

关于湘财证券金泽 5 号集合资产管理计划合同变更的公告

尊敬的投资者：

为更好地向投资者提供服务，根据《湘财证券金泽 5 号集合资产管理计划资产管理合同（第四次变更）》（以下简称资产管理合同）“二十四 合同的变更、终止与财产清算”的规定，经湘财证券股份有限公司（以下简称管理人）与兴业银行股份有限公司（以下简称托管人）协商一致，管理人拟对资产管理合同进行变更，变更主要内容详见附件一：《湘财证券金泽 5 号集合资产管理计划资产管理合同变更情况对照表》。本次合同变更条款如涉及《湘财证券金泽 5 号集合资产管理计划说明书（第四次变更）》和《湘财证券金泽 5 号集合资产管理计划风险揭示书（第四次变更）》的，则对其做同步变更。现就本次合同变更事项向投资者征求意见，请投资者于 2025 年 11 月 24 日（含）至 2025 年 11 月 26 日（含）期间回复意见，在 2025 年 11 月 26 日（含）15:00 之前未回复意见的，视为同意本次合同变更。不同意本次合同变更的投资者，可在 2025 年 11 月 27 日退出其持有的本集合计划全部份额，未于该期间申请退出的则视为同意本次合同变更事项。对于自本次公告发布之日起（含当日）申购本集合计划的投资者而言，管理人默认其同意本次合同变更事项，不再另行征询其意见。

本次资产管理合同变更事项的表决单详见附件二，投资者可采取从管理人网站下载并打印等方式填制表决单。请自然人投资者签署、机构投资者用印后将表决意见发送至管理人指定邮箱【zn07125@xcsc.com】

管理人将公告本集合计划合同变更生效事宜。

如有疑问，请咨询湘财证券客服热线：95351

特此公告。



附件一：《湘财证券金泽 5 号集合资产管理计划资产管理合同变更情况对照表》

（下划线部分为修改前的内容，加粗为修改后的内容）

条款	修改前	修改后								
八、集合计划的参与、退出与转让	<p>（一）集合计划的参与、退出</p> <p>6、参与和退出的费用</p> <p>（1）参与费用</p> <p>本集合计划不收取参与费。</p> <p>（2）退出费用</p> <p>本集合计划不收取退出费。</p>	<p>（一）集合计划的参与、退出</p> <p>6、参与和退出的费用</p> <p>（1）参与费用</p> <table><tr><th>参与金额（M）</th><th>参与费率</th></tr><tr><td>M<100 万元</td><td>1.00%</td></tr><tr><td>100 万元≤M<300 万元</td><td>0.50%</td></tr><tr><td>M≥300 万元</td><td>按单笔收取 3000 元/笔</td></tr></table>	参与金额（M）	参与费率	M<100 万元	1.00%	100 万元≤M<300 万元	0.50%	M≥300 万元	按单笔收取 3000 元/笔
		参与金额（M）	参与费率							
		M<100 万元	1.00%							
		100 万元≤M<300 万元	0.50%							
		M≥300 万元	按单笔收取 3000 元/笔							
		<p>（2）退出费用</p> <table><tr><th>持有期限（N）</th><th>退出费率</th></tr><tr><td>N<30 天</td><td>0.50%</td></tr><tr><td>N≥30 天</td><td>0%</td></tr></table>	持有期限（N）	退出费率	N<30 天	0.50%	N≥30 天	0%		
		持有期限（N）	退出费率							
		N<30 天	0.50%							
		N≥30 天	0%							
十一、集合计划的投资	<p>（二）投资范围及比例</p> <p>2、投资比例</p> <p>（1）投资于固定收益类资产的比例低于本集合计划总资产的 80%；投资于权益类资产的比例低于本集合计划总资产的 80%；投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例低于本集合计划总资产的 80%，<u>或衍生品账户权益不超过本集合计划总资产的 20%；</u></p> <p>（8）除可转换公司债券之外，本集合计划所投资的信用类债券的债项评级在 AA 级（含）以上，（超）短期融资券主体评级需在 AA 级（含）以上，本集合计划投资的债券若无债项评级，<u>主体评级需在 AA 级（含）以上</u>；本集合计划所投资的可转换公司债券的债项评级和主体评级均不低于 A+级；本集合计划投资于 AA 级及以下信用类债券的比例可以超过本集合计划资产净值的 50%。</p>	<p>（二）投资范围及比例</p> <p>2、投资比例</p> <p>（1）投资于固定收益类资产的比例低于本集合计划总资产的 80%；投资于权益类资产的比例低于本集合计划总资产的 80%；投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例低于本集合计划总资产的 80%，或期货和衍生品账户权益不超过本集合计划总资产的 20%；</p> <p>（8）除可转换公司债券之外，本集合计划所投资的信用类债券的债项评级在 AA 级（含）以上，（超）短期融资券主体评级需在 AA 级（含）以上，本集合计划投资的债券若无债项评级，主体评级或担保人主体评级需在 AA 级（含）以上；本集合计划所投资的可转换公司债券的债项评级和主体评级均不低于 A+级；本集合计划投资于 AA 级及以下信用类债券的比例可以超过本集合计划资产净值的 50%。</p>								

	<p>4、投资管理与风险控制</p> <p>(1) 风险控制体系</p> <p>①湘财证券风险控制和内部监查体系：</p> <p>湘财证券董事会承担全面风险管理的最终责任。董事会下设风险控制委员会，履行董事会授权的全面风险管理部分职责。监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。</p> <p>湘财证券经理层对全面风险管理承担主要责任。湘财证券高级管理人员按照不相容岗位不兼职的原则进行分工，并由董事会指定一名高级管理人员(首席风险官)负责全面风险管理工作。</p> <p>湘财证券风险管理总部在首席风险官领导下推动全面风险管理工作。合规管理总部在合规总监的领导下负责合规风险及洗钱风险的管理工作。财务总部是流动性风险管理的归口部门，主要职责是牵头建立健全流动性风险管理体系，对流动性风险实施有效识别、计量、监测、控制、应对和报告。董秘处是声誉风险管理的归口部门，主要职责是牵头建立健全声誉风险管理体系，对声誉风险实施有效识别、评估、控制、监测、应对和报告。<u>办公室、信息技术中心、托管结算总部、人力资源管理与发展总部在承担本单位内部的风险管理职能外，还承担流程控制、日常检查督导等方面的风险管理职能。</u>稽核管理总部是湘财证券内部审计工作的归口部门，负责对湘财证券全面风险管理的充分性和有效性进行独立、客观的审查和评价。</p>	<p>4、投资管理与风险控制</p> <p>(1) 风险控制体系</p> <p>①湘财证券风险控制和内部监查体系：</p> <p>湘财证券董事会承担全面风险管理的最终责任。董事会下设风险控制委员会，履行董事会授权的全面风险管理部分职责。监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。</p> <p>湘财证券经理层对全面风险管理承担主要责任。湘财证券高级管理人员按照不相容岗位不兼职的原则进行分工，并由董事会指定一名高级管理人员(首席风险官)负责全面风险管理工作。</p> <p>湘财证券风险管理总部在首席风险官领导下推动全面风险管理工作。合规管理总部在合规总监的领导下负责合规风险及洗钱风险的管理工作。财务总部是流动性风险管理的归口部门，主要职责是牵头建立健全流动性风险管理体系，对流动性风险实施有效识别、计量、监测、控制、应对和报告。董秘处是声誉风险管理的归口部门，主要职责是牵头建立健全声誉风险管理体系，对声誉风险实施有效识别、评估、控制、监测、应对和报告。公司成立由合规管理总部牵头的廉洁从业监督工作组，对公司各单位及工作人员的廉洁从业情况进行监督和报告。信息技术中心、托管结算总部、人力资源管理与发展总部在承担本单位内部的风险管理职能外，按照部门职责各自在信息技术、托管结算、人力资源管理等方面履行相应的风险管理职能。稽核管理总部是湘财证券内部审计工作的归口部门，负责对湘财证券全面风险管理的充分性和有效性进行独立、客观的审查和评价。</p>

