

关于湘财证券周周安享 1 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《湘财证券周周安享 1 号集合资产管理计划资产管理合同（第一次变更）》（以下简称资产管理合同）“二十五 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：《湘财证券周周安享 1 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《湘财证券周周安享 1 号集合资产管理计划说明书（第一次变更）》和《湘财证券周周安享 1 号集合资产管理计划风险揭示书（第一次变更）》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 25 日（含）期间回复意见，在 2025 年 11 月 25 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，可在份额锁定期届满后的最近一个开放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：《湘财证券周周安享 1 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>2、参与退出安排</p> <p>参与安排：本集合计划自成立之日起封闭运作 5 个工作日，之后，每个自然周的周一、周三（如遇非工作日，则不顺延）为开放日，投资者可在任一开放日办理参与业务。</p> <p>退出安排：自本集合计划成立日或份额参与日起，投资者参与份额锁定 7 个自然日（第一个份额锁定期），投资者可在第一个份额锁定期届满后的最近一个开放日申请办理退出业务（如开放日为非工作日，则顺延至下一工作日）。若投资者未在该开放日办理退出的，则投资者持有的份额进入下一个份额锁定期（7 个自然日），即该份额从上一份额锁定期届满日的次日起锁定至满 7 个自然日后的最近一个开放日，方可退出，以此类推。投资者多笔参与的，按笔分别计算份额锁定期。</p>	<p>(一) 集合计划的参与、退出</p> <p>2、参与退出安排</p> <p>参与安排：本集合计划自成立之日起封闭运作 5 个工作日，之后，每个自然周的周一、周三（如遇非工作日，则不顺延）为开放日，投资者可在任一开放日办理参与业务。</p> <p>退出安排：自本集合计划成立日或份额参与日起，投资者参与份额锁定 7 个自然日（第一个份额锁定期），投资者可在第一个份额锁定期届满后的最近一个开放日申请办理退出业务（如开放日为非工作日，则顺延至下一工作日）。若投资者未在该开放日办理退出的，则投资者持有的份额进入下一个份额锁定期（7 个自然日），即该份额从上一份额锁定期届满日的次日起锁定至满 7 个自然日后的最近一个开放日，方可退出，以此类推。投资者多笔参与的，按笔分别计算份额锁定期。</p> <p>管理人有权视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知投资者。具体开放时间及参与、退出安排由管理人提前公告，但每周开放不超过 3 天。管理人提前在网站公告或以投资者认可的其他形式告知前述调整事项即视为履行了告知义务。</p>
十一、集合计划的投资	<p>(二) 投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划主要投资于固定收益类资产，包括但不限于国内依法发行的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债券、公司债券（含非公开发行债券）、在沪深交易所交易的资产支持证券优先级（资产支持证券的底层资产不得为信托计划、私募基金、资管产品及其收/受益权）、</p>	<p>(二) 投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划主要投资于固定收益类资产，包括但不限于国内依法发行的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债券、公司债券（含非公开发行债券）、在沪深交易所交易的资产支持证券优先级（资产支持证券的底层资产不得为信托计划、私募基金、资管产品及其收/受益权）、资产支持票据优先级（底层不得为信托</p>

