照本合同约定的退出程序正常处理；

（5）如管理人对某一开放日（T 日）内投资者提出的退出申请进行确认后导致本集合计划资产净值低于【1000】万元时，管理人有权决定不予确认投资者于 T 日及之后提出的所有退出申请，并终止本集合计划。在上述情况下，如管理人决定提前终止本集合计划的，本集合计划于【T+1】日提前终止，进入清算程序。对投资者于 T 日及之后提出的退出申请，管理人将不予确认；但对在 T 日前提出的退出申请，管理人将按照《资产管理合同》约定的退出程序正常处理。管理人可在不违反法律法规的情况下，根据本集合计划运作的实际情况对上述原则进行调整，并于新的退出原则开始实施前在管理人网站公告投资者。

2、退出的程序

投资者按销售机构具体安排，在开放日（包括临时开放期）的交易时间段内通过销售机构指定营业网点或按销售机构提供的其他方式办理集合计划的退出申请；

3、退出的确认

(1) 销售机构受理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申请。退出申请是否接受应以份额登记机构的确认为准。在正常情况下，份额登记机构在【T+1】日内对 T 日退出申请的有效性进行确认。投资者应及时向管理人或其销售机构查询其退出申请的确认情况。

(2) 份额持有人退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管账户划往份额登记机构，再由份额登记机构划往各销售机构，并通过销售机构划往申请退出的份额持有人指定资金账户。正常情况下，退出款项的划拨自退出申请确认后【5】个工作日内从集合计划托管账户划出。如集合计划出现暂停估值或由于非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。在发生大额退出、巨额退出及连续巨额退出的情形时，退出款项的支付办法参照《资产管理合同》的有关条款处理。

(3) 份额持有人指定资金账户应为份额持有人支付认购、参与款项的原账户、同名账户。管理人和销售机构有权要求份额持有人就其指定资金账户出具符合相关法律法规规定的书面说明，否则管理人和销售机构均有权暂缓退出款项的划付，由此造成任何后果，由委托人自行承担。

在不违反法律法规的情况下，份额登记机构可根据相关业务规则，对上述注册登记结算办理时间进行调整，管理人于新规则开始实施前通过管理人网站公告投资者。

(二) 退出的金额限制

份额持有人部分退出集合计划的，其退出后持有的集合计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。当份额持有人申请部分退出集合计划份额将致使其在部分退出申请确认后持有的以开放日计划份额净值计价的集合计划份额净值低于规定的最低投资金额时，份额持有人应当一次性全部退出集合计划份额；份额持有人没有一次性全部退出持有份额的，管理人应当将该份额持有人剩余份额做强制退出处理。

(三) 退出的费用

本计划退出费率为 0%。

(四) 退出金额的计算方式

退出金额 = 退出份额 × T 日集合计划份额净值

退出费用 = (退出金额 - 业绩报酬 (如有)) × 退出费率

退出净额 = 退出金额 - 退出费用 - 业绩报酬 (如有)

退出金额的计算保留到小数点后两位, 小数点后第 3 位四舍五入, 由此产生的误差归入集合计划资产损益。

(五) 巨额退出的认定及处理方式

1、巨额退出和连续巨额退出的认定标准

本集合计划单个开放日 (包括临时开放期), 集合计划净退出申请份额 (退出申请份额总数扣除参与申请份额总数后的余额) 超过上一工作日集合计划总份额的【20】% 时, 即认为发生了巨额退出。连续巨额退出是指连续两个或以上开放日 (包括临时开放期), 集合计划净退出申请份额超过上一工作日集合计划总份额的【20】%。

2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

当出现巨额退出与连续巨额退出时, 管理人可根据集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、超额部分延期退出或暂停退出或管理人认为合理的其他方式。

1) 全额退出: 当管理人认为有能力支付份额持有人的全部退出款项时, 按正常退出程序执行。

2) 部分延期退出: 当管理人认为支付份额持有人的全部退出款项有困难或认为因支付份额持有人的全部退出款项而进行的财产变现可能会对集合计划的资产净值造成较大波动时, 管理人在当日接受退出比例不低于该开放日上一工作日集合计划总份额的【20】% 的前提下, 对其余退出申请可以延期办理。对于单个份额持有人的退出申请, 应当按照其申请退出份额占当日申请退出总份额的比例, 确定该单个份额持有人当日办理的退出份额; 委托人未能退出部分, 除委托人在提交退出申请时选择将当日未获办理部分予以撤销外, 延迟至【下一个工作日】办理, 退出价格为下一个工作日的集合计划份额净值。因延期退出造成退出价格波动导致的损失由份额持有人自行承担。依照上述规定转入下一个工作日的退出不享有退出优先权, 并以此类推, 直到全部退出为止。部分延期退出不受单笔退出最低金额的限制。下一个工作日为非开放日的, 不受开放日的限制。

3) 暂停退出: 发生连续巨额退出的, 管理人可以暂停接受退出申请; 已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项, 并应告知投资者。因暂停退出或延缓支付导致的损失由委托人自行承担。

4) 管理人可以根据集合计划运作的实际情况在不损害委托人利益的情况下更改上述退出安排。本集合计划退出安排的更改将遵循《资产管理合同》变更的相关程序。

3、告知客户的方式

当发生巨额退出或连续巨额退出且管理人决定部分延期退出或暂停退出时, 管理人应通过管理人网站公告、信函、传真、电子邮件、手机短信等本合同规定的方式之一, 在开放日结束后的 3 个工作日内告知份额持有人, 说明有关处理方法。

4、单个份额持有人大额退出的认定、预约申请和处理方式

单个份额持有人单个开放日 (包括临时开放日) 退出份额达到或超过【500 万份 (含 500 万份)】, 即视为单个份额持有人大额退出。

单个份额持有人大额退出需份额持有人在申请退出的开放日 (包括临时开放期) 的前 2 个工作日内向管理人或销售机构提出预约申请。如管理人认为接受该单个份额持有人大额退出申请对存量份额持有人利益构成潜在重大不利影响, 管理人有权拒绝其退出申请或仅接受其部分退出申请。

(六) 延期支付及延期退出的情形及处理方式

本计划计划延期支付及延期退出的情形及处理方式详见巨额退出的认定及处理方式、暂停退出的情形及处理方式等相关条款。

(七) 拒绝或暂停退出的情形及处理方式

发生下列情形之一时, 管理人可以暂停受理份额持有人的退出申请:

- (1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运行;
- (2) 发生本合同规定的暂停集合计划资产估值情况;
- (3) 当前一估值日占本集合计划资产净值【50%】以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时;
- (4) 证券期货交易所等交易场所在交易时间非正常停市;
- (5) 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;

(6) 接受退出申请将导致集合计划的负债比例(即总资产/净资产)超过法律法规、监管规定或本计划约定的负债比例上限的(包括但不限于将导致本计划的债券正回购资金余额或逆回购资金余额/本计划上一日净资产超过法律法规、监管规定或本计划约定的比例上限的);

(7) 管理人、托管人、销售机构或注册登记机构的技术故障等异常情况导致销售系统、注册登记系统或会计系统无法正常运行;

(8) 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份额持有人利益时; 或

(9) 法律法规规定、中国证监会认定或本合同约定的其他情形。

发生上述情形(第(8)项除外)之一且管理人决定暂停赎回的,已接受的退出申请,管理人将足额支付;如暂时不能支付的,可支付部分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,未支付部分由管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。大额退出、巨额退出及连续巨额退出另有约定的,从其约定。发生上述第(8)项情形时,管理人可以拒绝接受该笔退出申请或延期支付委托人的退出款项。

发生《资产管理合同》、《计划说明书》中未予载明的事项,但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,经与托管人协商一致后,可以暂停接受委托人的参与、退出申请。

发生暂停受理退出的情形时,管理人应将暂停受理退出的原因和处理办法通过管理人网站公告、信函、传真、电子邮件、手机短信等本合同规定的方式之一通知份额持有人。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。

附件 2:《中金启明星健康集合资产管理计划资产管理合同》变更明细表:

变更前	变更后
第五节 集合计划的基本情况	第五节 集合计划的基本情况
<p>(一) 名称: 中金启明星健康集合资产管理计划</p> <p>(二) 类别:【混合】类集合资产管理计划</p> <p>(三) 本集合计划【不属于】【基金中基金资产管理计划 (FOF)/管理人中管理人资产管理计划 (MOM)】。</p> <p>(四) 运作方式:【契约型开放式】</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>1、投资目标</p> <p>在严格控制下行风险的基础上,追求委托财产的稳进增值。</p> <p>2、主要投资方向</p> <p>本集合计划投的投资范围包括符合法律法规及监管规定的金融工具,包括:银行存款、货币市场基金、同业存单、在证券交易所或银行间市场交易的债券如国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、金融债、企业债、公司债、中期票据(包括永续中票)、短期融资券、超短期融资券、次级债(包括二级资本债)、可转换债券、可交换债券(含私募可交换债)、资产支持证券(票据)优先级、非公开定向债务融资工具(PPN)、交易所非公开发行债券、债券型公募基金证券投资基金(含债券型 ETF、债券型 QDII 基金)、债券正/逆回购; A 股股票(包括在主板、中小板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准或注册发行的股票,包含股票、新股申购、定向增发、可转债转股、可交换债交换转股等)、优先股、港股通标的股票、股票型公募基金证券投资基金(含股票型 ETF、股票型 QDII 基金)、混合型公募基金证券投资基金;本计划不投资除公募基金以外的资产管理产品。法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种的,经资产委托人、资产管理人、资产托管人协商一致,并签订补充协议后,可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>本计划可以参与债券正回购。</p> <p>3、投资比例</p> <p>(1) 本集合计划投资于存款(活期存款除外)、债券等债权类资产的比例低于资产管理计划总资产的 80%;</p> <p>(2) 除本合同另有约定外,本集合计划投资于权益类资产占资产管理计划总资产的比例为 30%-100%;由于本计划是主题型混合类产品,本计划投资于健康生活主题类权益类资产的比例可以(但非必须)不低于权益类资产的 80%,当本计划投资于健康生活主题类权益类资</p>	<p>(一) 名称: 中金启明星核心资产集合资产管理计划</p> <p>(二) 类别:【混合】类集合资产管理计划</p> <p>(三) 本集合计划【不属于】【基金中基金资产管理计划 (FOF)/管理人中管理人资产管理计划 (MOM)】。</p> <p>(四) 运作方式:【契约型开放式】</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>1、投资目标</p> <p>在尽可能控制风险的基础上,追求委托财产的增值。</p> <p>2、主要投资方向</p> <p>本集合计划投的投资范围包括符合法律法规及监管规定的金融工具,包括:银行存款、货币市场基金、同业存单、在证券交易所或银行间市场交易的债券如国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、金融债、企业债、公司债、中期票据(包括永续中票)、短期融资券、超短期融资券、次级债(包括二级资本债)、可转换债券、可交换债券(含私募可交换债)、资产支持证券(票据)优先级、非公开定向债务融资工具(PPN)、交易所非公开发行债券、债券型公募基金证券投资基金(含债券型 ETF、债券型 QDII 基金)、债券正/逆回购; A 股股票(包括在主板、中小板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准或注册发行的股票,包含股票、新股申购、定向增发、可转债转股、可交换债交换转股等)、优先股、港股通标的股票、股票型公募基金证券投资基金(含股票型 ETF、股票型 QDII 基金)、混合型公募基金证券投资基金;本计划不投资除公募基金以外的资产管理产品。法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种的,经资产委托人、资产管理人、资产托管人协商一致,并签订补充协议后,可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>本计划可以参与债券正回购。</p> <p>3、投资比例</p> <p>(1) 本集合计划投资于存款(活期存款除外)、债券等债权类资产的比例低于资产管理计</p>

<p>产的比例不低于权益类资产的 80%时，本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%；</p> <p>（3）本集合计划总资产不超过本集合计划资产净值的 200%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>4、产品风险等级</p> <p>本集合计划管理人评定的风险等级为【中高风险 R4】，适合风险承受能力为【激进型（C5）、积极型（C4）】的普通投资者及专业投资者。</p> <p>（六）集合计划的存续期限</p> <p>本集合计划存续期限为【10】年，自计划成立日起算，管理人有权根据本合同的约定决定提前终止本集合计划。</p> <p>（七）集合计划份额的初始募集面值</p> <p>本集合计划份额的初始募集面值为人民币 1.00 元/份。</p> <p>（八）集合计划的最低初始募集规模</p> <p>本集合计划的最低初始募集规模为【1000】万元。</p> <p>（九）集合计划的分级安排</p> <p>本集合计划无分级安排。</p> <p>（十）集合计划的外包服务机构</p> <p>本集合计划无外包服务机构。</p>	<p>划总资产的 80%；</p> <p>（2）除本合同另有约定外，本集合计划投资于权益类资产占资产管理计划总资产的比例为 20%-100%；本计划是主题型混合类产品，本计划投资于本合同约定的核心资产主题类权益类资产的比例可以（但非必须）不低于权益类资产的 80%，当本计划投资于本合同约定的核心资产主题类权益类资产的比例不低于权益类资产的 80%时，本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%；</p> <p>（3）本集合计划总资产不超过本集合计划资产净值的 200%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>4、产品风险等级</p> <p>本集合计划管理人评定的风险等级为【中高风险 R4】，适合风险承受能力为【激进型（C5）、积极型（C4）】的普通投资者及专业投资者。</p> <p>（六）集合计划的存续期限</p> <p>本集合计划存续期限为【10】年，自计划成立日起算，管理人有权根据本合同的约定决定提前终止本集合计划。</p> <p>（七）集合计划份额的初始募集面值</p> <p>本集合计划份额的初始募集面值为人民币 1.00 元/份。</p> <p>（八）集合计划的最低初始募集规模</p> <p>本集合计划的最低初始募集规模为【1000】万元。</p> <p>（九）集合计划的费用</p> <p>本计划的费用具体以资产管理合同第二十节的约定为准，主要包括：管理人的管理费（含业绩报酬（如有）、托管人的托管费及资产管理合同约定的应由资产管理计划财产承担的其他费用。其中，管理人的管理费费率为 0.2%/年；不设置业绩报酬。托管人的托管费费率为 0.02%/年。其他费用以实际发生金额为准，并按照资产管理合同约定由计划财产承担。</p> <p>（十）集合计划的分级安排</p> <p>本集合计划无分级安排。</p> <p>（十一）集合计划的外包服务机构</p> <p>本集合计划无外包服务机构。</p>
<p>第八节 集合计划的参与、退出与转让</p>	<p>第八节 集合计划的参与、退出与转让</p>
<p>....</p> <p>（二）参与和退出的开放日和时间</p> <p>本集合计划的开放日为每周周一、周三、周五（如果遇到非工作日顺延到下一个工作日）。管理人在开放日</p>	<p>....</p> <p>（二）参与和退出的开放日和时间</p> <p>本集合计划的开放日为每周周一、周三、周五（如果遇到非工作日顺延到下一个工作日，下</p>

受理集合计划份额的参与、退出申请，业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所的正常交易日的交易时间，但管理人根据法律法规、监管机构、自律组织要求或本合同约定暂停参与、退出的除外。若出现证券交易所等交易场所变更交易时间、或者发生影响本集合计划正常运作的重大事项的，管理人有权视情况对参与、退出业务具体办理时间进行相应的调整。

管理人保留对本集合计划的规模合理控制的权利，在本集合计划达到一定规模后，管理人可通过管理人网站公告后在开放日暂不接受参与，其后管理人可视情况通过管理人网站公告后恢复参与。

（三）临时开放期的触发条件、程序及披露

在本集合计划存续期内，因法律法规修订、监管要求或变更合同，管理人有权设置临时期间为投资者办理集合计划份额的退出业务，上述期间即为临时开放期。管理人根据上述约定设置临时开放期的，应事先通知托管人、销售机构和份额登记机构，并应提前通过管理人网站公告、信函、传真、电子邮件、手机短信等本合同约定的方式之一通知所有份额持有人，履行通知义务。

....