	<p>(六) 投资限制及禁止行为</p> <p>1、为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>(1) 投资于固定收益类资产的比例低于本集合计划总资产的 80%；投资于权益类资产的比例低于本集合计划总资产的 80%；投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例低于本集合计划总资产的 80%，<u>或衍生品账户权益不超过本集合计划总资产的 20%；</u></p> <p>(11) 除可转换债券之外，本集合计划所投资的信用类债券的债项评级在 AA 级(含)以上，(超)短期融资券主体评级需在 AA 级(含)以上，本集合计划投资的债券若无债项评级，<u>主体评级</u>需在 AA 级(含)以上；本集合计划所投资的可转换债券的债项评级和主体评级均不低于 A+ 级；本集合计划投资于 AA 级及以下信用类债券的比例可以超过本集合计划资产净值的 50%；</p>	<p>(六) 投资限制及禁止行为</p> <p>1、为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>(1) 投资于固定收益类资产的比例低于本集合计划总资产的 80%；投资于权益类资产的比例低于本集合计划总资产的 80%；投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例低于本集合计划总资产的 80%，<u>或期货和衍生品账户权益不超过本集合计划总资产的 20%；</u></p> <p>(11) 除可转换债券之外，本集合计划所投资的信用类债券的债项评级在 AA 级(含)以上，(超)短期融资券主体评级需在 AA 级(含)以上，本集合计划投资的债券若无债项评级，主体评级<u>或担保人主体评级</u>需在 AA 级(含)以上；本集合计划所投资的可转换债券的债项评级和主体评级均不低于 A+ 级；本集合计划投资于 AA 级及以下信用类债券的比例可以超过本集合计划资产净值的 50%；</p>
十五、投资经理的指定与变更	<p>(二) 投资经理简历</p> <p>本集合计划的投资经理为<u>倪文磊先生</u>，简历如下：</p> <p><u>倪文磊先生，北京大学应用数学博士，超过 10 年证券投资和研究经验，于 2014 年 7 月加入湘财证券股份有限公司，现任投资经理，历任研究员；2007 年-2013 年，任北京中彩在线科技有限责任公司数据挖掘工程师。倪文磊先生已取得基金从业资格，最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的情形，无在其他机构兼职的情况。</u></p>	<p>(二) 投资经理简历</p> <p>本集合计划的投资经理为<u>张丽华女士</u>，简历如下：</p> <p><u>张丽华女士，中国人民大学经济学硕士，10 年以上证券投资和研究经验，曾任天相投资顾问有限公司投资分析部行业分析师、中国民族证券有限公司研究部行业分析师、益民基金管理有限公司研究部行业分析师、投资部基金经理助理、中国人保资产管理有限公司公募基金事业部基金经理；现任湘财证券股份有限公司北京资产管理分公司投资经理。</u></p> <p><u>张丽华女士已取得基金从业资格，最近三年无被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚的情形，无在其他机构兼职的情况。</u></p>
十六、集	(二) 集合计划财产相关账户的开立和管理	(二) 集合计划财产相关账户的开立和管理

合计划的财产	<p>5、投资定期存款的银行账户的开立和管理</p> <p><u>计划财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户。本着便于计划财产的安全保管和日常监督检查的原则，存款行应尽量选择托管人经办行所在地的分支机构。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管资金账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户。”如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，托管人保管证实书正本。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。</u></p>	<p>5、投资定期存款的银行账户的开立和管理</p> <p>计划财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴应包含托管人指定印章。本着便于计划财产的安全保管和日常监督检查的原则，存款行应尽量选择托管人经办行所在地的分支机构。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下条款或意思表示：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管资金账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户。”如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，原则上由托管人保管证实书正本。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。</p>
十八、越权交易的界定	<p>（二）越权交易的处理程序</p> <p>1、发生上述第（1）种越权交易时的处理程序</p> <p>托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并<u>有权</u>报告监管机构。</p> <p>（四）托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督；</p> <p>（2）对本计划以下投资限制进行监督：</p> <p>1）投资于固定收益类资产的比例低于本集合计</p>	<p>（二）越权交易的处理程序</p> <p>1、发生上述第（1）种越权交易时的处理程序</p> <p>托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并<u>及时</u>报告监管机构。</p> <p>（四）托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督；</p> <p>（2）对本计划以下投资限制进行监督：</p> <p>1）投资于固定收益类资产的比例低于本集合计划总资</p>

	<p>划总资产的 80%; 投资于权益类资产的比例低于本集合计划总资产的 80%; 投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例低于本集合计划总资产的 80%, 或衍生品账户权益不超过本集合计划总资产的 20%;</p> <p>11) 除可转换债券外, 本集合计划所投资的信用类债券的债项评级在 AA 级 (含) 以上, (超) 短期融资券主体评级需在 AA 级 (含) 以上, 本集合计划投资的债券若无债项评级, <u>主体评级</u>需在 AA 级 (含) 以上; 本集合计划所投资的可转换债券的债项评级和主体评级均不低于 A+ 级; 本集合计划投资于 AA 级及以下信用类债券的比例可以超过本集合计划资产净值的 50%。</p>	<p>产的 80%; 投资于权益类资产的比例低于本集合计划总资产的 80%; 投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例低于本集合计划总资产的 80%, 或<u>期货和衍生品</u>账户权益不超过本集合计划总资产的 20%;</p> <p>11) 除可转换债券外, 本集合计划所投资的信用类债券的债项评级在 AA 级 (含) 以上, (超) 短期融资券主体评级需在 AA 级 (含) 以上, 本集合计划投资的债券若无债项评级, 主体评级<u>或担保人主体评级</u>需在 AA 级 (含) 以上; 本集合计划所投资的可转换债券的债项评级和主体评级均不低于 A+ 级; 本集合计划投资于 AA 级及以下信用类债券的比例可以超过本集合计划资产净值的 50%。</p>
十九、估值和会计核算	<p><u>管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序, 并定期对其执行效果进行评估, 保证集合资产管理计划估值的公平、合理。</u></p> <p><u>集合计划资产总值是指用集合计划的资金购买的各种有价证券、银行存款本息、集合计划应收款项及其他投资等所形成的价值总和。</u></p> <p><u>集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的净资产值。</u></p> <p><u>集合计划份额净值是指集合计划资产净值除以计划总份额。</u></p> <p><u>集合计划份额净值的计算, 保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入, 由此产生的误差计入集合计划财产。</u></p> <p><u>(一) 估值目的</u></p> <p><u>客观、准确地反映集合计划资产的价值。经集合计划资产估值后确定的集合计划份额净值, 是进行信息披露、计算参与和退出集合计划的基础。</u></p>	<p>管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序, 并定期对其执行效果进行评估, 保证集合资产管理计划估值的公平、合理。</p> <p>集合计划资产总值是指用集合计划的资金购买的各种有价证券、银行存款本息、集合计划应收款项及其他投资等所形成的价值总和。</p> <p>集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的净资产值。</p> <p>集合计划份额净值是指集合计划资产净值除以计划总份额。</p> <p>集合计划份额净值的计算, 保留到小数点后 4 位, 小数点后第 5 位四舍五入, 由此产生的误差计入集合计划财产。</p> <p>(一) 估值目的</p> <p>客观、准确地反映集合计划资产的价值。经集合计划资产估值后确定的集合计划份额净值, 是进行信息披露、计算参与和退出集合计划的基础。</p> <p>(二) 估值时间</p>