<p>资产支持票据优先级(底层不得为信托计划、私募基金、资管产品及其收/受益权)、公开及定向债务融资工具(含短期融资券、超短期融资券、中期票据、PPN等经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具)、银行存款、公募货币基金、大额存单、同业存单等，本集合计划可以参与债券回购交易。</p> <p>上述投资范围如与法律法规或监管机构管理办法发生冲突时，采用从严标准。除以上投资品种外，需新增其他投资品种的，管理人应在投资前与投资者、托管人书面协商一致。</p> <p>本集合计划的投资范围包含债券回购，为提升整体组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。详细情况请见“二十四 风险揭示”。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>	<p>计划、私募基金、资管产品及其收/受益权)、公开及定向债务融资工具(含短期融资券、超短期融资券、中期票据、PPN等经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具)、银行存款、公募货币基金、公募债券型证券投资基金(含LOF、ETF)、大额存单、同业存单等，本集合计划可以参与债券回购交易。</p> <p>上述投资范围如与法律法规或监管机构管理办法发生冲突时，采用从严标准。除以上投资品种外，需新增其他投资品种的，管理人应在投资前与投资者、托管人书面协商一致。</p> <p>本集合计划的投资范围包含债券回购，为提升整体组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。详细情况请见“二十四 风险揭示”。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>
<p>3、投资管理的方法和标准</p> <p>本集合计划初期会依据产品自身收益风险特征的定位赋予各大类资产不同权重，合理分配组合风险预算，优选资产进行投资。随着市场环境的变化，会动态优化整个组合的风险预算，并且对持仓产品进行连续的跟踪，根据投资情况进行调整。</p> <p>(1) 资产配置策略</p> <p>本集合计划将密切关注宏观经济变量，深入分析宏观经济、货币和财政政策、市场资金供求情况等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险特征等因素，调整各类属资产(银行存款、债券和现金)的投资比例，在收益与风险间寻求配置的最佳平衡点。</p> <p>(2) 利率品种的投资策略</p>	<p>本集合计划初期会依据产品自身收益风险特征的定位赋予各大类资产不同权重，合理分配组合风险预算，优选资产进行投资。随着市场环境的变化，会动态优化整个组合的风险预算，并且对持仓产品进行连续的跟踪，根据投资情况进行调整。</p> <p>(1) 资产配置策略</p> <p>本集合计划将密切关注宏观经济变量，深入分析宏观经济、货币和财政政策、市场资金供求情况等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险特征等因素，调整各类属资产(银行存款、债券和现金)的投资比例，在收益与风险间寻求配置的最佳平衡点。</p> <p>(2) 利率品种的投资策略</p> <p>本集合计划对国债、政策性金融债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对未来的利率水平变化趋势进</p>

<p>本集合计划对国债、政策性金融债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对未来的利率水平变化趋势进行预测，并据此积极调整债券组合的平均久期，提高债券组合的总投资收益。在预期利率上升时，降低组合的久期；在预期利率下降时，提高组合的久期。</p> <p>(3) 信用品种的投资策略</p> <p>本集合计划在运用数量化分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，对利差走势及其收益和风险进行判断。通过买入并持有信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用债券产品，获取票息收益以及利差收益。</p>	<p>行预测，并据此积极调整债券组合的平均久期，提高债券组合的总投资收益。在预期利率上升时，降低组合的久期；在预期利率下降时，提高组合的久期。</p> <p>(3) 信用品种的投资策略</p> <p>本集合计划在运用数量化分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，对利差走势及其收益和风险进行判断。通过买入并持有信用风险可承担、期限与收益率相对合理的信用债券产品，获取票息收益以及利差收益。</p> <p>(4) 公开募集证券投资基金的投资策略</p> <p>本计划对拟投资的公募基金产品进行指标的初步筛选，然后对筛选后的产品进行定期或不定期的连续跟踪及调研，最后选取符合本计划大类资产配置策略和市场风格的产品构成投资组合，同时根据市场环境的变化对持仓产品进行动态调整。</p> <p>管理人建立了一套以量化评价为核心，兼顾公募基金管理人评价的公募基金评价体系，对市场上公募基金进行综合调研，以求在变化的市场中寻找风险收益比高且稳健增长的优秀产品。在研究过程中，管理人关注公募基金管理公司的基本情况，如运营情况、股权结构、股东能力、公司组织架构、公司财务情况和合规情况及运营资质等。在公司团队建设方面主要关注管理团队和投研团队的过往经历，公司员工稳定性等。在公司投研管理方面，管理人重点考察公司的投资理念和投资策略，也关注投资管理体系、研究管理体系和交易管理体系。在公司的风险控制方面，考察公司的风险管理理念和相关的制度及业务流程。管理人也关注公司的历史业绩情况，尤其是历史业绩和投资理念是否一致。综合这些考察和研究，对公募基金管理公司及公募基金产品给出评级。</p>
<p>4、投资管理与风险控制</p> <p>(1) 风险控制体系</p>	<p>4、投资管理与风险控制</p> <p>(1) 风险控制体系</p>