（十五）管理人自有资金参与集合计划

管理人有权以自有资金参与本集合计划，但管理人并无义务以自有资金参与本集合计划。管理人自有资金参与份额（如有）与其他份额享有同等权益、承担同等风险。管理人自有资金参与份额（如有）不承担任何风险补偿责任，与其他份额持有人持有的同类集合计划份额享有同等权益、承担同等风险。

1、自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

2、自有资金的参与方式：在满足法规规定的条件下，管理人在初始募集期和存续期均可以自有资金参与本集合计划。

3、自有资金参与的金额和比例：管理人以自有资金参与本集合计划份额不超过本集合计划总份额的 16%。管理人及其关联机构（关联机构可能包括管理人的子公司、孙公司、母公司、母公司控制的其他子公司，具体范围以监管要求为准）以自有资金参与本集合计划的份额合计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管理人自有资金参与本集合计划份额被动超过集合计划总份额的 16%，或管理人及其关联机构以自有资金参与本集合计划的份额合计超过本集合计划总份额的 50%时，管理人有权按照其自有资金或关联机构自有资金份额的超额情况，退出或督促其关联机构退出超过上述限制部分的参与份额。

一个工作日也为开放日的则合并且不再顺延）。管理人在开放日受理集合计划份额的参与、退出申请，业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所的正常交易日的交易时间，但管理人根据法律法规、监管机构、自律组织要求或本合同约定暂停参与、退出的除外。若出现证券交易所等交易场所变更交易时间、或者发生影响本集合计划正常运作的重大事项的，管理人有权视情况对参与、退出业务具体办理时间进行相应的调整。

管理人保留对本集合计划的规模合理控制的权利，在本集合计划达到一定规模后，管理人可通过管理人网站公告后在开放日暂不接受参与，其后管理人可视情况通过管理人网站公告后恢复参与。

（三）临时开放期的触发条件、程序及披露

在本集合计划存续期内，因法律法规修订、监管要求或变更合同及其他资产管理合同约定并符合监管要求的情形，管理人有权设置临时期间为投资者办理集合计划份额的退出业务，上述期间即为临时开放期。管理人根据上述约定设置临时开放期的，应事先通知托管人、销售机构和份额登记机构，并应提前通过管理人网站公告、信函、传真、电子邮件、手机短信等本合同约定的方式之一通知所有份额持有人，履行通知义务。

....

（十五）管理人自有资金参与集合计划

管理人有权以自有资金参与本集合计划，但管理人并无义务以自有资金参与本集合计划。管理人自有资金参与份额（如有）与其他份额享有同等权益、承担同等风险。管理人自有资金参与份额（如有）不承担任何风险补偿责任，与其他份额持有人持有的同类集合计划份额享有同等权益、承担同等风险。

1、自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

2、自有资金的参与方式：在满足法规规定的条件下，管理人在初始募集期和存续期均可以自有资金参与本集合计划。

3、自有资金参与的金额和比例：证券期货经营机构及其子公司（具体范围以监管要求为准）以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超

<p>4、自有资金退出的条件：除本合同另有约定外，管理人自有资金参与份额（如有）与其他份额同样办理退出业务。</p> <p>5、集合计划存续期内，管理人自有资金参与份额（如有）的持有期限不得少于6个月。但发生本部分第3项约定的自有资金参与份额比例被动超额导致退出及第7项约定的为应对集合计划巨额退出以解决流动性风险而退出等的情况除外。管理人有多笔自有资金参与的，按照“先进先出”原则计算管理人自有资金参与份额的持有期限。</p> <p>6、在本集合计划初始募集期，管理人及其关联机构可能以自有资金参与本集合计划，投资者、托管人签署本合同即视为同意管理人及其关联机构可以以自有资金在募集期参与，管理人将以募集公告或其他约定披露方式提前告知份额持有人和托管人；在本集合计划存续期，管理人及其关联机构以自有资金参与或退出的，管理人与托管人可以首先就该等事项达成一致，并至少提前5个工作日以管理人网站公告或其他约定披露方式向份额持有人披露相关信息，如份额持有人对该等事项有异议，可以在管理人设置的临时开放期中申请退出集合计划份额，但不因此影响自有资金参与或退出的效力。份额持有人未在临时开放期退出本集合计划的，即视为同意相关安排。</p> <p>发生本部分第3项约定的自有资金参与份额比例被动超额导致退出及第7项约定的为应对集合计划巨额退出以解决流动性风险而参与或退出的情况，可不受本条约定限制，但应在自有资金参与或退出后及时告知份额持有人及托管人。</p> <p>7、为应对集合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本合同约定的前提下，管理人及其关联机构自有资金参与、退出可不受上述第3条、第5条及第6条限制，但应当及时告知份额持有人和托管人，并向中国证监会相关派出机构等有权机构报告。</p> <p>....</p>	<p>过本集合计划总份额的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。</p> <p>因集合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以自有资金参与比例不符合上述要求时，管理人有权按照其自有资金或子公司自有资金份额的超额情况，退出或督促其子公司退出超过上述限制部分的参与份额。</p> <p>4、自有资金退出的条件：除本合同另有约定外，管理人自有资金参与份额（如有）与其他份额同样办理退出业务。</p> <p>5、集合计划存续期内，管理人自有资金参与份额（如有）的持有期限不得少于6个月。但发生本部分第3项约定的自有资金参与份额比例被动超额导致退出及第7项约定的为应对集合计划巨额退出以解决流动性风险而退出等的情况除外。管理人有多笔自有资金参与的，按照“先进先出”原则计算管理人自有资金参与份额的持有期限。</p> <p>6、在本集合计划初始募集期，证券期货经营机构及其子公司（具体范围以监管要求为准）可能以自有资金参与本集合计划，投资者、托管人签署本合同即视为同意证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金在募集期参与，管理人将以募集公告或其他约定披露方式提前告知份额持有人和托管人；在本集合计划存续期，证券期货经营机构及其子公司（具体范围以监管要求为准）以自有资金参与或退出的，管理人与托管人可以首先就该等事项达成一致，并至少提前5个工作日以管理人网站公告或其他约定披露方式向份额持有人披露相关信息，如份额持有人对该等事项有异议，可以在管理人设置的临时开放期中申请退出集合计划份额，但不因此影响自有资金参与或退出的效力。份额持有人未在临时开放期退出本集合计划的，即视为同意相关安排。</p> <p>发生本部分第3项约定的自有资金参与份额比例被动超额导致退出及第7项约定的为应对集合计划巨额退出以解决流动性风险而参与或退出的情况，可不受本条约定限制，但应在自有资金参与或退出后及时告知份额持有人及托管人。</p> <p>7、为应对集合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本合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司（具体范围以监管要求为准）自有资金参与、退出可不受上述第3条、第5条及第6条限制，但应当及时告知份额持有人和托管人。</p>
--	---

	人，并向中国证监会相关派出机构等有权机构报告。
第十一节 集合计划的投资	第十一节 集合计划的投资
<p>(一) 投资目标</p> <p>在严格控制下行风险的基础上，追求委托财产的稳进增值。</p> <p>(二) 投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划可以投资于下列投资品种：</p> <p>本集合计划投的投资范围包括符合法律法规及监管规定的金融工具，包括：银行存款、货币市场基金、同业存单、在证券交易所或银行间市场交易的债券如国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、金融债、企业债、公司债、中期票据（包括永续中票）、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、可转换债券、可交换债券（含私募可交换债）、资产支持证券（票据）优先级、非公开定向债务融资工具（PPN）、交易所非公开发行债券、债券型公募证券投资基金（含债券型ETF、债券型QDII基金）、债券正/逆回购；A股股票（包括在主板、中小板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准或注册发行的股票，包含股票、新股申购、定向增发、可转债转股、可交换债交换转股等）、优先股、港股通标的股票、股票型公募证券投资基金（含股票型ETF、股票型QDII基金）、混合型公募证券投资基金；本计划不投资除公募基金以外的资产管理产品。法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种的，经资产委托人、资产管理人、资产托管人协商一致，并签订补充协议后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>本计划可以参与债券正回购。</p> <p>法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>2、投资比例</p> <p>(1) 本集合计划投资于存款（活期存款除外）、债券等债权类资产的比例低于资产管理计划总资产的80%；</p> <p>(2) 除本合同另有约定外，本集合计划投资于权益类资产占资产管理计划总资产的比例为30%-100%；由于本计划是主题型混合类产品，本计划投资于健康生活主题类权益类资产的比例可以（但非必须）不低于权益类资产的80%，当本计划投资于健康生活主题类权益类资产的比例不低于权益类资产的80%时，本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的80%；</p>	<p>(一) 投资目标</p> <p>在尽可能控制风险的基础上，追求委托财产的增值。</p> <p>(二) 投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划可以投资于下列投资品种：</p> <p>本集合计划投的投资范围包括符合法律法规及监管规定的金融工具，包括：银行存款、货币市场基金、同业存单、在证券交易所或银行间市场交易的债券如国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、金融债、企业债、公司债、中期票据（包括永续中票）、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、可转换债券、可交换债券（含私募可交换债）、资产支持证券（票据）优先级、非公开定向债务融资工具（PPN）、交易所非公开发行债券、债券型公募证券投资基金（含债券型ETF、债券型QDII基金）、债券正/逆回购；A股股票（包括在主板、中小板、创业板、科创板、北交所及其他经中国证监会核准或注册发行的股票，包含股票、新股申购、定向增发、可转债转股、可交换债交换转股等）、优先股、港股通标的股票、股票型公募证券投资基金（含股票型ETF、股票型QDII基金）、混合型公募证券投资基金；本计划不投资除公募基金以外的资产管理产品。法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种的，经资产委托人、资产管理人、资产托管人协商一致，并签订补充协议后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>本计划可以参与债券正回购。</p> <p>法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>2、投资比例</p> <p>(1) 本集合计划投资于存款（活期存款除外）、债券等债权类资产的比例低于资产管理计划总资产的80%；</p> <p>(2) 除本合同另有约定外，本集合计划投资于权益类资产占资产管理计划总资产的比例为20%-100%；由于本计划是主题型混合类产品，本</p>

<p>(3) 本集合计划总资产不超过本集合计划资产净值的 200%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>如果法律法规及监管政策等对本合同约定的相关投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准，管理人在履行适当程序后，可根据法律法规及监管政策要求相应调整投资比例限制规定。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制。</p> <p>本集合计划投资其他资产管理产品的，管理人将按照所投资资产管理产品向管理人披露投资组合的频率，更新计算本集合计划的相关监控指标（如总资产、投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额等，具体监控指标根据监管要求确定），如更新后发现相关指标超标的，管理人将及时进行调整，但因所投资资产管理产品处于非开放期、相关资产处于封闭期、锁定期、限售期、停牌、涨跌停板、市场成交量有限、发行人或其他付款义务人违约等非管理人原因导致无法及时调整的，管理人不承担责任，管理人将在所投资资产管理产品可退出或相关资产可出售、可转让或者恢复交易后及时调整。</p> <p>份额持有人充分知悉、理解并认可，管理人对于上述监控指标的监控，将依赖并受限于所投资资产管理产品披露其投资组合的全面性、准确性和及时性，属于事后有限范围的监控。由于本集合计划所投资的资产管理产品管理人未及时提供投资组合信息或提供投资组合信息有限或有误，导致管理人无法监控或监控数据错误的，管理人不承担责任。</p> <p>(三) 投资比例超限的处理</p> <p>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导致本集合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，管理人应当及时根据法律法规、监管规定、自律组织规则等要求向监管机构报告。</p> <p>(四) FOF 所投资资产管理产品的选择标准（如适用）不适用。</p> <p>(五) 风险收益特征</p> <p>本集合计划管理人评定的风险等级为【中高风险 R4】，适合风险承受能力为【激进型（C5）、积极型（C4）】的普通投资者及专业投资者。</p> <p>(六) 业绩比较基准及确定依据</p> <p>本计划业绩比较基准：中证医药卫生指数收益率</p>	<p>计划投资于本合同约定的核心资产主题类权益类资产的比例可以（但非必须）不低于权益类资产的 80%，当本计划投资于本合同约定的核心资产主题类权益类资产的比例不低于权益类资产的 80% 时，本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%；</p> <p>(3) 本集合计划总资产不超过本集合计划资产净值的 200%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>如果法律法规及监管政策等对本合同约定的相关投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准，管理人在履行适当程序后，可根据法律法规及监管政策要求相应调整投资比例限制规定。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制。</p> <p>本集合计划投资其他资产管理产品的，管理人将按照所投资资产管理产品向管理人披露投资组合的频率，更新计算本集合计划的相关监控指标（如总资产、投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额等，具体监控指标根据监管要求确定），如更新后发现相关指标超标的，管理人将及时进行调整，但因所投资资产管理产品处于非开放期、相关资产处于封闭期、锁定期、限售期、停牌、涨跌停板、市场成交量有限、发行人或其他付款义务人违约等非管理人原因导致无法及时调整的，管理人不承担责任，管理人将在所投资资产管理产品可退出或相关资产可出售、可转让或者恢复交易后及时调整。</p> <p>份额持有人充分知悉、理解并认可，管理人对于上述监控指标的监控，将依赖并受限于所投资资产管理产品披露其投资组合的全面性、准确性和及时性，属于事后有限范围的监控。由于本集合计划所投资的资产管理产品管理人未及时提供投资组合信息或提供投资组合信息有限或有误，导致管理人无法监控或监控数据错误的，管理人不承担责任。</p> <p>(三) 投资比例超限的处理</p> <p>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导致本集合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</p>
--	--