<p><u>(二) 估值时间</u></p> <p><u>本集合计划成立后，每个交易日对集合计划资产进行估值，但管理人根据法律法规的规定或本合同约定暂停估值时除外。</u></p> <p><u>(三) 估值对象</u></p> <p><u>集合计划所拥有的各种有价证券、银行存款本息、集合计划应收款项、其它投资等资产。</u></p> <p><u>(四) 估值方法</u></p> <p><u>1、资产管理产品估值方法</u></p> <p><u>(1) 持有的交易所上市交易基金，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。</u></p> <p><u>(2) 持有的场外非货币市场基金（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未公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。</u></p> <p><u>(3) 持有的场外货币市场基金，按基金管理人公布的该基金估值日前一交易日的每万份收益估值。</u></p> <p><u>(4) 持有的证券公司、基金公司或基金子公司、期货公司发行的资产管理计划等公布净值的，按照最新公布的净值估值，不公布净值的，以估值技术计量公允价值，估值技术无法可靠计量公允价值的，由管理人与托管人协商估值方法，按照最能反映其公允价值的方法估值。标的产品管理人未向托管人提供份额净值的，由本计划资产管理人协调标的产品管理人提供。</u></p> <p><u>持有的私募基金管理人（基金业协会登记）发行</u></p>	<p>本集合计划成立后，每个交易日对集合计划资产进行估值，但管理人根据法律法规的规定或本合同约定暂停估值时除外。</p> <p><u>(三) 估值对象</u></p> <p>集合计划所拥有的各种有价证券、银行存款本息、集合计划应收款项、其它投资等资产。</p> <p><u>(四) 估值方法</u></p> <p>1、资产管理产品估值方法</p> <p>(1) 持有的交易所上市交易基金，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) 持有的场外非货币市场基金（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未公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。</p> <p>(3) 持有的场外货币市场基金，按基金管理人公布的该基金估值日前一交易日的每万份收益估值。</p> <p>(4) 持有的证券公司、基金公司或基金子公司、期货公司发行的资产管理计划等公布净值的，按照最新公布的净值估值，不公布净值的，以估值技术计量公允价值，估值技术无法可靠计量公允价值的，由管理人与托管人协商估值方法，按照最能反映其公允价值的方法估值。标的产品管理人未向托管人提供份额净值的，由本计划资产管理人协调标的产品管理人提供。</p> <p>持有的私募基金管理人（基金业协会登记）发行并需备案的私募证券投资基金，按标的产品私募基金托管人提供的最新基金估值信息估值。如投资标的份额变动基金管理人需及时提供份额变动确认凭证。</p> <p>2、银行定期存款、协议存款以本金列示，按商定的存</p>
---	--

<p>并需备案的私募证券投资基金，按标的产品私募基金托管人提供的最新基金估值信息估值。</p> <p>如投资标的份额变动基金管理人需及时提供份额变动确认凭证。</p> <p>2、银行定期存款、协议存款以本金列示，按商定的存款利率在实际持有期间内逐日计提利息。如提前支取或利率发生变化，管理人及时进行账务调整。</p> <p>3、回购交易以成本列示，按商定利率在实际占款期间内逐日计提利息。</p> <p>4、固定收益品种的估值方法</p> <p>(1) 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>(2) 对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构(此处指中证指数有限公司)提供的相应品种当日的估值全价估值。</p> <p>对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构(此处指中证指数有限公司)提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。</p> <p>对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价估值。回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应价格进行估值。</p> <p>对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价估值；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价估值。</p>	<p>款利率在实际持有期间内逐日计提利息。如提前支取或利率发生变化，管理人及时进行账务调整。</p> <p>3、回购交易以成本列示，按商定利率在实际占款期间内逐日计提利息。</p> <p>4、固定收益品种的估值方法</p> <p>(1) 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>(2) 对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构(此处指中证指数有限公司)提供的相应品种当日的估值全价估值。</p> <p>对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构(此处指中证指数有限公司)提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。</p> <p>对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价估值。回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应价格进行估值。</p> <p>对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价估值；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价估值。</p> <p>对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。</p> <p>(3) 在全国银行间债券市场交易的固定收益品种按照第三方估值机构(此处指中央国债登记结算有限责任公司)提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。</p> <p>5、股票估值方法</p>
--	---

<p><u>值。</u></p> <p><u>对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。</u></p> <p><u>(3) 在全国银行间债券市场交易的固定收益品种按照第三方估值机构（此处指中央国债登记结算有限责任公司）提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。</u></p> <p><u>5、股票估值方法</u></p> <p><u>(1) 证券交易所上市流通股票的估值方法</u></p> <p><u>在证券交易所上市流通的股票，估值日有交易的，按估值日收盘价估值；估值日无交易，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，以最近交易日的收盘价估值；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，应参考类似投资品种的现行价格及重大变化因素，调整最近交易日的收盘价确定公允价值。</u></p> <p><u>(2) 未上市股票的估值方法</u></p> <p><u>首次发行未上市的股票，在未上市期间按发行价格估值。送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价或最近交易日的收盘价确定公允价值。</u></p> <p><u>(3) 有明确限售期股票的估值方法</u></p> <p><u>通过公开、非公开等方式取得且有明确限售期的股票（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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流动受</u></p>	<p><u>(1) 证券交易所上市流通股票的估值方法</u></p> <p>在证券交易所上市流通的股票，估值日有交易的，按估值日收盘价估值；估值日无交易，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，以最近交易日的收盘价估值；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，应参考类似投资品种的现行价格及重大变化因素，调整最近交易日的收盘价确定公允价值。</p> <p><u>(2) 未上市股票的估值方法</u></p> <p>首次发行未上市的股票，在未上市期间按发行价格估值。送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价或最近交易日的收盘价确定公允价值。</p> <p><u>(3) 有明确限售期股票的估值方法</u></p> <p>通过公开、非公开等方式取得且有明确限售期的股票（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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流动受限股票），在限售期内，按照协会最新规定确定公允价值。</p> <p><u>6、投资衍生品的估值方法</u></p> <p>交易所交易的期货、期权合约的投资，一般以估值日期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的结算价估值；如最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的，应采取相应的衍生品估值模型，确定公允价值。</p> <p><u>7、本计划投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行</u></p> <p><u>8、港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币或其他外币币种对人民币汇率的，应当以估值日中国人民</u></p>
---	--