<p>①公司风险控制和内部监查体系：</p> <p>公司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>公司经理层对全面风险管理承担主要责任。公司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>公司风险管理总部在首席风险官领导下推动全面风险管理。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，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，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>稽核管理总部是公司内部审计工作的归口部门，负责对公司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>①公司风险控制和内部监查体系：</p> <p>公司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>公司经理层对全面风险管理承担主要责任。公司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>公司风险管理总部在首席风险官领导下推动全面风险管理。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，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。稽核管理总部是公司内部审计工作的归口部门，负责对公司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>（4）本集合计划所投资的信用类债券的债项评级</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>（4）本集合计划所投资的信用类债券的债项评级在 AA</p>

	<p>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>；以上债券评级的评级机构不含中债资信评估有限责任公司；</p>	<p>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>主体评级或担保人主体评级需在 AA 级（含）以上</u>；以上债券评级的评级机构不含中债资信评估有限责任公司；</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蒋仲楠，简历如下：</p> <p>蒋仲楠先生，宾夕法尼亚州立大学金融学硕士，4 年证券投资和研究经验，于 2022 年 8 月加入湘财证券，任投资经理；历任方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司债券投资部投资助理。蒋仲楠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。</p>	<p>（二）投资经理简历</p> <p>本集合计划的投资经理为申鹏，简历如下：</p> <p>申鹏先生，清华大学学士、法国国立高等工艺学校硕士，具有超过 10 年证券从业经验，2014 年加入湘财证券，现任湘财资管研究部副总经理、投资经理。历任迈科期货经纪有限公司宏观研究员、中国证券报证券研究中心股票策略研究员、湘财资管大类资产配置研究员。</p>
十六、集合计划的财产	<p>（二）集合计划财产相关账户的开立和管理</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，定期存款账户的户名应与托管账户户名一致。本着便于计划财产的安全保管和日常监督核查的原则，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。”并依照本协议交接原则对存单交接流程予以明确。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人</p>	<p>（二）集合计划财产相关账户的开立和管理</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核查的原则，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</p>

	<p><u>有权拒绝定期存款投资的划款指令。对于跨行存款，管理人需提前与托管人就定期存款协议及存单交接流程进行沟通。除非存款协议中规定存款证实书由存款行保管或存款协议作为存款支取的依据，存单交接原则上采用存款行上门服务、资产管理人负责监交的方式。特殊情况下，采用资产管理人交接存单的方式。在取得存款证实书后，托管人保管证实书正本。管理人需对存款行的选择承担责任，并指定专人在核实存款行授权人员身份信息后，负责印鉴卡与存款证实书等凭证的监交或交接，以确保与托管人所交接凭证的真实性、准确性和完整性。对于托管人实际控制外的资产产生的风险，由过错方承担责任。跨行定期存款账户的预留印鉴为托管人托管业务专用章与托管业务授权人名章。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><u>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。</u></p>
十八、越权交易的界定	<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；托管人根据本合同“十八越权交易的界定（四）”的约定，对本计划的投资范围、投资比例、投资限制进行监督。具体监督事项如下：</p> <p>(1) 对本合同以下投资范围进行监督：</p> <p>本集合计划主要投资于固定收益类资产，包括但不限于国内依法发行的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债券、公司债券（含非公开发行债券）、在沪深交易所交易的资产支持证券优先级（资产支持证券</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；托管人根据本合同“十八越权交易的界定（四）”的约定，对本计划的投资范围、投资比例、投资限制进行监督。具体监督事项如下：</p> <p>(1) 对本合同以下投资范围进行监督：</p> <p>本集合计划主要投资于固定收益类资产，包括但不限于国内依法发行的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债券、公司债券（含非公开发行债券）、在沪深交易所交易的资产支持证券优先级（资产支持证券</p>