<p>*50%+中证消费服务领先指数收益率*20%+中债综合指数收益率*20%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*10%。</p> <p>采用该比较基准主要基于如下考虑:</p> <p>1、中证医药卫生指数由中证指数有限公司编制,成份股包括中证 800 指数全部样本股(含沪深 300 指数和中证 500 指数的成份股)中属于医药卫生行业的上市公司,以反映该行业公司股票的整体表现。</p> <p>2、中证消费服务领先指数是以中证全指为样本空间,由食品饮料业、服装及其他纤维制品制造业、文教体育用品制造业、医药生物制品业等行业中总市值排名前 100 的股票构成,以反映沪深 A 股消费服务类股票的整体表现。</p> <p>3、恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制,以香港股票市场中的 50 家上市公司股票为成份股样本,以其发行量为权数的加权平均股价指数,是反映香港股市价格趋势最有影响的一种股价指数。</p> <p>4、中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,为中国全市场债券指数;样本范围涵盖银行间市场和交易所市场,成份债券包括国债、企业债券、央行票据等所有主要债券种类,能较好地反映债券市场的整体收益,具有广泛的市场代表性。</p> <p>5、基于本计划的投资范围和投资比例限制,选用该业绩比较基准能够基本反映本计划的风险收益特征。</p> <p>如果指数编制单位停止计算编制以上指数或更改指数名称、或今后法律法规发生变化、或有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出、或市场上出现更加适用于本计划的业绩基准的指数时,本计划可以与资产托管人协商一致,在按照监管部门要求履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告,无须提前取得份额持有人同意。</p> <p>本合同约定的业绩比较基准(如有)仅供投资者参考,不构成管理人保证委托财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。</p> <p>(七) 投资策略</p> <p>1、决策依据</p> <p>本集合计划以国家有关法律、法规和本合同有关规定为决策依据,并以维护份额持有人利益作为最高准则。具体决策依据包括:</p> <p>(1)《管理办法》、《运作规定》、本合同、《计划说明书》等有关法律性文件;</p> <p>(2)国内外经济形势、利率变化趋势以及行业与上市公司基本面研究;</p> <p>(3)投资对象收益和风险的匹配关系,本集合计划将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出投资</p>	<p>调整的,管理人应当及时根据法律法规、监管规定、自律组织规则等要求向监管机构报告。</p> <p>(四) FOF 所投资资产管理产品的选择标准(如适用)</p> <p>不适用。</p> <p>(五) 风险收益特征</p> <p>本集合计划管理人评定的风险等级为【中高风险 R4】,适合风险承受能力为【激进型(C5)、积极型(C4)】的普通投资者及专业投资者。</p> <p>(六) 业绩比较基准及确定依据</p> <p>本计划业绩比较基准: 不设置。</p> <p>(七) 投资策略</p> <p>1、决策依据</p> <p>本集合计划以国家有关法律、法规和本合同有关规定为决策依据,并以维护份额持有人利益作为最高准则。具体决策依据包括:</p> <p>(1)《管理办法》、《运作规定》、本合同、《计划说明书》等有关法律性文件;</p> <p>(2)国内外经济形势、利率变化趋势以及行业与上市公司基本面研究;</p> <p>(3)投资对象收益和风险的匹配关系,本集合计划将在充分权衡投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。</p> <p>2、决策程序</p> <p>本集合计划投资业务采取投资决策委员会领导下的投资经理负责制。</p> <p>(1) 投资决策委员会</p> <p>投资决策委员会是管理人资产管理部投资管理的最高决策机构,由投资总监及投资经理组成,并定期向资产管理部管理层报告。</p> <p>(2) 投资总监</p> <p>投资总监在投资决策委员会授权的范围内,负责召集和主持投资决策委员会,形成投资决策委员会决议,定期审阅投资组合及决定投资的其它重大事项,组织、管理、协调日常投资、研究工作。</p> <p>(3) 投资经理</p> <p>管理人资产管理部的投资决策机制强调以下两个原则:</p> <p>第一,集体讨论,分级授权。投资决策委员会处于投资决策过程中的核心地位,是管理人资产管理部的最高投资决策机构。投资决策委员会负责确定重大投资方案;投资总监在授权范围内审批投资经理的投资建议;投资经理则在授权范</p>
---	--

决策。

2、决策程序

本集合计划投资业务采取投资决策委员会领导下的投资经理负责制。

(1) 投资决策委员会

投资决策委员会是管理人资产管理部投资管理的最高决策机构，由投资总监及投资经理组成，并定期向资产管理部管理层报告。

(2) 投资总监

投资总监在投资决策委员会授权的范围内，负责召集和主持投资决策委员会，形成投资决策委员会决议，定期审阅投资组合及决定投资的其它重大事项，组织、管理、协调日常投资、研究工作。

(3) 投资经理

管理人资产管理部的投资决策机制强调以下两个原则：

第一，集体讨论，分级授权。投资决策委员会处于投资决策过程中的核心地位，是管理人资产管理部的最高投资决策机构。投资决策委员会负责确定重大投资方案；投资总监在授权范围内审批投资经理的投资建议；投资经理则在授权范围内构建和调整投资组合；

第二，严格风控，科学决策。严格的风险控制是进行科学、合理投资决策的有力保证。

3、投资管理的方法和标准

1、股票投资策略

(1) 主题挖掘

随着我国经济社会持续快速发展，人民生活需要日趋多样化、多方面、多层次，人民对于健康生活的要求逐步提高，健康生活主题相关产业和公司有望在未来获得快速发展。

在此背景下，本计划主要投资于健康生活主题相关的优质企业。具体来说，本计划界定的健康生活主题包括以下两个维度：

一是与人类生命健康直接相关的产业和公司，具体是指从事医疗相关产品或服务研发、生产与销售的公司。包括：从事化学制药行业、中药行业、生物制品行业、医药商业行业、医疗器械行业和医疗服务行业等传统医药领域的上市公司；以及医疗信息化、移动医疗、医药电商以及相关新兴医疗领域的上市公司。

二是有利于满足或改善人民身心健康需求的产业和公司。具体包括以下两类公司：（1）符合居民衣食住行和基本的保养保健需求的行业，包括纺织服装、餐饮旅游、食品饮料、房地产、家电、交运、汽车、商贸、个人护理等；（2）能够提高居民生活质量、丰富居民精神

国内构建和调整投资组合；

第二，严格风控，科学决策。严格的风险控制是进行科学、合理投资决策的有力保证。

3、投资管理的方法和标准

1、股票投资策略

(1) 主题挖掘

本计划所指的核心资产是指根据管理人的内部标准判断，管理人认为能够适应中国经济从高速增长向高质量增长的新形势，各个方面都具备明显优势并在行业当中有一定影响力的优质公司。本计划所指的权益核心资产一般集中在以下行业，这些行业通常具有相对的行业领先地位、高市场占有率、稳定盈利能力或长期成长潜力，并与国民经济支柱产业紧密相关：

1) 金融行业，包括但不限于以高股息和稳健经营为特征的国有大行及零售银行龙头、受益于长期增长和资产配置需求的综合金融巨头和受益于资本市场改革的券商；

2) 消费行业，包括但不限于具备品牌护城河和抗周期特性的白酒与食品饮料行业、受益于消费升级和全球化布局的家电与免税领域；

3) 科技与高端制造行业，包括但不限于代表国产替代和科技自主方向的半导体与硬件、主导全球动力电池和新能源汽车产业链以及支撑数字经济基础设施的通信与 5G；

4) 医药与医疗行业，包括但不限于受益于老龄化和医药创新的创新药与 CXO、国产替代加速的医疗器械；

5) 能源与基建行业，包括但不限于保障国家能源安全的传统能源、现金流稳定的电力与公用事业以及受益于基建投资的基建与工程机械；

6) 国防军工与战略产业，包括但不限于涉及国家安全和高端装备的军工行业和支撑制造业升级的稀土与材料。

*特别提示投资者知悉并认可：

对于以上行业之外的其他行业，如对经济高质量增长具有积极作用，符合管理人内部标准判断认为构成核心资产的投资主题，本计划也将对这些行业的公司进行布局。即上述行业并非穷举式的列举，本计划不一定投资或仅投资于上述所列行业。

本计划将对核心资产主题相关的上市公司和行业进行密切跟踪，随着市场环境、相关政策等因素的不断变化，管理人根据内部标准认定的核心资产主题的上市公司或行业的范围也会相

<p>生活的行业，包括高端中药、品牌 OTC、家用医疗器械、教育、体育、休闲娱乐、金融服务、绿色消费（新能源汽车、绿色家居等）、时尚消费（医美、化妆品、珠宝等）、消费电子等。</p> <p>此外，对于以上行业之外的其他行业，如对提升居民健康生活水平具有积极作用，符合健康生活的投资主题，本计划也将对这些行业的公司进行布局。</p> <p>本计划将对健康生活主题相关的上市公司发展进行密切跟踪，随着市场环境、相关政策等因素的不断变化，健康生活主题的上市公司的范围也会相应改变。计划管理人将在履行适当程序后，可根据实际情况调整相关主题和投资范围的界定。</p> <p>... ..</p>	<p>应改变。如管理人调整该等标准的导致具体资产被纳入或调出本计划主题标的库的，不构成对本合同的变更。</p> <p>... ..</p>
<p style="text-align: center;">第十四节 利益冲突及关联交易</p>	<p style="text-align: center;">第十四节 利益冲突及关联交易</p>
<p>（一）本集合计划存在或可能存在的利益冲突情形</p> <p>1、关联方的范围</p> <p>管理人或托管人的关联方，是指管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人、与其有重大利害关系的公司或其他关联方。管理人的关联方以最近一期上市公司披露年报为基础，结合《公司法》和《企业会计准则》的规定确定，托管人的关联方名单以托管人定期披露或最近一期年报公布的关联方名单为准。</p> <p>2、关联交易</p> <p>关联交易是指本计划与关联方进行的交易，包括但不限于：运用本计划资产投资于管理人、托管人及其关联方发行的证券或承销期内承销的证券；运用本计划资产投资于管理人及子公司设立的金融产品，或管理人担任投资顾问的金融产品，或通过管理人及其关联方代销渠道认购/申购金融产品；运用本计划资产与管理人及子公司、管理人及子公司设立的金融产品，或管理人担任投资顾问的金融产品进行对手方交易；本计划接受管理人及其关联方发行的债券作为债券逆回购的质押券；本计划与管理人及其关联方作为交易对手进行债券逆回购交易；以及其他导致本计划与关联方之间利益转移的活动。</p> <p>其中：</p> <p>（1）重大关联交易是指至少符合如下情形之一的关联交易：1）将本计划委托财产投资于管理人、托管人及其关联方发行的或承销期内承销的证券；2）关联交易单笔交易金额达到或超过本计划净资产的 5%。</p> <p>（2）一般关联交易是指除上述重大关联交易以外的其他关联交易。</p> <p>上述关联交易范围与最新法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求不一致的，以届时适用的法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求为准。</p> <p>3、管理人、托管人及相关从业人员不得利用资产管</p>	<p>（一）本集合计划存在或可能存在的利益冲突情形</p> <p>1、关联方的范围</p> <p>产品涉及的关联方主要包括：（1）产品管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人、与其有重大利害关系的公司或者其他关联方；（2）管理人及其控股股东、实际控制人、与其有重大利害关系的公司或者其他关联方设立的金融产品或管理人担任投资顾问的金融产品</p> <p>管理人的关联方以最近一期上市公司披露年报为基础，结合《公司法》和《企业会计准则》的规定确定，托管人的关联方名单以托管人定期披露或最近一期年报公布的关联方名单为准。</p> <p>2、关联交易</p> <p>关联交易是指本计划与关联方进行的交易，包括但不限于：运用资产管理产品资产投资于上述第 1 项第（1）条的主体发行的证券或承销期内承销的证券；投资于上述第 1 项第（2）条的金融产品；与上述第 1 项第（1）条的主体和第（2）条的金融产品进行对手方交易；接受上述第 1 项第（1）条的主体发行的债券作为债券逆回购的质押券等。</p> <p>其中：</p> <p>（1）重大关联交易是指至少符合如下情形之一的关联交易：1）将本计划受托财产投资于上述第 1 项第（1）条的主体发行的或承销期内承销的证券；2）关联交易单笔交易金额达到或超过本计划净资产的 10%；</p> <p>（2）一般关联交易是指除上述重大关联交易以外的其他关联交易。</p> <p>上述关联交易范围与最新法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求不一致的，以</p>

<p>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，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资。</p> <p>4、全体份额持有人充分知悉并理解，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能仍会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。</p> <p>（二）利益冲突的处理和披露</p> <p>1、管理人运用集合计划财产进行上述第（一）款第2项所列投资交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定的投资目标、投资策略，并遵循份额持有人利益优先原则，防范利益冲突。</p> <p>2、管理人应当建立健全关联交易的内部审批机制和评估机制，本资产管理计划从事关联交易，管理人应事先履行公司内部审批流程，由投资经理发起申请，经投资总监审批后方可执行。</p> <p>3、关联交易的处理和披露</p> <p>管理人运用集合计划财产进行上述一般关联交易</p>	<p>届时适用的法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求为准。</p> <p>3、管理人、托管人及相关从业人员不得利用资产管理计划，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，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资。</p> <p>4、全体份额持有人充分知悉并理解，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能仍会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。</p> <p>（二）利益冲突的处理和披露</p> <p>1、管理人运用集合计划财产进行上述第（一）款第2项所列投资交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定的投资目标、投资策略，并遵循份额持有人利益优先</p>
--	---