<p>限股票)，在限售期内，按照协会最新规定确定公允价值。</p> <p>6、投资衍生品的估值方法</p> <p>交易所交易的期货、期权合约的投资，一般以估值日期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的结算价估值；如最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的，应采取相应的衍生品估值模型，确定公允价值。</p> <p>7、港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币或其他外币币种对人民币汇率的，应当以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准，先根据外币行情价格和持仓量计算原币金额，再根据选用的外币汇率折算出保留两位小数的人民币市值。</p> <p>8、税收：对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际应纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。</p> <p>9、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映受托资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映受托资产公允价值的方法估值。</p> <p>10、未尽事项参照相关规定或者行业惯例进行。</p> <p>11、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，</p>	<p>银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准，先根据外币行情价格和持仓量计算原币金额，再根据选用的外币汇率折算出保留两位小数的人民币市值。</p> <p>9、税收：对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际应纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。</p> <p>10、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映受托资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映受托资产公允价值的方法估值。</p> <p>11、未尽事项参照相关规定或者行业惯例进行。</p> <p>12、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增或修订事项，按国家最新规定估值。</p> <p>（五）估值程序</p> <p>本集合计划日常估值由管理人进行。管理人与托管人于T日核对T日资产净值。托管人应对资产净值计算结果进行复核。管理人完成估值后，与托管人以录音电话、邮件或双方认可的其他形式核对。</p> <p>（六）估值错误与遗漏的处理方式</p> <p>1、管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性和及时性。当单位计价出现错误时，管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。</p> <p>2、本计划的会计责任方由管理人担任，与本计划有关的会计估值问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的建议执行；或者管理人和托管人对计划资产净值的计算结果，虽然多次重新</p>
---	--

<p>从其规定。如有新增或修订事项，按国家最新规定估值。</p> <p><u>（五）估值程序</u></p> <p>本集合计划日常估值由管理人进行。管理人与托管人于 T 日核对 T 日资产净值。托管人应对资产净值计算结果进行复核。管理人完成估值后，与托管人以录音电话、邮件或双方认可的其他形式核对。</p> <p>集合计划份额净值的计算采用四舍五入的方法精确到小数点后第四位。</p> <p><u>（六）估值错误与遗漏的处理方式</u></p> <p>1、管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性和及时性。当单位计价出现错误时，管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。</p> <p>2、本计划的会计责任方由管理人担任，与本计划有关的会计估值问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的建议执行；或者管理人和托管人对计划资产净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布计划份额净值的情形，以管理人的计算结果对外公布；由此给投资者和集合计划财产造成损失，由过错方承担相应责任。</p> <p><u>3、差错处理</u></p> <p><u>（1）差错类型</u></p> <p>本计划运作过程中，如果由于管理人、托管人、注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人按差错处理原则给予赔偿并承担赔偿任。</p>	<p>计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布计划份额净值的情形，以管理人的计算结果对外公布；由此给投资者和集合计划财产造成损失，由过错方承担相应责任。</p> <p><u>3、差错处理</u></p> <p><u>（1）差错类型</u></p> <p>本计划运作过程中，如果由于管理人、托管人、注册登记机构、或代理销售机构、或投资者自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人按差错处理原则给予赔偿并承担赔偿责任。</p> <p>上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。</p> <p>由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。</p> <p><u>（2）差错处理原则</u></p> <p>1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；</p> <p>2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事</p>
---	---

<p>上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力。</p> <p>由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。</p> <p><u>(2) 差错处理原则</u></p> <p>1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；</p> <p>2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；</p> <p>3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返</p>	<p>人负责，不对第三方负责；</p> <p>3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；</p> <p>4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；</p> <p>5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因管理人过错造成集合计划财产损失时，托管人应为集合计划的利益向管理人追偿；如果因托管人过错造成集合计划财产损失时，管理人应为集合计划的利益向托管人追偿。除管理人和托管人之外的第三方造成集合计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由管理人负责向差错责任方追偿；</p> <p>6) 如果出现差错的责任方未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、《集合资产管理合同》或其他规定，管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则管理人有权向出现过错的其他责任方进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；</p> <p>7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。</p> <p><u>(3) 差错处理程序</u></p> <p>差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：</p> <p>1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；</p>
---	--

<p>还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；</p> <p>4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；</p> <p>5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因管理人过错造成集合计划资产损失时，托管人应为集合计划的利益向管理人追偿；如果因托管人过错造成集合计划资产损失时，管理人应为集合计划的利益向托管人追偿。除管理人和托管人之外的第三方造成集合计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由管理人负责向差错责任方追偿；</p> <p>6) 如果出现差错的责任方未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、《集合资产管理合同》或其他规定，管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则管理人有权向出现过错的其他责任方进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；</p> <p>7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。</p> <p><u>(3) 差错处理程序</u></p> <p>差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：</p> <p>1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；</p> <p>2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；</p> <p>3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；</p> <p>4) 根据差错处理的方法，需要修改注册登记机构的交易数据的，由注册登记机构进行更正，并</p>	<p>2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；</p> <p>3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；</p> <p>4) 根据差错处理的方法，需要修改注册登记机构的交易数据的，由注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行说明。</p> <p><u>(七) 估值调整的情形与处理</u></p> <p>如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议一致后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值；</p> <p>管理人、托管人按此进行估值调整，所造成的误差不作为集合计划份额资产净值错误处理。</p> <p><u>(八) 暂停估值的情形</u></p> <p>1、与本集合计划投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因停市时；</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时，但估值条件恢复时，管理人或托管人必须及时完成估值工作；</p> <p>3、中国证监会认定的其他情形。</p> <p><u>(九) 特殊情形的处理</u></p> <p>由于本计划所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的集合计划资产计价错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任，但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p> <p>由于注册登记机构发送的数据有误，处理方法等同于交易数据错误的处理方法。</p>
---	--

<p>就差错的更正向有关当事人进行说明。</p> <p><u>(七) 估值调整的情形与处理</u></p> <p>如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议一致后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值；</p> <p>管理人、托管人按此进行估值调整，所造成的误差不得作为集合计划份额资产净值错误处理。</p> <p><u>(八) 暂停估值的情形</u></p> <p>1、与本集合计划投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因停市时；</p> <p>2、因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时，但估值条件恢复时，管理人或托管人必须及时完成估值工作；</p> <p>3、中国证监会认定的其他情形。</p> <p><u>(九) 特殊情形的处理</u></p> <p>由于本计划所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的集合计划资产计价错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任，但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p> <p>由于注册登记机构发送的数据有误，处理方法等同于交易数据错误的处理方法。</p> <p>由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，会计法律法规变化、管理人或托管人估值业务系统出现重大故障或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、</p>	<p>由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，会计法律法规变化、管理人或托管人估值业务系统出现重大故障或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的份额净值计算错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任，但管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p> <p><u>(十) 集合计划份额净值的确认</u></p> <p>集合计划资产总值是指用集合计划的资金购买的各种有价证券、银行存款本息、集合计划应收款项及其他投资等所形成的价值总和。</p> <p>集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的净资产值。</p> <p>集合计划份额净值是指集合计划资产净值除以计划总份额。</p> <p>集合计划份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。</p> <p><u>(十一) 会计政策</u></p> <p>1、本计划的会计政策比照现行政策或按照资产管理合同约定执行；</p> <p>2、本计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；本计划首次募集的会计年度按如下原则：如果本计划成立少于 3 个月，可以并入下一个会计年度披露；</p> <p>3、本计划核算以人民币为记账本位币，以人民币为记账单位；</p> <p>4、本计划会计核算制度按《中华人民共和国会计法》和企业会计准则等最新政策规定执行。</p> <p>5、本计划独立建账、独立核算；管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表；托管人应定期与管理人就本计划的会计核算、报表</p>
--	--