	<p>公开发行债券)、在沪深交易所交易的资产支持证券优先级(资产支持证券的底层资产不得为信托计划、私募基金、资管产品及其收/受益权)、资产支持票据优先级(底层不得为信托计划、私募基金、资管产品及其收/受益权)、公开及定向债务融资工具(含短期融资券、超短期融资券、中期票据、PPN等经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具)、银行存款、公募货币基金、大额存单、同业存单等，本集合计划可以参与债券回购交易。</p> <p>(2) 投资限制：</p> <p>4) 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>主体评级在AA级(含)以上</u>；以上债券评级的评级机构不含中债资信评估有限责任公司；</p>	<p>的底层资产不得为信托计划、私募基金、资管产品及其收/受益权)、资产支持票据优先级(底层不得为信托计划、私募基金、资管产品及其收/受益权)、公开及定向债务融资工具(含短期融资券、超短期融资券、中期票据、PPN等经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具)、银行存款、公募货币基金、公募债券型证券投资基金(含LOF、ETF)、大额存单、同业存单等，本集合计划可以参与债券回购交易。</p> <p>(2) 投资限制：</p> <p>4) 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>主体评级或担保人主体评级在AA级(含)以上</u>；以上债券评级的评级机构不含中债资信评估有限责任公司；</p>
十九、交易及清算交收安排	<p>二、投资证券后的清算交收安排</p> <p>(一) 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：</p> <p>1. <u>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和规定，该等规则和规定自动成为本款规定的内</u>容。<u>资产管理人在投</u>资前，<u>应充分知晓与理解中登公司针对各类交</u>易品种制定结算业务规则和规定，并遵守资产<u>托管人为履行特别结算参与人的义务所制定的</u>业务规则与规定。</p> <p>2. <u>资产托管人代理资产管理计划与中登公司完</u>成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业<u>务，并承担由资产托管人原因造成的正常结算、</u>交收业务无法完成的责任；若由于资产管理人</p>	<p>二、投资证券后的清算交收安排</p> <p>(一) 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：</p> <p><u>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。</u></p>

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。

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。

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。

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。

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

<p><u>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>7. 资产管理人知晓并确认，资产管理人管理资产中用于融资回购的债券将作为资产托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若资产管理人债券回购交收违约，结算公司依法对质押券进行处置。资产管理人应就债券回购交收违约后结算公司对质押券的处置以及委托人或受托人所应承担的委托债券投资风险，告知投资者。</u></p>	
<p>五、投资银行存款的特别约定</p> <p>(一)本计划投资银行存款前，应与存款银行签署投资银行<u>定期存款协议</u>。</p> <p>(二)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>(三)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>五、投资银行存款的特别约定</p> <p>(一)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>(二)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>(三)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>(四)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>(三)未上市公司股权投资的清算交收安排</p> <p>1. 管理人代表本计划以管理人的名义持有标的公司股权。管理人应于完成目标股权转让的工</p>	<p>删除了该内容。</p>