的，交易前无需另行取得份额持有人的同意或通知份额持有人。全体份额持有人知悉并确认，份额持有人签署本合同即视为已授权管理人可进行上述一般关联交易且无需另行征得份额持有人同意。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操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的关联交易风险，进而可能影响份额持有人的利益。份额持有人知悉并接受关联交易风险。在交易完成后的合理时间内，管理人应将交易的情况书面通知托管人，并通过管理人的网站公告或合同约定的其他方式告知份额持有人。

管理人运用本计划财产进行上述重大关联交易的，交易前将以公告方式向份额持有人披露具体关联交易的情况并设置临时开放期供不同意的份额持有人退出，不同意的份额持有人应在临时开放期内申请退出，如份额持有人在临时开放期内未申请退出的（包括回复不同意但未提出退出申请或未明确回复意见的）视为同意。在每笔交易完成后的合理时间内，管理人应将关联交易的情况书面通知份额持有人和托管人。

如果法律法规、监管规定、自律组织规则及交易所规则等要求管理人就上述投资交易向监管机构、基金业协会或交易所等有权机构报告或备案，管理人按相关规定办理。

原则，防范利益冲突。

2、管理人应当建立健全关联交易的内部审批机制和评估机制，本资产管理计划从事关联交易，管理人应事先履行公司内部审批流程，由投资经理发起申请，经投资总监审批后方可执行。

3、关联交易的处理和披露

管理人运用集合计划财产进行上述一般关联交易的，交易前无需另行取得份额持有人的同意或通知份额持有人。全体份额持有人知悉并确认，份额持有人签署本合同即视为已授权管理人可进行上述一般关联交易且无需另行征得份额持有人同意。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操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的关联交易风险，进而可能影响份额持有人的利益。份额持有人知悉并接受关联交易风险。在交易完成后的合理时间内，管理人应将交易的情况书面通知托管人，并通过管理人的网站公告或合同约定的其他方式告知份额持有人。

管理人运用本计划财产进行上述重大关联交易的，交易前将以公告方式向份额持有人披露具体关联交易的情况并设置临时开放期供不同意的份额持有人退出，不同意的份额持有人应在临时开放期内申请退出，如份额持有人在临时开放期内未申请退出的（包括回复不同意或未明确回复意见但未提出退出申请的）视为同意。在每笔交易完成后的合理时间内，管理人应将关联交易的情况书面通知份额持有人和托管人。

如果法律法规、监管规定、自律组织规则及

	交易所规则等要求管理人就上述投资交易向监管机构、基金业协会或交易所等有权机构报告或备案，管理人按相关规定办理。
第十五节 投资经理的指定与变更	第十五节 投资经理的指定与变更
<p>(一) 投资经理的指定</p> <p>1、本集合计划的投资经理由管理人负责指定。</p> <p>2、投资经理简介</p> <p>杨钊先生，2020 年 10 月加入中金公司，任权益投资经理。加入中金之前，2016.9-2018.4 在兴证全球基金管理有限公司任研究员，2018.4-2020.9 在华宝基金管理有限公司任高级分析师，在医药行业具有 7 年的投研经验。具备法律法规规定的投资管理等相关业务经验，不存在兼职情况，已经取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>……</p>	<p>(一) 投资经理的指定</p> <p>1、本集合计划的投资经理由管理人负责指定。</p> <p>2、投资经理简介</p> <p>汤杰先生，11 年权益研究从业经验，中山大学经济学学士，美国克拉克大学金融硕士，2021 年加入中金公司任权益研究员，2021 年起担任资产管理部投资经理助理一职。加入中金公司前，曾任中欧基金管理有限公司权益高级研究员。具备法律法规规定的投资管理等相关业务三年以上经验，已经取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚，无其他兼职。</p> <p>……</p>
第十九节 集合计划的估值和会计核算	第十九节 集合计划的估值和会计核算
<p>……</p> <p>(七) 估值方法：</p> <p>集合计划资产的估值，参照《企业会计准则》、《指导意见》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定、资产管理计划净值计价及风险控制要求及本合同约定的估值方法进行。如国内证券投资会计原则及方法发生变化，由管理人与托管人另行协商确定估值方法。</p> <p>1、上市流通股票、权证、存托凭证等有价值证券的估值</p> <p>上市流通股票、权证、存托凭证等有价值证券按估值日其所在证券交易所的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。</p> <p>2、未上市有价值证券的估值</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所上市的同一种股票的估值价格估值。该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。</p> <p>(2) 首次发行未上市的股票，如果发行日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用发行价作为公允</p>	<p>……</p> <p>(七) 估值方法：</p> <p>集合计划资产的估值，参照《企业会计准则》、《指导意见》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定、资产管理计划净值计价及风险控制要求及本合同约定的估值方法进行。如国内证券投资会计原则及方法发生变化，由管理人与托管人另行协商确定估值方法。</p> <p>1、上市流通股票、权证、存托凭证等有价值证券的估值</p> <p>上市流通股票、权证、存托凭证等有价值证券按估值日其所在证券交易所的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。</p> <p>2、未上市有价值证券的估值</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在交易所上市的同一种股票的估值价格估值。该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。</p>

价值的最佳估计;已发生影响公允价值计量重大事件的,应采用其他估值方法确定公允价值。

(3) 发行时明确一定期限限售期的股票(包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等)按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、优先股

上市流通的优先股选取第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的相应品种当日的估值价格进行估值;首次发行未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的优先股,采用发行价格或其他估值方法确定公允价值。

4、固定收益品种估值。

(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种(本合同另有规定的除外),选取第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的相应品种当日的估值净价进行估值;交易所上市或挂牌转让的实行全价交易的债券,选取第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的相应品种当日估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。交易所公开发行上市交易的可转换债券除外。

(2)交易所公开发行上市交易的可转换债券,按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,收盘价选取最近交易日债券收盘价;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(3) 首次公开发行未上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(4) 全国银行间市场交易的固定收益品种(本合同另有规定的除外),选取第三方估值机构(中债金融估值中心有限公司)提供的相应品种当日的估值净价进行估值。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采用其他估值方法确定公允价值。

(5) 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。

....

(2) 首次发行未上市的股票,如果发行日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用发行价作为公允价值的最佳估计;已发生影响公允价值计量重大事件的,应采用估值技术确定公允价值。

(3) 发行时明确一定期限限售期的股票(包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等)按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、优先股

上市流通的优先股选取第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的相应品种当日的估值价格进行估值;首次发行未上市,且第三方估值机构(中证指数有限公司)未提供估值价格的优先股,采用发行价格估值,已发生影响公允价值计量重大事件的,应采用估值技术确定其公允价值。

4、固定收益品种估值

(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的实行净价交易的固定收益品种(本合同另有规定的除外),选取第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的相应品种当日的估值净价进行估值;交易所上市或挂牌转让的实行全价交易的债券,选取第三方估值机构(中证指数有限公司)提供的相应品种当日估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。交易所公开发行上市交易的可转换债券除外。

(2) 交易所公开发行上市交易的可转换债券,按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,收盘价选取最近交易日债券收盘价;如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(3) 首次公开发行未上市的债券,且第三方估值机构(中证指数有限公司)未提供估值价格的交易所债券,采用发行价格估值,已发生影响公允价值计量重大事件的,应采用估值技术确定其公允价值。

(4) 全国银行间市场交易的固定收益品种

	<p>(本合同另有规定的除外), 选取第三方估值机构(中债金融估值中心有限公司)提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市, 且第三方估值机构(中债金融估值中心有限公司)未提供估值价格的债券采用其他估值方法确定公允价值。</p> <p>(5) 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。</p> <p>....</p>
第二十节 集合计划的费用与税收	第二十节 集合计划的费用与税收
<p>....</p> <p>(二) 费率、费率的调整、计提方法、计提标准、计提方式和支付方式</p> <p>1、管理费</p> <p>管理费按前一日集合计划资产净值的 0.1% 的年费率计提。计算方法如下:</p> $H=E \times 0.1\% \div \text{当年实际天数}$ <p>H 为每日应计提的管理费, E 为前一日资产净值(成立首日按当日资产净值计算)。</p> <p>管理人的管理费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由托管人根据与管理人核对一致的财务数据, 自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付, 管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后, 管理人应进行核对, 如发现数据不符, 及时联系托管人协商解决, 若委托财产现金形式资产不足以支付或遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。</p> <p>管理人可以在法律法规、本合同约定的范围内调低管理费, 并最迟应于新的费率或收费方式实施日前在管理人网站公告。</p> <p>管理费收款账户如下</p> <p>收款人: 中国国际金融股份有限公司</p> <p>账号: 11001085100056000400</p> <p>开户行: 中国建设银行北京市国贸支行</p> <p>管理人如需要变更此账户, 应提前 5 个工作日向托管人出具书面的收款账户变更通知。</p> <p>2、托管费</p> <p>托管费按前一日集合计划资产净值的-0.02%的年费率计提。计算方法如下:</p> $H=E \times -0.02\% \div \text{当年实际天数}$ <p>H 为每日应计提的托管费, E 为前一日资产净值(成立首日按当日资产净值计算)。</p> <p>托管人的托管费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由托管人根据与管理人核对一致的财务数据, 自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付, 管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣</p>	<p>....</p> <p>(二) 费率、费率的调整、计提方法、计提标准、计提方式和支付方式</p> <p>1、管理费</p> <p>管理费按前一日集合计划资产净值的 0.2% 的年费率计提。计算方法如下:</p> $H=E \times 0.2\% \div \text{当年实际天数}$ <p>H 为每日应计提的管理费, E 为前一日资产净值(成立首日按当日资产净值计算)。</p> <p>管理人的管理费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由托管人根据与管理人核对一致的财务数据, 自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付, 管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后, 管理人应进行核对, 如发现数据不符, 及时联系托管人协商解决, 若委托财产现金形式资产不足以支付或遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。</p> <p>管理人可以在法律法规、本合同约定的范围内调低管理费, 并最迟应于新的费率或收费方式实施日前在管理人网站公告。</p> <p>管理费收款账户如下</p> <p>收款人: 中国国际金融股份有限公司</p> <p>账号: 11001085100056000400</p> <p>开户行: 中国建设银行北京市国贸支行</p> <p>管理人如需要变更此账户, 应提前 5 个工作日向托管人出具书面的收款账户变更通知。</p> <p>2、托管费</p> <p>托管费按前一日集合计划资产净值的-0.02%的年费率计提。计算方法如下:</p> $H=E \times -0.02\% \div \text{当年实际天数}$ <p>H 为每日应计提的托管费, E 为前一日资产净值(成立首日按当日资产净值计算)。</p> <p>托管人的托管费每日计算, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由托管人根据与管理人核对一致的财务数据, 自动在月初 5 个工作日内、按照</p>

<p>划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若委托财产现金形式资产不足以支付或遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>3、管理人的业绩报酬</p> <p>在本集合计划收益分配基准日、委托人退出日和计划终止日，管理人将根据委托人相应份额的期间年化收益率（R），对期间年化收益率超过20%（仅供核算可计提的业绩报酬之用，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任何承诺）的部分按照15%的比例收取业绩报酬，本集合计划的业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，在委托人退出日、终止日根据合同约定提取业绩报酬的，不受上述提取频率的限制。</p> <p>（1）业绩报酬计提原则</p> <p>①按委托人每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p>②在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划收益分配基准日、委托人退出日和计划终止日计提业绩报酬。为免歧义，收益分配基准日、集合计划终止日，对全部份额计提；份额退出日，对退出的份额计提。</p> <p>③集合计划收益分配基准日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且当次业绩报酬计提总额不超过该次收益分配总额。在委托人退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。</p> <p>④在委托人退出或计划终止时，业绩报酬按委托人退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余部分不受影响。</p> <p>（2）业绩报酬计提方法</p> <p>业绩报酬计提日为本集合计划收益分配基准日、委托人退出日和计划终止日。每次业绩报酬的计提期间，以该笔参与份额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”，如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则募集期参与的为本计划成立日，存续期参与的为份额参与确认日，下同）至本次业绩报酬计提日的期间为准。委托人退出时，按照“先进先出”法确定退出的参与份额，分别计算每一笔参与份额应收的管理人业绩报酬。</p> <p>①期间年化收益率计算</p> <p>期间年化收益率$R = [(P1 - P0) / P0x] \times (365 \div T)$</p> <p>P1=委托人本次业绩报酬计提日的份额累计净值</p> <p>P0 =委托人上一个业绩报酬计提日的份额累计净值</p>	<p>指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若委托财产现金形式资产不足以支付或遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>3、管理人的业绩报酬</p> <p>无。</p> <p>4、证券交易费用：</p> <p>集合计划运作期间投资所发生的经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、证券投资基金认/申购费和赎回费、佣金、因投资港股通股票而产生的各项合理费用等有关税费，作为交易成本按实际发生金额直接扣除。</p> <p>5、与本集合计划存续期相关的费用：</p> <p>本集合计划存续期间发生的信息披露费用、与委托财产投资运作相关的或者为维护投资者利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费和财产保全费等合理费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据有关法规及相应协议的规定，依管理人的指令，按费用实际支出金额从集合计划资产中支付，列入集合计划费用。</p> <p>6、其他费用：</p> <p>（1）银行汇划费用：</p> <p>银行汇划费用是指由于资金运用等发生资金划转而由托管行收取的费用。收费标准按照国家有关规定执行。</p> <p>（2）银行结算费用、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、电子合同费，中登服务费等集合计划运营过程中发生的相关费用。</p> <p>a. 银行结算费用，在每日结算完成后一次或按照集合计划管理人和托管人约定的期限计入集合计划费用；</p> <p>b. 开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；</p> <p>c. 与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次计入集合计划费用；</p> <p>d. 如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。</p> <p>……</p>
---	--

<p>$P0x$ =委托人上一个业绩报酬计提日的份额净值</p> <p>T=委托人上一个业绩报酬计提日(不含)到本次业绩报酬计提日(含)的天数</p> <p>②管理人以超额比例的方式提取业绩报酬</p> <p>管理人根据委托人相应份额的期间年化收益率,对期间年化收益率超过20%的部分按照15%的比例收取业绩报酬,具体计算方式如下:</p>		
期间年化 收益率	收取比 例	管理人业绩报酬计 算公式
$R \leq 20\%$	0	$E = 0$
$20\% < R$	15%	$E = N \times P0x \times (R - 20\%) \times 15\% \times (T \div 365)$

E =该笔参与对应的管理人业绩报酬

N = 委托人该笔参与在上一个业绩报酬计提日的份
额数

③将所有参与笔数的管理人业绩报酬加总,得到总的管理人业绩报酬 (ΣE)。

$\Sigma E=E1+E2+E3+.+En$

其中的 n 为所对应的参与笔数。

④因涉及注册登记数据,业绩报酬由注册登记机构(即资产管理人)根据本合同约定的方式计算和复核。在计提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,托管人不承担复核义务。