<p>合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的份额净值计算错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任，但管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p> <p><u>（十）集合计划份额净值的确认</u></p> <p>管理人计算的集合计划份额净值由托管人复核确认后公告。</p> <p><u>（十一）会计政策</u></p> <p>1、<u>会计年度为每年1月1日至12月31日。</u></p> <p>2、<u>记账本位币为人民币，记账单位为元。</u></p> <p>3、<u>会计核算按《中华人民共和国会计法》和企业会计准则等最新政策规定执行。</u></p> <p><u>（十二）会计核算方法</u></p> <p>1、<u>管理人、托管人应根据有关法律法规，对委托资产独立建账、独立核算。</u></p> <p>2、<u>管理人、托管人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表。</u></p> <p>3、<u>托管人应定期与管理人就委托资产的会计核算、报表编制等进行核对。</u></p> <p><u>（十三）交易及清算交收安排</u></p> <p>1、<u>选择证券、期货经纪机构的程序</u></p> <p><u>（1）资产管理人负责选择代理本资产管理计划财产进行证券买卖的证券经营机构。</u></p> <p><u>（2）资产管理人应及时将本资产管理计划财产证券交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知资产托管人。</u></p> <p><u>（3）资产管理人与资产托管人配合完成交易单元的合并清算事宜，资产管理人在交易前应确认相关合并清算事宜已办结。若资产管理人在合并清算办结前交易，则相关的交收责任由资产管理人承担。</u></p> <p>2、<u>投资证券后的清算交收安排</u></p>	<p>编制等进行核对。</p> <p>6、<u>证券账目及交易记录的核对</u></p> <p>对计划财产的证券账目，由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。</p> <p>对计划财产的交易记录，管理人与托管人核对估值结果之前，应保证所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致，如果实际交易记录与会计账簿记录不一致，造成会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由管理人承担。</p> <p><u>（十二）交易及清算交收安排</u></p> <p>1、<u>选择证券、期货经纪机构的程序</u></p> <p><u>（1）资产管理人负责选择代理本资产管理计划财产进行证券买卖的证券经营机构。</u></p> <p><u>（2）资产管理人应及时将本资产管理计划财产证券交易单元号、佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知资产托管人。</u></p> <p><u>（3）资产管理人与资产托管人配合完成交易单元的合并清算事宜，资产管理人在交易前应确认相关合并清算事宜已办结。若资产管理人在合并清算办结前交易，则相关的交收责任由资产管理人承担。</u></p> <p>2、<u>投资证券后的清算交收安排</u></p> <p><u>（1）关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：</u></p> <p>资产托管人、资产管理人应共同遵守双方签署的《托管银行证券资金结算协议》及对该协议不时的更新。</p> <p><u>（2）关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司T+0非担保结算要求的证券交易：</u></p> <p>1) 对于在沪深交易所交易的采用T+0非担保交收的交易品种（如中小企业私募债、股票质押式回购、债券质押式协议回购、资产支持证券等，根据中登公司业务规则适时调整），资产管理人需在交易当日不晚于14:</p>
--	--

<p><u>(1) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：</u></p> <p><u>1) 资产托管人、资产管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本款规定的内容。资产管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定，并遵守资产托管人为履行特别结算参与人的义务所制定的业务规则与规定。</u></p> <p><u>2) 资产托管人代理资产管理计划与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由资产托管人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于资产管理人原因造成资产托管人无法正常完成结算业务，资产托管人发现后应立即通知资产管理人，由资产管理人负责解决，由此造成资产托管人无法按时向中国证券登记公司支付证券清算款的责任以及由此给资产托管人所托管的其他财产造成的损失由资产管理人承担。</u></p> <p><u>3) 资产管理人签署本合同/协议，即视为同意资产管理人在构成资金交收违约且未能按时指定相关证券作为交收履约担保物时，资产托管人可自行向结算公司申请由结算公司协助冻结资产管理人证券账户内相应证券，无需资产管理人另行出具书面确认文件。</u></p> <p><u>4) 资产托管人遵照中登公司上海分公司和中登公司深圳分公司备付金、保证金管理办法有关规定，确定和调整该委托财产最低结算备付金、证券结算保证金限额，资产管理人应存放于中登公司的最低备付金、结算保证金日末余额不得低于资产托管人根据中登公司上海和深圳分</u></p>	<p>00 向资产托管人发送交易应付资金划款指令，同时将相关交易证明文件传真至资产托管人，并与资产托管人进行电话确认，以保证当日交易资金交收的顺利进行，中登业务规则允许采用 RTGS 交收的，在计划非担保交收账户可用资金充足的情况下，托管人将进行勾单处理。对于资产管理人在 14:00 后出具的划款指令，特别是需要资产托管人进行“勾单”确认的交易，资产托管人本着勤勉尽责的原则积极处理，但不保证支付/勾单成功。</p> <p>2) 资产管理人一旦出现交易后无法履约的情况，应在第一时间通知资产托管人。对于中国结算公司允许资产托管人指定不履约的交易品种，资产管理人应向资产托管人出具书面的取消交收指令，另，鉴于中登公司对取消交收（指定不履约）申报时间有限，资产托管人有权在电话通知资产管理人后，先行完成取消交收操作，资产管理人承诺日终前补出具书面的取消交收指令。</p> <p>3) 若资产管理人未及时出具交易应付资金划款指令，或资产管理人在托管产品资金托管账户头寸不足的情况下交易，资产托管人有权在中登公司取消交收截止时点前半小时内主动对该笔交易进行取消交收申报，所有损失由资产管理人承担。</p> <p>4) 对于根据结算规则不能取消交收的交易品种，如出现前述第 2)、3) 项所述情形的，资产管理人知悉并同意资产托管人有权（但并非确保）仅根据中国结算公司的清算交收数据，主动将托管产品资金托管账户中的资金划入中国结算公司用以完成当日 T+0 非担保交收交易品种的交收，资产管理人承诺在日终前向资产托管人补出具资金划款指令。</p> <p>5) 发生以下因资产管理人原因所造成的情形，资产管理人应承担相应责任：</p> <p>①资产管理人所管理的产品资金不足导致其自身产品</p>
---	---