(3) 业绩报酬支付

业绩报酬由管理人在计提日后向托管人发送业绩报酬计提金额的指令,托管人在 3 个工作日内从委托财产中进行支付并在支付当日通知管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期自动顺延。管理人业绩报酬收取账户与管理费收取账户相同。

本合同约定的业绩报酬计提基准(如有)仅供投资者参考,不构成管理人保证委托财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

4、证券交易费用:

集合计划运作期间投资所发生的经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、证券投资基金认/申购费和赎回费、佣金、因投资港股通股票而产生的各项合理费用等有关税费,作为交易成本按实际发生金额直接扣除。

5、与本集合计划存续期相关的费用:

本集合计划存续期间发生的信息披露费用、与委托财产投资运作相关的或者为维护投资者利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费和财产保全费等合理费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等,由托管人根据有关法规及相应协议的规定,依管理人的指令,

<p>按费用实际支出金额从集合计划资产中支付，列入集合计划费用，在每个自然日内按照直线法均匀摊销。</p> <p>6、其他费用：</p> <p>（1）银行汇划费用：</p> <p>银行汇划费用是指由于资金运用等发生资金划转而由托管行收取的费用。收费标准按照国家有关规定执行。</p> <p>（2）银行结算费用、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、电子合同费，中登服务费等集合计划运营过程中发生的相关费用。</p> <p>a. 银行结算费用，在每日结算完成后一次或按照集合计划管理人和托管人约定的期限计入集合计划费用；</p> <p>b. 开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；</p> <p>c. 与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；</p> <p>d. 如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。</p> <p>… …</p>	
<p style="text-align: center;">第二十一节 集合计划的收益分配</p>	<p style="text-align: center;">第二十一节 集合计划的收益分配</p>
<p>… …</p> <p>（三）收益分配原则</p> <p>1、本集合计划每一份额享有同等的分配权；</p> <p>2、若自本集合计划成立之日起至年末不满 3 个月则该年度不进行收益分配；</p> <p>3、集合计划收益分配后，分红权益基准日的单位净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>4、自本集合计划成立之日起每年分配不超过【2】次；</p> <p>5、法律、法规或中国证监会等监管机构另有规定的从其规定。</p> <p>（三）收益分配方案的确定与通知</p> <p>本集合计划的收益分配方案由管理人拟定，由托管人复核计算无误后确定，在方案确定后 5 个工作日内在管理人网站进行公告，并在方案公告后的 5 个工作日内实施。</p> <p>（四）收益分配的执行方式</p> <p>投资者可以选择收益分配方式为现金或再投资于本集合计划，未做选择的默认是现金分红。投资者可以修改分红方式。选择采取红利再投资方式的，分红资金按分红除权后的份额净值转成相应的集合计划份额（红利再投资不受本计划份额上限的限制）；选择现金方式的，管理人将分红款划入销售机构结算备付金账户，再由销售机构划入份额持有人指定资金账户。</p>	<p>… …</p> <p>（三）收益分配原则</p> <p>1、本集合计划每一份额享有同等的分配权；</p> <p>2、若自本集合计划成立之日起至年末不满 3 个月则该年度不进行收益分配；</p> <p>3、集合计划收益分配后，收益分配基准日的单位净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>4、自本集合计划成立之日起每年分配不超过【2】次；</p> <p>5、法律、法规或中国证监会等监管机构另有规定的从其规定。</p> <p>（三）收益分配方案的确定与通知</p> <p>本集合计划的收益分配方案由管理人拟定，由托管人复核计算无误后确定，在方案确定后 5 个工作日内在管理人网站进行公告，并在方案公告后的 5 个工作日内实施。</p> <p>（四）收益分配的执行方式</p> <p>投资者可以选择收益分配方式为现金或再投资于本集合计划，未做选择的默认是现金分红。投资者可以修改分红方式。选择采取红利再投资方式的，分红资金按分红除权后的份额净值转成相应的集合计划份额（红利再投资不受本计划份额上限的限制）；选择现金方式的，管理人将分红款划入销售机构结算备付金账户，再由销售机</p>

	<p>构划入份额持有人指定资金账户。</p> <p>特别提示投资者知悉及确认：管理人根据本计划管理运作情况自主确定是否进行收益分配以及每次收益分配的金额，即使本计划有可供分配利润，但并不必然进行收益分配或将全部可供分配利润进行分配。</p>
第二十二节 集合计划的信息披露与报告	第二十二节 集合计划的信息披露与报告
<p>(一) 净值报告</p> <p>本集合计划封闭期内至少每周披露一次经托管人复核的份额净值。开放期内，管理人应当在【T+1】日披露集合计划 T 日的经托管人复核的份额净值。管理人将通过网站公告、信函、传真、电子邮件、手机短信等本合同约定的方式之一将净值情况告知份额持有人。由于不可抗力原因、或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更，或其他非管理人及托管人的主观意愿原因，未能按上述时点披露复核后份额净值的，管理人和托管人不承担赔偿责任，但应在情况消除后尽快向份额持有人披露复核后的份额净值。</p> <p>....</p> <p>(三) 临时报告</p> <p>集合计划存续期间，发生以下情形的，对集合计划持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响时，除本合同另有明确约定的以外，管理人应在情形发生之日起 5 日内通过管理人网站公告方式披露：</p> <p>1、 涉及集合计划重大诉讼、仲裁、财产纠纷的，以及出现延期兑付、负面舆论、群体性事件等重大风险事件的；</p> <p>....</p>	<p>(一) 净值报告</p> <p>本集合计划封闭期内至少每周披露一次经托管人复核的份额净值。开放期内，管理人应当在【T+1】日内披露集合计划 T 日的经托管人复核的份额净值。管理人将通过网站公告、信函、传真、电子邮件、手机短信等本合同约定的方式之一将净值情况告知份额持有人。由于不可抗力原因、或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更，或其他非管理人及托管人的主观意愿原因，未能按上述时点披露复核后份额净值的，管理人和托管人不承担赔偿责任，但应在情况消除后尽快向份额持有人披露复核后的份额净值。</p> <p>....</p> <p>(三) 临时报告</p> <p>集合计划存续期间，发生以下情形的，对集合计划持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响时，除本合同另有明确约定的以外，管理人应在情形发生之日起 5 日内通过管理人网站公告方式披露：</p> <p>1、 涉及集合计划重大诉讼、仲裁、财产纠纷的，以及出现延期兑付、投资标的的重大违约等重大风险事件的；</p> <p>....</p>
第二十三节 风险揭示	第二十三节 风险揭示
<p>(一) 一般风险</p> <p>....</p> <p>14、参与、退出风险</p> <p>【本集合计划在每周一、三、五开放（遇非工作日则顺延至下一工作日），受理投资者的参与、退出申请。】在封闭期内，投资者面临不能退出的风险。若投资者错过某一开放期而未能退出，至下一开放期方可退出。本集合计划在集合合同约定的特定情形下可能发生拒绝或暂停参与及/或退出的情形，投资者面临不能参与及/或不能退出的风险。</p> <p>....</p> <p>(二) 特定风险</p> <p>....</p> <p>6、混合类产品的特定风险</p> <p>本产品属于混合类产品，投资于债权类资产（活期存款除外）的比例低于资产管理计划总资产 80%；投资于权益类资产占资产管理计划总资产的比例为</p>	<p>(一) 一般风险</p> <p>....</p> <p>14、参与、退出风险</p> <p>【本集合计划在每周一、三、五开放（遇非工作日则顺延至下一工作日，下一个工作日也为开放日的则合并且不再顺延），受理投资者的参与、退出申请。】在封闭期内，投资者面临不能退出的风险。若投资者错过某一开放期而未能退出，至下一开放期方可退出。本集合计划在集合合同约定的特定情形下可能发生拒绝或暂停参与及/或退出的情形，投资者面临不能参与及/或不能退出的风险。</p> <p>....</p> <p>(二) 特定风险</p> <p>....</p> <p>6、混合类产品的特定风险</p> <p>本产品属于混合类产品，投资于债权类资产（活期存款除外）的比例低于资产管理计划总资产</p>

<p>30%-100%，当本计划投资于健康生活主题类权益类资产的比例不低于权益类资产的 80%时，本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%。集合计划面临投资于债权类、权益类资产的一般风险和特殊风险，且将随着各类资产配置比例的变化而变化，在某类资产占比更大时，本计划的风险将更多受该类资产影响。</p> <p>7、本计划投资权益类资产可超过 80%的特殊风险</p> <p>投资者知悉并认可，虽然本计划为混合类产品，但特定情况下本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%。由于本计划是主题型混合类产品，本计划投资于健康生活主题类权益类资产的比例可以（但非必须）不低于权益类资产的 80%，当本计划投资于健康生活主题类权益类资产的比例不低于权益类资产的 80%时，本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%。在权益类资产占比更大时，本计划的风险将更多受权益类资产影响。管理人对于本计划采取上述主题策略，投资权益类资产高于计划总资产 80%所产生的风险不承担责任。</p> <p>8、特定主题策略（健康生活主题）的风险</p> <p>本计划的主要投资标的为股票类资产，股票资产主要集中在健康生活行业，股票的价格因受健康生活产业政策、经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，且受相关健康生活产业上市公司走势影响较大，具有一定的主题投资风险。此外，所投资上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如果经营决策重大失误、高级管理人员变更、重大诉讼等都可能引起该公司证券价格的波动，或者引起该公司盈利减少，使用于分配的利润减少，从而使本计划的投资收益下降。</p> <p>....</p>	<p>产 80%；投资于权益类资产占资产管理计划总资产的比例为 30%-100%，当本计划投资于本合同约定的核心资产主题类权益类资产的比例不低于权益类资产的 80%时，本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%。集合计划面临投资于债权类、权益类资产的一般风险和特殊风险，且将随着各类资产配置比例的变化而变化，在某类资产占比更大时，本计划的风险将更多受该类资产影响。</p> <p>投资者知悉并认可，虽然本计划为混合类产品，但特定情况下本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%。由于本计划是主题型混合类产品，本计划投资于本合同约定的核心资产主题类权益类资产的比例可以（但非必须）不低于权益类资产的 80%，当本计划投资于本合同约定的核心资产主题类权益类资产的比例不低于权益类资产的 80%时，本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%。在权益类资产占比更大时，本计划的风险将更多受权益类资产影响。管理人对于本计划采取上述主题策略，投资权益类资产高于计划总资产 80%所产生的风险不承担责任。</p> <p>7、特定主题策略（核心资产主题）的风险</p> <p>本计划的主要投资标的为股票类资产，股票资产主要集中在本合同约定的核心资产领域，股票的价格因受产业政策、经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，且受相关本合同约定的核心资产产业上市公司走势影响较大，具有一定的主题投资风险。此外，所投资上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如果经营决策重大失误、高级管理人员变更、重大诉讼等都可能引起该公司证券价格的波动，或者引起该公司盈利减少，使用于分配的利润减少，从而使本计划的投资收益下降。</p> <p>本计划主题的认定以管理人内部标准为准，并非客观或第三方标准，且对于本合同列示行业之外的其他行业，如对经济高质量增长具有积极作用，符合管理人内部标准判断认为构成核心资产的投资主题，本计划也将对这些行业的公司进行布局。即本合同所列示的行业并非穷举式的列举，本计划不一定投资或仅投资于所列行业。</p> <p>本计划将对核心资产主题相关的上市公司和</p>
---	--

	<p>行业发展进行密切跟踪，随着市场环境、相关政策等因素的不断变化，管理人根据内部标准认定的核心资产主题的上市公司或行业的范围也会相应改变。如管理人调整该等标准的导致具体资产被纳入或调出本计划主题标的库的，不构成对本合同的变更。</p> <p>本计划采用的主题策略并不必然有效或取得优异或优于其他主题的业绩表现，本计划的投资可能发生亏损，管理人不对本计划收益或本金不受损失作出任何承诺或保证。</p> <p>... ..</p>
第二十八节 其他事项	第二十八节 其他事项
<p>（五）反商业贿赂</p> <p>... ..</p> <p>如投资者/托管人在协议谈判、订立和履行过程中知悉管理人任何已发生或即将发生的上述商业贿赂或利益输送行为，请立即通知管理人，举报投诉邮箱为：CICC_WHISTLEBLOW@cicc.com.cn。</p>	<p>（五）反商业贿赂</p> <p>... ..</p> <p>如投资者/托管人在协议谈判、订立和履行过程中知悉管理人任何已发生或即将发生的上述商业贿赂或利益输送行为，请立即通知管理人，举报投诉邮箱为：zj_xfjb@cicc.com.cn。</p>

附件 3:《中金启明星健康集合资产管理计划风险揭示书》变更明细表:

变更前	变更后
二、风险揭示	
<p>(一) 特定风险</p> <p>...</p> <p>6、混合类产品的特定风险</p> <p>本产品属于混合类产品,投资于债权类资产(活期存款除外)的比例低于资产管理计划总资产 80%;投资于权益类资产占资产管理计划总资产的比例为 30%-100%,当本计划投资于健康生活主题类权益类资产的比例不低于权益类资产的 80%时,本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%。集合计划面临投资于债权类、权益类资产的一般风险和特殊风险,且将随着各类资产配置比例的变化而变化,在某类资产占比更大时,本计划的风险将更多受该类资产影响。</p> <p>7、本计划投资权益类资产可超过 80%的特殊风险</p> <p>投资者知悉并认可,虽然本计划为混合类产品,但特定情况下本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%。由于本计划是主题型混合类产品,本计划投资于健康生活主题类权益类资产的比例可以(但非必须)不低于权益类资产的 80%,当本计划投资于健康生活主题类权益类资产的比例不低于权益类资产的 80%时,本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%。在权益类资产占比更大时,本计划的风险将更多受权益类资产影响。管理人对于本计划采取上述主题策略,投资权益类资产高于计划总资产 80%所产生的风险不承担责任。</p> <p>8、特定主题策略(健康生活主题)的风险</p> <p>本计划的主要投资标的为股票类资产,股票资产主要集中在健康生活行业,股票的价格因受健康生活产业政策、经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动,导致收益水平变化,且受相关健康生活产业上市公司走势影响较大,具有一定的主题投资风险。此外,所投资上市公司的经营状况受多种因素影响,如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如果经营决策重大失误、高级管理人员变更、重大诉讼等都可能引起该公司证券价格的波动,或者引起该公司盈利减少,使用于分配的利润减少,从而使本计划的投资收益下降。</p> <p>(二) 一般风险</p> <p>...</p> <p>14、参与、退出风险</p> <p>【本集合计划在每周一、三、五开放(遇非工作日则</p>	<p>(一) 特定风险</p> <p>...</p> <p>6、混合类产品的特定风险</p> <p>本产品属于混合类产品,投资于债权类资产(活期存款除外)的比例低于资产管理计划总资产 80%;投资于权益类资产占资产管理计划总资产的比例为 30%-100%,当本计划投资于本合同约定的核心资产主题类权益类资产的比例不低于权益类资产的 80%时,本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%。集合计划面临投资于债权类、权益类资产的一般风险和特殊风险,且将随着各类资产配置比例的变化而变化,在某类资产占比更大时,本计划的风险将更多受该类资产影响。</p> <p>投资者知悉并认可,虽然本计划为混合类产品,但特定情况下本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%。由于本计划是主题型混合类产品,本计划投资于本合同约定的核心资产主题类权益类资产的比例可以(但非必须)不低于权益类资产的 80%,当本计划投资于本合同约定的核心资产主题类权益类资产的比例不低于权益类资产的 80%时,本计划投资权益类资产的比例可以高于计划总资产的 80%。在权益类资产占比更大时,本计划的风险将更多受权益类资产影响。管理人对于本计划采取上述主题策略,投资权益类资产高于计划总资产 80%所产生的风险不承担责任。</p> <p>7、特定主题策略(核心资产主题)的风险</p> <p>本计划的主要投资标的为股票类资产,股票资产主要集中在本合同约定的核心资产领域,股票的价格因受产业政策、经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动,导致收益水平变化,且受相关本合同约定的核心资产产业上市公司走势影响较大,具有一定的主题投资风险。此外,所投资上市公司的经营状况受多种因素影响,如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如果经营决策重大失误、高级管理人员变更、重大诉讼等都可能引起该公司证券价格的波动,或者引起该公司盈利减</p>

<p>顺延至下一工作日), 受理投资者的参与、退出申请。】在封闭期内, 投资者面临不能退出的风险。若投资者错过某一开放期而未能退出, 至下一开放期方可退出。本集合计划在集合合同约定的特定情形下可能发生拒绝或暂停参与及/或退出的情形, 投资者面临不能参与及/或不能退出的风险。</p> <p>...</p>	<p>少, 使用于分配的利润减少, 从而使本计划的投资收益下降。</p> <p>本计划主题的认定以管理人内部标准为准, 并非客观或第三方标准, 且对于本合同列示行业之外的其他行业, 如对经济高质量增长具有积极作用, 符合管理人内部标准判断认为构成核心资产的投资主题, 本计划也将对这些行业的公司进行布局。即本合同所列示的行业并非穷举式的列举, 本计划不一定投资或仅投资于所列行业。</p> <p>本计划将对核心资产主题相关的上市公司和行业发展进行密切跟踪, 随着市场环境、相关政策等因素的不断变化, 管理人根据内部标准认定的核心资产主题的上市公司或行业的范围也会相应改变。如管理人调整该等标准的导致具体资产被纳入或调出本计划主题标的库的, 不构成对本合同的变更。</p> <p>本计划采用的主题策略并不必然有效或取得优异或优于其他主题的业绩表现, 本计划的投资可能发生亏损, 管理人不对本计划收益或本金不受损失作出任何承诺或保证。</p> <p>(二) 一般风险</p> <p>...</p> <p>14、参与、退出风险</p> <p>【本集合计划在每周一、三、五开放(遇非工作日则顺延至下一工作日, 下一个工作日也为开放日的则合并且不再顺延), 受理投资者的参与、退出申请。】在封闭期内, 投资者面临不能退出的风险。若投资者错过某一开放期而未能退出, 至下一开放期方可退出。本集合计划在集合合同约定的特定情形下可能发生拒绝或暂停参与及/或退出的情形, 投资者面临不能参与及/或不能退出的风险。</p> <p>...</p>
--	---

附件 4:《中金启明星健康集合资产管理计划说明书》变更明细表:

变更前	变更后
名称	
中金启明星健康集合资产管理计划（以下简称“本计划”或“本集合计划”）	中金启明星核心资产集合资产管理计划（以下简称“本计划”或“本集合计划”）
投资策略	
<p>...</p> <p>3、投资管理的方法和标准</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>（1）主题挖掘</p> <p>随着我国经济社会持续快速发展，人民生活需要日趋多样化、多方面、多层次，人民对于健康生活的需求逐步提高，健康生活主题相关产业和公司有望在未来获得快速发展。</p> <p>在此背景下，本计划主要投资于健康生活主题相关的优质企业。具体来说，本计划界定的健康生活主题包括以下两个维度：</p> <p>一是与人类生命健康直接相关的产业和公司，具体是指从事医疗相关产品或服务研发、生产与销售的公司。包括：从事化学制药行业、中药行业、生物制品行业、医药商业行业、医疗器械行业和医疗服务行业等传统医药领域的上市公司；以及医疗信息化、移动医疗、医药电商以及相关新兴医疗领域的上市公司。</p> <p>二是有利于满足或改善人民身心健康需求的产业和公司。具体包括以下两类公司：（1）符合居民衣食住行和基本的保养保健需求的行业，包括纺织服装、餐饮旅游、食品饮料、房地产、家电、交运、汽车、商贸、个人护理等；（2）能够提高居民生活质量、丰富居民精神生活的行业，包括高端中药、品牌 OTC、家用医疗器械、教育、体育、休闲娱乐、金融服务、绿色消费（新能源汽车、绿色家居等）、时尚消费（医美、化妆品、珠宝等）、消费电子等。</p> <p>此外，对于以上行业之外的其他行业，如对提升居民健康生活水平具有积极作用，符合健康生活的投资主题，本计划也将对这些行业的公司进行布局。</p> <p>本计划将对健康生活主题相关的上市公司发展进行密切跟踪，随着市场环境、相关政策等因素的不断变化，健康生活主题的上市公司的范围也会相应改变。计划管理人将在履行适当程序后，可根据实际情况调整相关主题和投资范围的界定。</p> <p>...</p>	<p>...</p> <p>3、投资管理的方法和标准</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>（1）主题挖掘</p> <p>本计划所指的核心资产是指根据管理人的内部标准判断，管理人认为能够适应中国经济从高速增长向高质量增长的新形势，各个方面都具备明显优势并在行业当中有一定影响力的优质公司。本计划所指的权益核心资产一般集中在以下行业，这些行业通常具有相对的行业领先地位、高市场占有率、稳定盈利能力或长期成长潜力，并与国民经济支柱产业紧密相关：</p> <p>1）金融行业，包括但不限于以高股息和稳健经营为特征的国有大行及零售银行龙头、受益于长期增长和资产配置需求的综合金融巨头和受益于资本市场改革的券商；</p> <p>2）消费行业，包括但不限于具备品牌护城河和抗周期特性的白酒与食品饮料行业、受益于消费升级和全球化布局的家电与免税领域；</p> <p>3）科技与高端制造行业，包括但不限于代表国产替代和科技自主方向的半导体与硬件、主导全球动力电池和新能源汽车产业链以及支撑数字经济基础设施的通信与 5G；</p> <p>4）医药与医疗行业，包括但不限于受益于老龄化和医药创新的创新药与 CXO、国产替代加速的医疗器械；</p> <p>5）能源与基建行业，包括但不限于保障国家能源安全的传统能源、现金流稳定的电力与公用事业以及受益于基建投资的基建与工程机械；</p> <p>6）国防军工与战略产业，包括但不限于涉及国家安全和高端装备的军工行业和支撑制造业升级的稀土与材料。</p> <p>*特别提示投资者知悉并认可：</p> <p>对于以上行业之外的其他行业，如对经济高质量增长具有积极作用，符合管理人内部标准判断认为构成核心资产的投资主题，本计划</p>

	<p>也将对这些行业的公司进行布局。即上述行业并非穷举式的列举，本计划不一定投资或仅投资于上述所列行业。</p> <p>本计划将对核心资产主题相关的上市公司和行业发展进行密切跟踪，随着市场环境、相关政策等因素的不断变化，管理人根据内部标准认定的核心资产主题的上市公司或行业的范围也会相应改变。如管理人调整该等标准的导致具体资产被纳入或调出本计划主题标的库的，不构成对本合同的变更。</p> <p>...</p>
<p style="text-align: center;">投资风险</p>	
<p>投资本计划存在一般风险，包括参与资金本金损失风险、市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、募集失败风险、投资标的风险、税收风险、关联交易风险、操作或技术风险、监管政策风险、适当性管理相关风险、估值风险、参与退出风险、预警线和平仓线风控措施的风险、集合合同提前终止风险、集合合同变更风险、资金前端控制风险、临时开放期风险、发生不可抗力事件的风险等。此外，投资本计划存在特定风险，包括《管理合同》与基金业协会合同指引不一致的风险、本计划委托募集所涉风险、集合计划外包事项所涉风险（如有）、本计划份额转让所涉风险、本计划未在基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险、混合类产品的特定风险、本计划投资权益类资产可超过 80% 的特殊风险、特定主题策略（健康生活主题）的风险、特定投资方法及特定投资对象风险可能引起的特定风险等及其他风险。具体请见本计划《风险揭示书》。</p>	<p>投资本计划存在一般风险，包括参与资金本金损失风险、市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、募集失败风险、投资标的风险、中小企业经营风险、股价大幅波动风险、企业退市风险、流动性风险、监管规则变化的风险、税收风险、关联交易风险、操作或技术风险、监管政策风险、适当性管理相关风险、估值风险、参与、退出风险、预警线和平仓线风控措施的风险、集合合同提前终止风险、集合合同变更及展期风险、临时开放期风险、发生不可抗力事件的风险、集合合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险、资产管理计划委托募集所涉风险、集合计划外包事项所涉风险（如有）、资产管理计划份额转让所涉风险、集合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、混合类产品的特定风险、特定主题策略（核心资产主题）的风险等其他风险。此外，投资本计划存在特定风险，包括等。具体请见本计划《风险揭示书》。</p>
<p style="text-align: center;">收益分配</p>	
<p>集合计划收益分配是指按规定将集合计划可供分配收益按集合计划份额进行比例分配。</p> <p>（一）资产管理计划利润的构成</p> <p>本资产管理计划利润指利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；资产管理计划已实现收益指资产管理计划利润减去公允价值变动损益后的余额。</p> <p>（二）资产管理计划可供分配利润</p> <p>本资产管理计划可供分配利润指截至收益分配基准日资产管理计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。</p> <p>（三）收益分配原则</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、本集合计划每一份额享有同等的分配权； 2、若自本集合计划成立之日起至年末不满 3 个月则该年度不进行收益分配； 3、集合计划收益分配后，分红权益基准日的单位净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值； 4、自本集合计划成立之日起每年分配不超过【2】次； 5、法律、法规或中国证监会等监管机构另有规定的从其规定。 <p>（三）收益分配方案的确定与通知</p> <p>本集合计划的收益分配方案由管理人拟定，由托管人复核计算无误后确定，在方案确定后 5 个工作日</p>	<p>集合计划收益分配是指按规定将集合计划可供分配收益按集合计划份额进行比例分配。</p> <p>（一）资产管理计划利润的构成</p> <p>本资产管理计划利润指利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额；资产管理计划已实现收益指资产管理计划利润减去公允价值变动损益后的余额。</p> <p>（二）资产管理计划可供分配利润</p> <p>本资产管理计划可供分配利润指截至收益分配基准日资产管理计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。</p> <p>（三）收益分配原则</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、本集合计划每一份额享有同等的分配权； 2、若自本集合计划成立之日起至年末不满 3 个月则该年度不进行收益分配； 3、集合计划收益分配后，收益分配基准日的单位净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于面值； 4、自本集合计划成立之日起每年分配不超过【2】次； 5、法律、法规或中国证监会等监管机构另有规定的从其规定。 <p>（三）收益分配方案的确定与通知</p> <p>本集合计划的收益分配方案由管理人拟定，由托管人复核计算无误后确定，在方案确定后 5 个工</p>

<p>内在管理人网站进行公告，并在方案公告后的 5 个工作日内实施。</p> <p>(四) 收益分配的执行方式</p> <p>投资者可以选择收益分配方式为现金或再投资于本集合计划，未做选择的默认是现金分红。投资者可以修改分红方式。选择采取红利再投资方式的，分红资金按分红除权后的份额净值转成相应的集合计划份额（红利再投资不受本计划份额上限的限制）；选择现金方式的，管理人将分红款划入销售机构结算备付金账户，再由销售机构划入份额持有人指定资金账户。</p>	<p>作日内在管理人网站进行公告，并在方案公告后的 5 个工作日内实施。</p> <p>(四) 收益分配的执行方式</p> <p>投资者可以选择收益分配方式为现金或再投资于本集合计划，未做选择的默认是现金分红。投资者可以修改分红方式。选择采取红利再投资方式的，分红资金按分红除权后的份额净值转成相应的集合计划份额（红利再投资不受本计划份额上限的限制）；选择现金方式的，管理人将分红款划入销售机构结算备付金账户，再由销售机构划入份额持有人指定资金账户。</p> <p>特别提示投资者知悉及确认：管理人根据本计划管理运作情况自主确定是否进行收益分配以及每次收益分配的金额，即使本计划有可供分配利润，但并不必然进行收益分配或将全部可供分配利润进行分配。</p>
<p>管理人、托管人报酬以及与资产管理计划财产管理、运用有关的其他费用的计提标准和计提方式</p>	
<p>(一) 费用的种类</p> <p>从集合计划财产中支付的费用种类如下：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理费； 2、托管费； 3、外包服务费（如有）； 4、业绩报酬； 5、投资顾问费（如有） 6、集合计划财产开立账户需要支付的费用、资金结算汇划费（含赎回划款手续费）、账户管理与维护费、网银开户相关费用等； 7、集合计划财产的证券、期货交易费用、开户费用（包括但不限于本集合计划所有金融工具的交易费、工商登记及变更费用（如有）、经手费、印花税、过户费、手续费、经纪商佣金等类似性质的费用）； 8、注册登记费、电子合同费（如有）； 9、本集合计划存续期间发生的信息披露费用、与委托财产投资运作相关的或者为维护投资者利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费和财产保全费等合理费用； 10、按照国家有关规定和本合同约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。 <p>(二) 费率、费率的调整、计提方法、计提标准、计提方式和支付方式</p> <p>1、管理费</p> <p>管理费按前一日集合计划资产净值的----0.1%的年费率计提。计算方法如下：</p> $H=E \times \text{----}0.1\% \div \text{当年实际天数}$ <p>H 为每日应计提的管理费，E 为前一日资产净值（成立首日按当日资产净值计算）。</p> <p>管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若委托财产现金形式资产不足以支付或遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>管理人可以在法律法规、本合同约定的范围内调低管理费，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前在管理人网站公告。</p> <p>管理费收款账户如下</p>	<p>(一) 费用的种类</p> <p>从集合计划财产中支付的费用种类如下：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理费； 2、托管费； 3、外包服务费（如有）； 4、业绩报酬； 5、投资顾问费（如有） 6、集合计划财产开立账户需要支付的费用、资金结算汇划费（含赎回划款手续费）、账户管理与维护费、网银开户相关费用等； 7、集合计划财产的证券、期货交易费用、开户费用（包括但不限于本集合计划所有金融工具的交易费、工商登记及变更费用（如有）、经手费、印花税、过户费、手续费、经纪商佣金等类似性质的费用）； 8、注册登记费、电子合同费（如有）； 9、本集合计划存续期间发生的信息披露费用、与委托财产投资运作相关的或者为维护投资者利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费和财产保全费等合理费用； 10、按照国家有关规定和本合同约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。 <p>(二) 费率、费率的调整、计提方法、计提标准、计提方式和支付方式</p> <p>1、管理费</p> <p>管理费按前一日集合计划资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法如下：</p> $H=E \times 0.2\% \div \text{当年实际天数}$ <p>H 为每日应计提的管理费，E 为前一日资产净值（成立首日按当日资产净值计算）。</p> <p>管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若委托财产现金形式资产不足以支付或遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>管理人可以在法律法规、本合同约定的范围内调低管理费，并最迟应于新的费率或收</p>