<p><u>公司备付金、保证金管理办法规定的限额。资产托管人根据中登公司上海和深圳分公司规定向委托财产支付利息。</u></p> <p><u>5) 根据中登公司托管行集中清算规则, 如委托财产 T 日进行了中登公司深圳分公司 T+1DVP 卖出交易, 资产管理人不能将该笔资金作为 T+1 日的可用头寸, 即该笔资金在 T+1 日不可用也不可提, 该笔资金在 T+2 日才能划拨至托管资金账户。</u></p> <p><u>6) 根据中国证券登记结算有限责任公司的规定, 结算备付金账户内的最低备付金、交易保证金账户内的资金按月调整按季结息, 因此, 资产管理合同终止时, 资产管理计划可能有尚存放于结算公司的最低备付金、交易保证金以及结算公司尚未支付的利息等款项。对上述款项, 资产托管人将于结算公司支付该等款项时扣除相应银行汇划费用后划付至资产管理计划清算报告中指定的收款账户。资产管理合同终止后, 中登根据结算规则, 调增计划的结算备付以及交易保证金, 资产管理人应配合资产托管人, 向资产托管人及时划付调增款项, 以便资产托管人履行交收职责。</u></p> <p><u>(2) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+0 非担保结算要求的证券交易:</u></p> <p><u>1) 对于在沪深交易所交易的采用 T+0 非担保交收的交易品种(如中小企业私募债、股票质押式回购、债券质押式协议回购、资产支持证券等, 根据中登公司业务规则适时调整), 资产管理人需在交易当日不晚于 14: 00 向资产托管人发送交易应付资金划款指令, 同时将相关交易证明文件传真至资产托管人, 并与资产托管人进行</u></p>	<p>交收失败, 由资产管理人承担交易失败的风险, 资产托管人无义务为该产品垫付交收款项;</p> <p>②因资产管理人未在合同约定的时间前向资产托管人提交有效划款指令, 导致资产托管人无法及时完成支付结算操作而使其自身产品交收失败的, 由资产管理人自行承担交易失败的风险;</p> <p>③因资产管理人所管理的产品资金不足, 且占用托管行最低备付金交收成功, 造成托管行损失, 则应承担赔偿责任, 且资产托管人保留根据上海银行间市场同业拆借利率向资产管理人追索利息的权利;</p> <p>④因资产管理人所管理的产品资金不足或资产管理人未在规定时间内向资产托管人提交划款指令, 且有证据证明其直接造成资产托管人托管的其他产品交收失败和损失的, 资产管理人应负赔偿责任。</p> <p>6) 资产管理人已充分了解托管行结算模式下可能存在的交收风险。如资产托管人托管的其他产品资金不足或过错, 进而导致资产管理人管理的产品交收失败的, 则资产托管人将配合资产管理人提供相关数据等信息向其他客户追偿。</p> <p>7) 对于托管产品采用 T+0 非担保交收下实时结算 (RTGS) 方式完成实时交收的收款业务, 管理人可根据需要在交易交收后, 深圳 T+0 不晚于交收当日 14: 00、上海 T+0 不晚于交收当日 15: 00 向托管人发送交易应收资金收款指令, 同时将相关交易证明文件传真至托管人, 并与托管人进行电话确认, 以便托管人将交收金额提回至托管产品资金托管账户。</p> <p>(3) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+N 非担保结算要求的证券交易资产管理人知悉并同意资产托管人仅根据中国结算公司的清算交收数据主动完成托管产品资金清算交收。若资产管理人出现交易后无法履约的情况, 并且中国结算公司的业务规则允许资产托管人对相关交易可以取消交收</p>
---	---

<p>电话确认，以保证当日交易资金交收的顺利进行，中登业务规则允许采用 RTGS 交收的，在计划非担保交收账户可用资金充足的情况下，托管人将进行勾单处理。对于资产管理人在 14:00 后出具的划款指令，特别是需要资产托管人进行“勾单”确认的交易，资产托管人本着勤勉尽责的原则积极处理，但不保证支付/勾单成功。</p> <p>2) 资产管理人一旦出现交易后无法履约的情况，应在第一时间通知资产托管人。对于中国结算公司允许资产托管人指定不履约的交易品种，资产管理人应向资产托管人出具书面的取消交收指令，另，鉴于中登公司对取消交收（指定不履约）申报时间有限，资产托管人有权在电话通知资产管理人后，先行完成取消交收操作，资产管理人承诺日终前补出具书面的取消交收指令。</p> <p>3) 若资产管理人未及时出具交易应付资金划款指令，或资产管理人在托管产品资金托管账户头寸不足的情况下交易，资产托管人有权在中登公司取消交收截止时点前半小时主动对该笔交易进行取消交收申报，所有损失由资产管理人承担。</p> <p>4) 对于根据结算规则不能取消交收的交易品种，如出现前述第 2)、3) 项所述情形的，资产管理人知悉并同意资产托管人有权（但并非确保）仅根据中国结算公司的清算交收数据，主动将托管产品资金托管账户中的资金划入中国结算公司用以完成当日 T+0 非担保交收交易品种的交收，资产管理人承诺在日终前向资产托管人补出具资金划款指令。</p> <p>5) 发生以下因资产管理人原因所造成的情形，</p>	<p>的，资产管理人应于交收日前一工作日向资产托管人出具书面的取消交收指令，并与资产托管人进行电话确认。</p> <p>(4) 投资私募证券投资基金时，基金管理人应将该私募证券投资基金托管人的联系方式连同交易文件一并向基金托管人提供。</p> <p>3、开放式基金投资的清算交收安排</p> <p>(1) 开放式基金申购（认购）相应的资金划拨由托管人依据管理人的划款指令逐笔划付。管理人申购（认购）开放式基金时，应将划款指令连同基金申购（认购）申请单一并传真至托管人。托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行。管理人应实时调整当日可用资金余额。管理人在收到基金申购（认购）确认回单后，应立即传真至托管人。</p> <p>(2) 管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时将赎回申请书传真至托管人；管理人在收到赎回确认回单后，应及时传真至托管人。</p> <p>(3) 为确保本计划财产会计核算及估值的及时处理，管理人应于开放式基金交易（包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红等）的确认日及时获取确认单等单据的传真件，要求并督促基金管理公司于当日传真给管理人，管理人收到后应立即传真至托管人。</p> <p>4、银行间交易资金结算安排</p> <p>(1) 管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同或不及时履行合同而造成的纠纷。</p> <p>(2) 管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单加盖印章后及时传真给托管人，并电话确认。如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交易需要取消或终止，管理人应书面</p>
---	--

<p><u>资产管理人应承担相应责任：</u></p> <p><u>①资产管理人所管理的产品资金不足导致其自身产品交收失败，由资产管理人承担交易失败的风险，资产托管人无义务为该产品垫付交收款项；</u></p> <p><u>②因资产管理人未在合同约定的时间前向资产托管人提交有效划款指令，导致资产托管人无法及时完成支付结算操作而使其自身产品交收失败的，由资产管理人自行承担交易失败的风险；</u></p> <p><u>③因资产管理人所管理的产品资金不足，且占用托管行最低备付金交收成功，造成托管行损失，则应承担赔偿责任，且资产托管人保留根据上海银行间市场同业拆借利率向资产管理人追索利息的权利；</u></p> <p><u>④因资产管理人所管理的产品资金不足或资产管理人未在规定时间内向资产托管人提交划款指令，且有证据证明其直接造成资产托管人托管的其他产品交收失败和损失的，资产管理人应负赔偿责任。</u></p> <p><u>6) 资产管理人已充分了解托管行结算模式下可能存在的交收风险。如资产托管人托管的其他产品资金不足或过错，进而导致资产管理人管理的产品交收失败的，则资产托管人将配合资产管理人提供相关数据等信息向其他客户追偿。</u></p> <p><u>7) 对于托管产品采用 T+0 非担保交收下实时结算 (RTGS) 方式完成实时交收的收款业务，管理人可根据需要在交易交收后，深圳 T+0 不晚于交收当日 14: 00、上海 T+0 不晚于交收当日 15: 00 向托管人发送交易应收资金收款指令，同时将相关交易证明文件传真至托管人，并与托管</u></p>	<p><u>通知托管人。</u></p> <p>(3) 银行间交易结算方式采用券款对付的，托管资金账户与本计划在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨，除了登记结算机构系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管资金账户之外，应当由管理人出具资金划款指令，托管人审核无误后执行。由于管理人未及时出具指令导致本计划在托管资金账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足导致的损失，由过错方承担责任。</p> <p>5、投资银行存款的特别约定</p> <p>(1) 本计划投资银行存款前，应与存款银行签署投资银行存款协议。</p> <p>(2) 本计划投资银行存款，必须采用管理人和托管人认可的方式办理。</p> <p>(3) 管理人投资银行存款或办理存款支取时，应提前书面通知托管人，以便托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。</p> <p>(4) 因投资需要在托管银行以外的其他银行开立活期账户进行投资的，管理人、托管人和存款行需在投资前另行签署三方协议。</p> <p>6、其他场外交易资金结算</p> <p>(1) 管理人负责场外交易的实施，托管人负责根据管理人划款指令和相关投资文件进行场外交易资金的划付。管理人应将划款指令连同相关交易文件一并传真至托管人，托管人根据本合同第十七部分约定审核后及时执行划款指令。</p> <p>(2) 托管人负责审核划款指令要素和交易文件相应要素(如有)的一致性，相关交易文件中约定的其他转让或划款条件由管理人负责审核。管理人同时应以书面形式通知托管人相关收款账户名、账号、交易费率等。投资或收益分配资金必须回流到本计划托管资金账户内，不得划入其他账户。</p>
--	--

<p>人进行电话确认，以便托管人将交收金额提回至托管产品资金托管账户。</p> <p><u>(3) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司 T+N 非担保结算要求的证券交易资产管理人知悉并同意资产托管人仅根据中国结算公司的清算交收数据主动完成托管产品资金清算交收。若资产管理人出现交易后无法履约的情况，并且中国结算公司的业务规则允许资产托管人对相关交易可以取消交收的，资产管理人应于交收日前一工作日向资产托管人出具书面的取消交收指令，并与资产托管人进行电话确认。</u></p> <p><u>(4) 投资私募证券投资基金时，基金管理人应将该私募证券投资基金托管人的联系方式连同交易文件一并向基金托管人提供。</u></p> <p><u>3、开放式基金投资的清算交收安排</u></p> <p><u>(1) 开放式基金申购（认购）相应的资金划拨由托管人依据管理人的划款指令逐笔划付。管理人申购（认购）开放式基金时，应将划款指令连同基金申购（认购）申请单一并传真至托管人。托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行。管理人应实时调整当日可用资金余额。管理人在收到基金申购（认购）确认回单后，应立即传真至托管人。</u></p> <p><u>(2) 管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时将赎回申请书传真至托管人；管理人在收到赎回确认回单后，应及时传真至托管人。</u></p> <p><u>(3) 为确保本计划财产会计核算及估值的及时处理，管理人应于开放式基金交易（包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红等）的确认日及时获取确认单等单据的传真件，</u></p>	<p>7、交易资金前端风险控制</p> <p>如本集合计划通过交易单元在证券交易所进行证券交易，将由管理人作为交易参与人，根据《证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，证券交易所、证券登记机构对交易参与人相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过交易所对交易参与人实施前端控制。</p>
---	--

	<p><u>要求并督促基金管理公司于当日传真给管理人，管理人收到后应立即传真至托管人。</u></p> <p><u>4、银行间交易资金结算安排</u></p> <p><u>(1) 管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同或不及时履行合同而造成的纠纷。</u></p> <p><u>(2) 管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单加盖印章后及时传真给托管人，并电话确认。如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交易需要取消或终止，管理人应书面通知托管人。</u></p> <p><u>(3) 银行间交易结算方式采用券款对付的，托管资金账户与本计划在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨，除了登记结算机构系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管资金账户之外，应当由管理人出具资金划款指令，托管人审核无误后执行。由于管理人未及时出具指令导致本计划在托管资金账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足导致的损失，由过错方承担责任。</u></p> <p><u>5、投资银行存款的特别约定</u></p> <p><u>(1) 本计划投资银行存款前，应与存款银行签署投资银行定期存款协议。</u></p> <p><u>(2) 本计划投资银行存款，必须采用管理人和托管人认可的方式办理。</u></p> <p><u>(3) 管理人投资银行存款或办理存款支取时，应提前书面通知托管人，以便托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。</u></p> <p><u>6、其他场外交易资金结算</u></p> <p><u>(1) 管理人负责场外交易的实施，托管人负责根据管理人划款指令和相关投资文件进行场外</u></p>	
--	--	--

	<p><u>交易资金的划付。管理人应将划款指令连同相关交易文件一并传真至托管人，托管人根据本合同第十七部分约定审核后及时执行划款指令。</u></p> <p><u>(2) 托管人负责审核划款指令要素和交易文件相应要素（如有）的一致性，相关交易文件中约定的其他转让或划款条件由管理人负责审核。管理人同时应以书面形式通知托管人相关收款账户名、账号、交易费率等。投资或收益分配资金必须回流到本计划托管资金账户内，不得划入其他账户。</u></p> <p><u>7、资金、证券账目及交易记录的核对</u></p> <p><u>管理人和托管人应定期对账。</u></p> <p><u>对计划财产的资金账目，以管理人与托管人约定方式核对，确保相关各方账账相符。</u></p> <p><u>对计划财产的证券账目，由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。</u></p> <p><u>对计划财产的交易记录，管理人与托管人核对估值结果之前，应保证所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致，如果实际交易记录与会计账簿记录不一致，造成会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由管理人承担。</u></p> <p><u>8、交易资金前端风险控制</u></p> <p><u>如本集合计划通过交易单元在证券交易所进行证券交易，将由管理人作为交易参与者，根据《证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，证券交易所、证券登记机构对交易参与者相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过交易所对交易参与者实施前端控制。</u></p>	
二十、集	2、管理费	2、管理费