<p>收款人：中国国际金融股份有限公司 账号：11001085100056000400 开户行：中国建设银行北京市国贸支行 管理人如需要变更此账户，应提前5个工作日向托管人出具书面的收款账户变更通知。</p> <p>2、托管费</p> <p>托管费按前一日集合计划资产净值的----0.02%的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times \text{---}0.02\% \div \text{当年实际天数}$ H为每日应计提的托管费，E为前一日资产净值（成立首日按当日资产净值计算）。</p> <p>托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若委托财产现金形式资产不足以支付或遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>3、管理人的业绩报酬</p> <p>在本集合计划收益分配基准日、委托人退出日和计划终止日，管理人将根据委托人相应份额的期间年化收益率（R），对期间年化收益率超过20%（仅供核算可计提的业绩报酬之用，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任何承诺）的部分按照15%的比例收取业绩报酬，本集合计划的业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，在委托人退出日、终止日根据合同约定提取业绩报酬的，不受上述提取频率的限制。</p> <p>（1）业绩报酬计提原则</p> <p>①按委托人每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p>②在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划收益分配基准日、委托人退出日和计划终止日计提业绩报酬。为免歧义，收益分配基准日、集合计划终止日，对全部份额计提；份额退出日，对退出的份额计提。</p> <p>③集合计划收益分配基准日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且当次业绩报酬计提总额不超过该次收益分配总额。在委托人退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。</p> <p>④在委托人退出或计划终止时，业绩报酬按委托人退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余部分不受影响。</p> <p>（2）业绩报酬计提方法</p> <p>业绩报酬计提日为本集合计划收益分配基准日、委托人退出日和计划终止日。每次业绩报酬的计提期间，以该笔参与份额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”，如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则募集期参与的为本计划成立日，存续期参与的为份额参与确认日，下同）至本次业绩报酬计提日的期间为准。委托人退出时，按照“先进先出”法确定退出的参与份额，分别计算每一笔参与份额应收的管理人业绩报酬。</p> <p>①期间年化收益率计算</p> $\text{期间年化收益率} R = [(P1 - P0) / P0x] \times (365 \div T)$	<p>费方式实施日前在管理人网站公告。</p> <p>管理费收款账户如下 收款人：中国国际金融股份有限公司 账号：11001085100056000400 开户行：中国建设银行北京市国贸支行 管理人如需要变更此账户，应提前5个工作日向托管人出具书面的收款账户变更通知。</p> <p>2、托管费</p> <p>托管费按前一日集合计划资产净值的-0.02%的年费率计提。计算方法如下： $H=E \times \text{---}0.02\% \div \text{当年实际天数}$ H为每日应计提的托管费，E为前一日资产净值（成立首日按当日资产净值计算）。</p> <p>托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决，若委托财产现金形式资产不足以支付或遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>3、管理人的业绩报酬</p> <p>无。</p> <p>4、证券交易费用：</p> <p>集合计划运作期间投资所发生的经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、证券投资基金认/申购费和赎回费、佣金、因投资港股通股票而产生的各项合理费用等有关税费，作为交易成本按实际发生金额直接扣除。</p> <p>5、与本集合计划存续期相关的费用：</p> <p>本集合计划存续期间发生的信息披露费用、与委托财产投资运作相关的或者为维护投资者利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费和财产保全费等合理费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据有关法规及相应协议的规定，依管理人的指令，按费用实际支出金额从集合计划资产中支付，列入集合计划费用。</p> <p>6、其他费用：</p> <p>（1）银行汇划费用：</p> <p>银行汇划费用是指由于资金运用等发生资金划转而由托管行收取的费用。收费标准按照国家有关规定执行。</p> <p>（2）银行结算费用、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、电子合同费，中登服务费等集合计划运营过程中发生的相关费用。</p> <p>a. 银行结算费用，在每日结算完成后一次或按照集合计划管理人和托管人约定的期限计入集合计划费用；</p> <p>b. 开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；</p> <p>c. 与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次计入集合计划费用；</p> <p>d. 如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。</p> <p>（三）不列入集合计划费用的项目</p>
--	---

<p>P1=委托人本次业绩报酬计提日的份额累计净值 P0 =委托人上一个业绩报酬计提日的份额累计净值 P0x =委托人上一个业绩报酬计提日的份额净值 T=委托人上一个业绩报酬计提日 (不含) 到本次业绩报酬计提日 (含) 的天数</p> <p>②管理人以超额比例的方式提取业绩报酬 管理人根据委托人相应份额的期间年化收益率，对期间年化收益率超过20%的部分按照15%的比例收取业绩报酬，具体计算方式如下：</p>			<p>集合计划成立前发生的费用、存续期间发生的与募集有关的费用、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计划费用。其他具体不列入计划费用的项目依据中国证监会有关规定执行。</p> <p>(四) 集合计划的税收： 本集合计划运作过程中，各类纳税主体依照国家法律法规的规定履行纳税义务。 根据相关法律法规的要求，自 2018 年 1 月 1 日或税务主管机关确定的其他日期起，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税义务人。本集合计划运营过程中由于上述原因产生的增值税及附加税费由本集合计划财产承担，托管人应在管理人指定时间内，将应缴税款划转至管理人指定账户，由管理人依据税务部门要求完成税款的申报缴纳。如果管理人以固有财产先行垫付上述增值税等税费的，管理人有权优先从集合计划财产中划扣抵偿。本集合计划清算后若管理人被税务机关要求补缴应由集合计划财产承担的上述税费的，则管理人有权向份额持有人就补缴金额进行追偿。</p>		
期间年化 收益率	收取比 例	管理人业绩报酬 计算公式			
R ≤ 20 %	0	E =0			
20% < R	15%	E = N × P0x × (R-20%) × 15% × (T ÷ 365)			

<p>E=该笔参与对应的管理人业绩报酬 N= 委托人该笔参与在上一个业绩报酬计提日的份额数</p> <p>③将所有参与笔数的管理人业绩报酬加总，得到总的管理人业绩报酬 (ΣE)。 ΣE=E1+E2+E3+.....+En 其中的 n 为所对应的参与笔数。</p> <p>④因涉及注册登记数据，业绩报酬由注册登记机构（即资产管理人）根据本合同约定的方式计算和复核。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，托管人不承担复核义务。</p> <p>(3) 业绩报酬支付 业绩报酬由管理人在计提日后向托管人发送业绩报酬计提金额的指令，托管人在 3 个工作日内从委托财产中进行支付并在支付当日通知管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期自动顺延。管理人业绩报酬收取账户与管理费收取账户相同。</p> <p>本合同约定的业绩报酬计提基准（如有）仅供投资者参考，不构成管理人保证委托财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。</p> <p>4、证券交易费用： 集合计划运作期间投资所发生的经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、证券投资基金认/申购费和赎回费、佣金、因投资港股通股票而产生的各项合理费用等有关税费，作为交易成本按实际发生金额直接扣除。</p> <p>5、与本集合计划存续期相关的费用： 本集合计划存续期间发生的信息披露费用、与委托财产投资运作相关的或者为维护投资者利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费和财产保全费等合理费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据有关法规及相应协议的规定，依管理人的指令，按费用实际支出金额从集合计划资产中支付，列入集合计划费用，在每个自然日内按照直线法均匀摊销。</p> <p>6、其他费用： (1) 银行汇划费用： 银行汇划费用是指由于资金运用等发生资金划转</p>					
---	--	--	--	--	--

<p>而由托管行收取的费用。收费标准按照国家有关规定执行。</p> <p>(2) 银行结算费用、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、电子合同费, 中登服务费等集合计划运营过程中发生的相关费用。</p> <p>a. 银行结算费用, 在每日结算完成后一次或按照集合计划管理人和托管人约定的期限计入集合计划费用;</p> <p>b. 开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用;</p> <p>c. 与集合计划运营有关的其他费用, 如果金额较小, 或者无法对应到相应会计期间, 可以一次进入集合计划费用;</p> <p>d. 如果金额较大, 并且可以对应到相应会计期间, 应在该会计期间内按直线法摊销。</p> <p>(三) 不列入集合计划费用的项目</p> <p>集合计划成立前发生的费用、存续期间发生的与募集有关的费用、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计划费用。其他具体不列入计划费用的项目依据中国证监会有关规定执行。</p> <p>(四) 集合计划的税收:</p> <p>本集合计划运作过程中, 各类纳税主体依照国家法律法规的规定履行纳税义务。</p> <p>根据相关法律法规的要求, 自 2018 年 1 月 1 日或税务主管机关确定的其他日期起, 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。本集合计划运营过程中由于上述原因产生的增值税及附加税费由本集合计划财产承担, 托管人应在管理人指定时间内, 将应缴税款划转至管理人指定账户, 由管理人依据税务部门要求完成税款的申报缴纳。如果管理人以固有财产先行垫付上述增值税等税费的, 管理人有权优先从集合计划财产中划扣抵偿。本集合计划清算后若管理人被税务机关要求补缴应由集合计划财产承担的上述税费的, 则管理人有权向份额持有人就补缴金额进行追偿。</p>	
---	--

份额持有人的重要权利和义务

<p>1、份额持有人的权利</p> <p>(1) 分享集合计划财产收益;</p> <p>(2) 取得分配清算后的剩余集合计划财产;</p> <p>(3) 按照本合同及《说明书》的约定, 参与、退出和转让集合计划份额;</p> <p>(4) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得集合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>(6) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。</p> <p>2、份额持有人的义务</p> <p>(1) 认真阅读并遵守本合同, 保证投资资金的来源及用途合法;</p>	<p>1、份额持有人的权利</p> <p>(1) 分享集合计划财产收益;</p> <p>(2) 取得分配清算后的剩余集合计划财产;</p> <p>(3) 按照本合同及《说明书》的约定, 参与、退出和转让集合计划份额;</p> <p>(4) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得集合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>(6) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。</p> <p>2、份额持有人的义务</p> <p>(1) 认真阅读并遵守本合同, 保证投资资金的来源及用途合法;</p> <p>(2) 保证符合法律、行政法规和监管机构规定的合格投资者的相关标准, 不存在法律、行政法规和监管机构规定禁止或限制参与本集合计划的情形; 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, 及时、全面、准确地向管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制、</p>
--	--

(2) 保证符合法律、行政法规和监管机构规定的合格投资者的相关标准,不存在法律、行政法规和监管机构规定禁止或限制参与本集合计划的情形;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,及时、全面、准确地向管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况,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《投资者承诺书》及其他合格投资者相关文件;前述信息资料如发生任何实质性变更,应当及时书面告知管理人或其销售机构;

(3) 除公募资产管理产品外,以合伙企业、契约等非法形式直接或者间接投资于本集合计划的,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》,主动了解所投资品种的风险收益特征;确认有能力识别、评估并承担投资于本集合计划及其项下投资品种的各项风险,对本集合计划投资品种的交易结构、运作市场、运作规则、相关风险以及该等风险可能引起的后果和损失有充分清晰的认知和理解;

(5) 按照本合同约定支付集合计划份额的参与款项,承担本合同约定的管理费、业绩报酬(如有)、托管费、外包服务费(如有)、投资顾问费(如有)、审计费、税费等合理费用;

(6) 在持有的集合计划份额范围内,承担本集合计划亏损或者终止的有限责任,退还因管理人、托管人、销售机构差错而获得的不当得利;

(7) 以真实身份参与本集合计划,向管理人或本集合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;按照要求签署、提交声明、告知书等相关文件;保证其向管理人或本集合计划销售机构提供的信息和资料真实、完整、准确、合法,不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导,前述信息资料如发生任何实质性变更,应当及时书面告知管理人或其销售机构;投资者应知悉《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,不得实施任何违反前述规定的违法行为;

(8) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为;

(8) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为;

(9) 不得从事任何有损本集合计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托

财产收入情况和风险承受能力等基本情况,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《投资者承诺书》及其他合格投资者相关文件;前述信息资料如发生任何实质性变更,应当及时书面告知管理人或其销售机构;

(3) 除公募资产管理产品外,以合伙企业、契约等非法形式直接或者间接投资于本集合计划的,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》,主动了解所投资品种的风险收益特征;确认有能力识别、评估并承担投资于本集合计划及其项下投资品种的各项风险,对本集合计划投资品种的交易结构、运作市场、运作规则、相关风险以及该等风险可能引起的后果和损失有充分清晰的认知和理解;

(5) 按照本合同约定支付集合计划份额的参与款项,承担本合同约定的管理费、业绩报酬(如有)、托管费、外包服务费(如有)、投资顾问费(如有)、审计费、税费等合理费用;

(6) 在持有的集合计划份额范围内,承担本集合计划亏损或者终止的有限责任,退还因管理人、托管人、销售机构差错而获得的不当得利;

(7) 以真实身份参与本集合计划,向管理人或本集合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;按照要求签署、提交声明、告知书等相关文件;保证其向管理人或本集合计划销售机构提供的信息和资料真实、完整、准确、合法,不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导,前述信息资料如发生任何实质性变更,应当及时书面告知管理人或其销售机构;投资者应知悉《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,不得实施任何违反前述规定的违法行为;

(8) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为;

(9) 不得从事任何有损本集合计划及其投资者、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,不得泄露本集合计划的投资计划、投资意向等;不得利用本集合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) 保证其享有签署包括本合同在内的集合计划相关文件的权利,并就签署行为已履行必要的批准或授权手续,且签署和履行上述文件不会违反任何对其有约束力的法律法规、公司章程、合同约定的;

(12) 保证其所做出的全部声明、保证与承诺在投资本集合计划期间持续有效,如相关情况出现变化需及时告知管理人,管理人有权根据法律法规、监管规定、自律规则做出相关处理,份额持有人将予以配合并承担相关后果和损失;

(13) 不得违规转让其所拥有的集合计划份额;

(14) 如实提供与签署电子签名合同相关的

管的其他资产合法权益的活动;

(10) 保守商业秘密, 不得泄露本集合计划的投资计划、投资意向等; 不得利用本集合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) 保证其享有签署包括本合同在内的集合计划相关文件的权利, 并就签署行为已履行必要的批准或授权手续, 且签署和履行上述文件不会违反任何对其有约束力的法律法规、公司章程、合同协议的约定;

(12) 保证其所做出的全部声明、保证与承诺在投资本集合计划期间持续有效, 如相关情况出现变化需及时告知管理人, 管理人有权根据法律法规、监管规定、自律规则做出相关处理, 份额持有人将予以配合并承担相关后果和损失;

(12) 保证其所做出的全部声明、保证与承诺在投资本集合计划期间持续有效, 如相关情况出现变化需及时告知管理人, 管理人有权根据法律法规、监管规定、自律规则做出相关处理, 份额持有人将予以配合并承担相关后果和损失;

(13) 不得违规转让其所拥有的集合计划份额;

(14) 如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料, 采取有效措施妥善保管与电子签名合同相关的信息和资料, 防止他人以份额持有人名义实施电子签名行为;

(15) 投资者同意管理人根据新股申购的相关监管规定及自律规则向监管机构、自律组织和承销商提供符合要求的投资者和本计划的信息和资料, 且投资者承诺将配合管理人提供上述信息和资料, 并保证该等资料、信息真实、准确、完整、合法, 不存在任何重大遗漏或误导;

(16) 投资者确认其在签署本合同之前已熟悉香港证券市场相关规定, 已对港股通交易的业务规则与流程、知识、交易惯例有了一定的了解, 并已仔细研读且充分理解了港股通投资的特殊风险; 投资者确认其已知悉、理解并同意由中国证券登记结算有限责任公司(“中登公司”)代本计划名义持有通过港股通取得的证券, 对参与港股通交易中涉及的股票持有、资金交收安排予以充分认可且不持任何异议;

(17) 本计划投资于上市公司定向增发股票的, 投资者应配合管理人按照监管机构、交易所、承销商或财务顾问的要求提供包括但不限于如下方面的书面资料、承诺: 投资者和最终投资人(如有)与承销商和发行人的关联关系、资金来源、是否存在杠杆融资结构化设计、是否存在承销商和发行人及其关联方提供财务资助/补偿/承诺收益或其他协议安排、其他需核查的情况。投资者应配合管理人按照监管机构、交易所、承销商或

信息和资料, 采取有效措施妥善保管与电子签名合同相关的信息和资料, 防止他人以份额持有人名义实施电子签名行为;

(15) 投资者同意管理人根据新股申购的相关监管规定及自律规则向监管机构、自律组织和承销商提供符合要求的投资者和本计划的信息和资料, 且投资者承诺将配合管理人提供上述信息和资料, 并保证该等资料、信息真实、准确、完整、合法, 不存在任何重大遗漏或误导;

(16) 投资者确认其在签署本合同之前已熟悉香港证券市场相关规定, 已对港股通交易的业务规则与流程、知识、交易惯例有了一定的了解, 并已仔细研读且充分理解了港股通投资的特殊风险; 投资者确认其已知悉、理解并同意由中国证券登记结算有限责任公司(“中登公司”)代本计划名义持有通过港股通取得的证券, 对参与港股通交易中涉及的股票持有、资金交收安排予以充分认可且不持任何异议;

(17) 本计划投资于上市公司定向增发股票的, 投资者应配合管理人按照监管机构、交易所、承销商或财务顾问的要求提供包括但不限于如下方面的书面资料、承诺: 投资者和最终投资人(如有)与承销商和发行人的关联关系、资金来源、是否存在杠杆融资结构化设计、是否存在承销商和发行人及其关联方提供财务资助/补偿/承诺收益或其他协议安排、其他需核查的情况。投资者应配合管理人按照监管机构、交易所、承销商或财务顾问的要求对包括但不限于上述方面进行核查。投资者承诺, 不通过投资本计划规避与投资上市公司定向增发股票有关的监管规定或自律规则。如因投资者违反上述义务, 导致本计划无法参与定向增发或参与定向增发违反相关法律和监管规定, 相关责任和后果由投资者自行承担, 且投资者应赔偿管理人因此而遭受的损失;

(18) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他义务。

<p>财务顾问的要求对包括但不限于上述方面进行核查。投资者承诺，不通过投资本计划规避与投资上市公司定向增发股票有关的监管规定或自律规则。如因投资者违反上述义务，导致本计划无法参与定向增发或参与定向增发违反相关法律和监管规定，相关责任和后果由投资者自行承担，且投资者应赔偿管理人因此而遭受的损失；</p> <p>(18) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和本合同约定的其他义务。</p>	
<p style="text-align: center;">信息披露的内容、方式和频率</p>	
<p>(一) 净值报告</p> <p>本集合计划封闭期内至少每周披露一次经托管人复核的份额净值。开放期内，管理人应当在【T+1】日披露集合计划 T 日的经托管人复核的份额净值。管理人将通过网站公告、信函、传真、电子邮件、手机短信等本合同约定的方式之一将净值情况告知份额持有人。由于不可抗力原因、或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更，或其他非管理人及托管人的主观意愿原因，未能按上述时点披露复核后份额净值的，管理人和托管人不承担赔偿责任，但应在情况消除后尽快向份额持有人披露复核后的份额净值。</p> <p>...</p> <p>(三) 临时报告</p> <p>...</p> <p>1、涉及集合计划重大诉讼、仲裁、财产纠纷的，以及出现延期兑付、负面舆论、群体性事件等重大风险事件的；</p> <p>...</p>	<p>(一) 净值报告</p> <p>本集合计划封闭期内至少每周披露一次经托管人复核的份额净值。开放期内，管理人应当在【T+1】日内披露集合计划 T 日的经托管人复核的份额净值。管理人将通过网站公告、信函、传真、电子邮件、手机短信等本合同约定的方式之一将净值情况告知份额持有人。由于不可抗力原因、或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更，或其他非管理人及托管人的主观意愿原因，未能按上述时点披露复核后份额净值的，管理人和托管人不承担赔偿责任，但应在情况消除后尽快向份额持有人披露复核后的份额净值。</p> <p>...</p> <p>(三) 临时报告</p> <p>...</p> <p>1、涉及集合计划重大诉讼、仲裁、财产纠纷的，以及出现延期兑付、投资标的重大违约等重大风险事件的；</p> <p>...</p>
<p style="text-align: center;">关联交易及利益冲突</p>	
<p>(一) 本集合计划存在或可能存在的利益冲突情形</p> <p>1、关联方的范围</p> <p>管理人或托管人的关联方，是指管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人、与其有重大利害关系的公司或其他关联方。管理人的关联方以最近一期上市公司披露年报为基础，结合《公司法》和《企业会计准则》的规定确定，托管人的关联方名单以托管人定期披露或最近一期年报公布的关联方名单为准。</p> <p>2、关联交易</p> <p>关联交易是指本计划与关联方进行的交易，包括但不限于：运用本计划资产投资于管理人、托管人及其关联方发行的证券或承销期内承销的证券；运用本计划资产投资于管理人及子公司设立的金融产品，或管理人担任投资顾问的金融产品，或通过管理人及其关联方代销渠道认购/申购金融产品；运用本计划资产与管理人及子公司、管理人及子公司设立的金融产品，或管理人担任投资顾问的金融产品进行对手方交易；本计划接受管理人及其关联方发行的债券作为债券逆回购的质押券；本计划与管理人及其关联方作为交易对手进行债券逆回购交易；以及其他导致本计划与关联方之间利益转移的活动。</p> <p>其中：</p>	<p>(一) 本集合计划存在或可能存在的利益冲突情形</p> <p>1、关联方的范围</p> <p>产品涉及的关联方主要包括：(1) 产品管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人、与其有重大利害关系的公司或者其他关联方；(2) 管理人及其控股股东、实际控制人、与其有重大利害关系的公司或者其他关联方设立的金融产品或管理人担任投资顾问的金融产品</p> <p>管理人的关联方以最近一期上市公司披露年报为基础，结合《公司法》和《企业会计准则》的规定确定，托管人的关联方名单以托管人定期披露或最近一期年报公布的关联方名单为准。</p> <p>2、关联交易</p> <p>关联交易是指本计划与关联方进行的交易，包括但不限于：运用资产管理产品资产投资于上述第 1 项第 (1) 条的主体发行的证券或承销期内承销的证券；投资于上述第 1 项第 (2) 条的金融产品；与上述第 1 项第 (1) 条的主体和第 (2) 条的金融产品进行对手方交易；接受上述第 1 项第 (1) 条的主体发行的债券作为债券逆回购的质押券等。</p>

(1) 重大关联交易是指至少符合如下情形之一的关联交易：1) 将本计划委托财产投资于管理人、托管人及其关联方发行的或承销期内承销的证券；2) 关联交易单笔交易金额达到或超过本计划净资产的 5%。

(2) 一般关联交易是指除上述重大关联交易以外的其他关联交易。

上述关联交易范围与最新法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求不一致的，以届时适用的法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求为准。

3、管理人、托管人及相关从业人员不得利用资产管理计划，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，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资。

4、全体份额持有人充分知悉并理解，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能仍会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。

(二) 利益冲突的处理和披露

1、管理人运用集合计划财产进行上述第（一）款第 2 项所列投资交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定的投资目标、投资策略，并遵循份额持有人利益优先原则，防范利益冲突。

2、管理人应当建立健全关联交易的内部审批机制和评估机制，本资产管理计划从事关联交易，管理人应事先履行公司内部审批流程，由投资经理发起申请，经投资总监审批后方可执行。

3、关联交易的处理和披露

管理人运用集合计划财产进行上述一般关联交易的，交易前无需另行取得份额持有人的同意或通知份额持有人。全体份额持有人知悉并确认，份额持有人签署本合同即视为已授权管理人可进行上述一般关联交易且无需另行征得份额持有人同意。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操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的关联交易风险，进而可能影响份额持有人的利益。份额持有人知悉并接受关联交易风险。在交易完成后的合理时间内，管理人应将交易的情况书面通知托管人，并通过管理人的网站公告或合同约定的其他方式告知份额持有人。

管理人运用本计划财产进行上述重大关联交易的，交易前将以公告方式向份额持有人披露具体关联交易的情况并设置临时开放期供不同意的份额持有人退出，不同意的份额持有人应在临时开放期内申请退出，如份额持有人在临时开放期内未申请退出的（包括回复不同意但未提出退出申请或未明确回复意见的）视为同意。在每笔交易完成后的合理时间内，管

其中：

(1) 重大关联交易是指至少符合如下情形之一的关联交易：1) 将本计划受托财产投资于上述第 1 项第（1）条的主体发行的或承销期内承销的证券；2) 关联交易单笔交易金额达到或超过本计划净资产的 10%；

(2) 一般关联交易是指除上述重大关联交易以外的其他关联交易。

上述关联交易范围与最新法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求不一致的，以届时适用的法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求为准。

3、管理人、托管人及相关从业人员不得利用资产管理计划，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，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资。

4、全体份额持有人充分知悉并理解，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能仍会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。

(二) 利益冲突的处理和披露

1、管理人运用集合计划财产进行上述第（一）款第 2 项所列投资交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定的投资目标、投资策略，并遵循份额持有人利益优先原则，防范利益冲突。

2、管理人应当建立健全关联交易的内部审批机制和评估机制，本资产管理计划从事关联交易，管理人应事先履行公司内部审批流程，由投资经理发起申请，经投资总监审批后方可执行。

3、关联交易的处理和披露

管理人运用集合计划财产进行上述一般关联交易的，交易前无需另行取得份额持有人的同意或通知份额持有人。全体份额持有人知悉并确认，份额持有人签署本合同即视为已授权管理人可进行上述一般关联交易且无需另行征得份额持有人同意。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操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的关联交易风险，进而可能影响份额持有人的利益。份额持有人知悉并接受关联交易风险。在交易完成后的合理时间内，管理人应将交易的情况书面通知托管人，并通过

<p>理人应将关联交易的情况书面通知份额持有人和托管人。</p> <p>如果法律法规、监管规定、自律组织规则及交易所规则等要求管理人就上述投资交易向监管机构、基金业协会或交易所等有权机构报告或备案，管理人按相关规定办理。</p>	<p>管理人的网站公告或合同约定的其他方式告知份额持有人。</p> <p>管理人运用本计划财产进行上述重大关联交易的，交易前将以公告方式向份额持有人披露具体关联交易的情况并设置临时开放期供不同意的份额持有人退出，不同意的份额持有人应在临时开放期内申请退出，如份额持有人在临时开放期内未申请退出的（包括回复不同意或未明确回复意见但未提出退出申请的）视为同意。在每笔交易完成后的合理时间内，管理人应将关联交易的情况书面通知份额持有人和托管人。</p> <p>如果法律法规、监管规定、自律组织规则及交易所规则等要求管理人就上述投资交易向监管机构、基金业协会或交易所等有权机构报告或备案，管理人按相关规定办理。</p>
--	---