<p>合计划的 费用与税 收</p>	<p>(1) 固定管理费</p> <p>本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 <u>1.00%</u> 年费率计提。计算方法如下：</p> $C = A \times \text{固定管理费年费率} \div 365$ <p>C 为每日应计提的固定管理费；</p> <p>A 为前一日集合计划资产净值。</p> <p>管理人的固定管理费每日计算，逐日累计，按季支付，由托管人于每季度初的首日起 5 个工作日内依据管理人划款指令从本集合计划资产中支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p><u>(2) 管理人的业绩报酬</u></p> <p><u>年化收益率的计算公式如下：</u></p> $R = (P_1 - P_0) \div P'_0 \times 365 \div N \times 100\%$ <p><u>其中：</u></p> <p><u>R=年化收益率；</u></p> <p><u>P₁=本次业绩报酬计提日的计划累计单位净值；</u></p> <p><u>P₀=上一个业绩报酬计提日的计划累计单位净值；</u></p> <p><u>P'₀=上一个业绩报酬计提日的单位净值；</u></p> <p><u>N=上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数。</u></p> <p><u>管理人业绩报酬的计算方法如下：</u></p> <table border="1" data-bbox="215 1496 810 1787"> <thead> <tr> <th><u>年化收益率 (R)</u></th><th><u>计 提 比例</u></th><th><u>业绩报酬 (H)</u> <u>计算方法</u></th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td><u>$R \leq r_i$</u></td><td><u>0</u></td><td><u>0</u></td></tr> <tr> <td><u>$R > r_i$</u></td><td><u>B_i</u></td><td><u>$H = (R - r_i) \times B_i \times A \times N \div 365$</u></td></tr> </tbody> </table> <p><u>其中：</u></p> <p><u>H=业绩报酬；</u></p> <p><u>A=每笔参与份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额。</u></p>	<u>年化收益率 (R)</u>	<u>计 提 比例</u>	<u>业绩报酬 (H)</u> <u>计算方法</u>	<u>$R \leq r_i$</u>	<u>0</u>	<u>0</u>	<u>$R > r_i$</u>	<u>B_i</u>	<u>$H = (R - r_i) \times B_i \times A \times N \div 365$</u>	<p>(1) 固定管理费</p> <p>本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 <u>1.20%</u> 年费率计提。计算方法如下：</p> $C = A \times \text{固定管理费年费率} \div 365$ <p>C 为每日应计提的固定管理费；</p> <p>A 为前一日集合计划资产净值。</p> <p>管理人的固定管理费每日计算，逐日累计，按季支付，由托管人于每季度初的首日起 5 个工作日内依据管理人划款指令从本集合计划资产中支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>(2) 管理人的业绩报酬</p> <p><u>业绩报酬计提日的年化收益率的计算公式如下：</u></p> $R_i = (P_i - P_{i-1}) \div P'_{i-1} \times 365 \div N \times 100\%$ <p><u>其中：</u></p> <p><u>R_i=第 i 个业绩报酬计提日的年化收益率；</u></p> <p><u>P_i=第 i 个业绩报酬计提日的计划累计单位净值；</u></p> <p><u>P_{i-1}=第 i-1 个业绩报酬计提日的计划累计单位净值；</u></p> <p><u>P'_{i-1}=第 i-1 个业绩报酬计提日的单位净值；</u></p> <p><u>N=第 i-1 个业绩报酬计提日到第 i 个业绩报酬计提日的天数。</u></p> <p><u>管理人业绩报酬的计算方法如下：</u></p> <table border="1" data-bbox="845 1384 1544 1624"> <thead> <tr> <th><u>年化收益率(R_i)</u></th><th><u>计提比例</u></th><th><u>业绩报酬(H_i)计算方法</u></th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td><u>$R_i \leq r_i$</u></td><td><u>0</u></td><td><u>H_i=0</u></td></tr> <tr> <td><u>$R_i > r_i$</u></td><td><u>B_i</u></td><td><u>H_i = (R_i-r_i) × B_i × A × N ÷ 365</u></td></tr> </tbody> </table> <p><u>其中：</u></p> <p><u>H_i 为该笔份额在本次业绩报酬计提日应计提的业绩报酬；</u></p> <p><u>A=每笔参与份额在第 i-1 个业绩报酬计提日的资产净值总额；</u></p> <p><u>r_i 为管理人公告的第 i 个业绩报酬计提日的业绩报酬计提基准；</u></p>	<u>年化收益率(R_i)</u>	<u>计提比例</u>	<u>业绩报酬(H_i)计算方法</u>	<u>$R_i \leq r_i$</u>	<u>0</u>	<u>H_i=0</u>	<u>$R_i > r_i$</u>	<u>B_i</u>	<u>H_i = (R_i-r_i) × B_i × A × N ÷ 365</u>
<u>年化收益率 (R)</u>	<u>计 提 比例</u>	<u>业绩报酬 (H)</u> <u>计算方法</u>																		
<u>$R \leq r_i$</u>	<u>0</u>	<u>0</u>																		
<u>$R > r_i$</u>	<u>B_i</u>	<u>$H = (R - r_i) \times B_i \times A \times N \div 365$</u>																		
<u>年化收益率(R_i)</u>	<u>计提比例</u>	<u>业绩报酬(H_i)计算方法</u>																		
<u>$R_i \leq r_i$</u>	<u>0</u>	<u>H_i=0</u>																		
<u>$R_i > r_i$</u>	<u>B_i</u>	<u>H_i = (R_i-r_i) × B_i × A × N ÷ 365</u>																		

	<p>r_i = 管理人公告的第 i 个业绩报酬计提日的业绩报酬计提基准；</p> <p>B_i 为业绩报酬计提的比例，其中 B_i 不得超过 60%。某业绩报酬计提日管理人提取的业绩报酬总额（ΣH）为该计提日所有投资者各笔投资业绩报酬之和（包括退出资金、分红资金（若有）或清算资金中扣除的业绩报酬，下同）。某业绩报酬计提日单个计划投资者计提的业绩报酬总额为该投资者持有的各笔投资业绩报酬之和。</p> <p>$\Sigma H = H_1 + H_2 + H_3 + \dots + H_n$</p> <p>其中 n 为投资者可计提业绩报酬的笔数。</p> <p>3、业绩报酬支付</p> <p>业绩报酬在业绩报酬计提日计提，由管理人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，并随分红资金或退出款项划付。<u>因涉及注册登记数据，管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不复核，托管人配合进行账务处理。</u></p> <p>4、管理费、托管费的调整</p> <p>本集合计划管理费、托管费可能根据市场情况进行调整。投资者特此授权管理人经与托管人协商一致，可以对本集合计划管理费、托管费进行下调，下调后的管理费、托管费在管理人<u>网站公告满 3 个工作日后生效</u>，自生效之日起，公告内容即成为本合同组成部分。如需上调管理费、托管费，则需经管理人、托管人协商一致并经全体投资者同意。</p>	<p>B_i 为业绩报酬计提的比例，其中 B_i 不得超过 60%。某业绩报酬计提日管理人提取的业绩报酬总额（ΣH）为该计提日所有投资者各笔投资业绩报酬之和（包括退出资金、分红资金（若有）或清算资金中扣除的业绩报酬，下同）。某业绩报酬计提日单个计划投资者计提的业绩报酬总额为该投资者持有的各笔投资业绩报酬之和。</p> <p>$\Sigma H = H_1 + H_2 + H_3 + \dots + H_n$</p> <p>其中 n 为投资者可计提业绩报酬的笔数。</p> <p>投资者确认并充分了解，本集合计划的业绩报酬计提基准仅是管理人收取业绩报酬的计提标准而非预期收益率，不构成管理人或托管人对受托财产本金不受损失及收益预期、收益状况的任何承诺或保证。</p> <p>3、业绩报酬支付</p> <p>业绩报酬在业绩报酬计提日计提，由管理人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，并随分红资金或退出款项划付。<u>因涉及注册登记数据，管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不复核，托管人配合进行账务处理。</u></p> <p>4、管理费、托管费的调整</p> <p>本集合计划管理费、托管费可能根据市场情况进行调整。投资者特此授权管理人经与托管人协商一致，可以对本集合计划管理费、托管费进行下调，下调后的管理费、托管费在管理人公告后生效，自生效之日起，公告内容即成为本合同组成部分。如需上调管理费、托管费，则需经管理人、托管人协商一致并经全体投资者同意。</p>
二十四、合同的变更、终止与财产清算	<p>（一）合同的变更</p> <p>1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订而变更资产管理合同的或本合同的修改对投资者利益无实质性</p>	<p>（一）合同的变更</p> <p>1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订而变更资产管理合同的或本合同的修改对投资者利益无实质性不利影响的，包括但不限于</p>

	不利影响的，包括但不限于资产管理计划备案过程中被要求补正备案材料而涉及到本合同修改的、调低固定管理费率、调低托管费率 <u>及调整开放期安排</u> 等，管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容，无需征求投资者意见。	资产管理计划备案过程中被要求补正备案材料而涉及到本合同修改的、调低固定管理费率、调低托管费率等，管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容，无需征求投资者意见。
--	---	--

附件二：湘财证券金泽 5 号集合资产管理计划资产管理合同变更投资者表决单

投资者姓名/名称：		
投资者证件号码（身份证件号/营业执照注册号）：		
审议事项	同意	反对
湘财证券金泽 5 号集合资产管理计划资产管理合同第五次变更		
投资者签名或盖章		
日期： 年 月 日		
说明：请就审议事项表示“同意”或“反对”，并在相应栏内画“√”，同一审议事项只能表示一项意见。		