	<p>商变更登记后 5 个工作日内向托管人提供该等股权登记文件（复印件加盖管理人有效印章）。</p> <p>2. 当本计划所持有的资产凭证或股权证明(包括股东名册和工商部门出具并加盖公章的权利证明文件)等重要文件发生变更时，管理人应于权利凭证变更后 5 个工作日内向托管人提供变更后的权利证明文件（复印件加盖管理人有效印章）。</p> <p>3. 未上市股权的退出</p> <p>(1) 协议转让</p> <p>当未上市股权通过协议转让方式变现时，管理人应向托管人提交相关交易合同或协议、成交确认文件的复印件，并通知托管人相关资金的到账时间。</p> <p>管理人应指定托管资金账户为所投资的资产产生的资金收益（包括但不限于：股权的变现所得、被投公司分红等情形）的唯一收款账户。</p> <p>(2) 上市变现</p> <p>本计划投资标的公司上市后，管理人、托管人应按本合同约定为计划开立专用资金账户、证券账户等相关账户，办理第三方存管手续，标的公司股票应登记存管于本计划证券账户下，管理人提取证券交易资金台账账户内的资金时，只能划往本计划托管资金账户。</p>	
二十、估值和会计核算	<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><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</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>(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><u>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>(二) 估值日</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>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>(三) 估值对象</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>(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>(四) 估值方法</p>
<p>(二) 估值日</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。</p>	<p>1、固定收益品种的估值方法</p>
<p>1、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>(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(另有规定的除外)，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>(2) 对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种(另有规定的除外)，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(另有规定的除外)，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。</p>	<p>对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种(另有规定的除外)，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。</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。回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的建议按照长待偿期所对应的价格进行估值。</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。回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的建议按照长待偿期所对应的价格进行估值。</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；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。</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的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>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；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。</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的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>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，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。</p> <p>4、基金估值方法</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，按基金管理公司公布的该基金估值日前一交易日的每万份收益估值。</p> <p>5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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，按最能反映委托资产公允价值的方法估值。</p> <p>6、未尽事项参照相关规定或者行业惯例进行。</p> <p>7、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，托管人应对资产</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>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有期间内逐日计提利息。</p> <p>4、基金估值方法</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，按基金管理公司公布的该基金估值日前一交易日的每万份收益估值。</p> <p>5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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，按最能反映委托资产公允价值的方法估值。</p> <p>6、未尽事项参照相关规定或者行业惯例进行。</p> <p>7、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，托管人应对资产</p>
--	---

<p>司公布的该基金估值日前一交易日的每万份收益估值。</p> <p>5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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，按最能反映委托资产公允价值的方法估值。</p> <p>6、未尽事项参照相关规定或者行业惯例进行。</p> <p>7、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>净值计算结果复核。管理人与托管人于 T 日核对 T 日资产净值。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估值结果。</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，由管理人承担相应责任。</p> <p>3、差错处理</p> <p>(1) 差错类型</p> <p>本计划运作过程中，如果由于管理人、托管人、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（“受损方”）按下述“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，按照下述规定执行。</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>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，由管理人承担相应责任。</p> <p>3、差错处理</p> <p>(1) 差错类型</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（“受损方”）按下述“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，按照下述规定执行。</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>(2) 差错处理原则</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</p>	<p>(2) 差错处理原则</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方追偿；</p> <p>6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔</p>
---	--

<p>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方追偿；</p> <p>6) 如果出现差错的当事人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当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损</p>	<p>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当事人进行追索，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>(3) 差错处理程序</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> <ol style="list-style-type: none"> 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； 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； 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； 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>(七) 估值调整的情形与处理</p> <p>如有确凿证据表明按上述规定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>(八) 暂停估值的情形</p> <ol style="list-style-type: none"> 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； 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>失；</p> <p>7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。</p> <p>(3) 差错处理程序</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> <ol style="list-style-type: none"> 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； 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； 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； 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>(七) 估值调整的情形与处理</p> <p>如有确凿证据表明按上述规定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>(八) 暂停估值的情形</p> <ol style="list-style-type: none"> 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； 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； 3、中国证监会认定的其他情形。 <p>(九) 特殊情形的处理</p>	<p>3、中国证监会认定的其他情形。</p> <p>(九) 特殊情形的处理</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，有关会计制度变化、管理人或托管人托管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、托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p> <p>(十) 集合计划份额净值的确认</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>(十一) 会计政策</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>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，有关会计制度变化、管理人或托管人托管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、托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p> <p>(十) 集合计划份额净值的确认</p> <p><u>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。</u></p> <p>(十一) 会计政策</p> <p><u>1、会计年度为每年 1月 1 日至 12 月 31 日。</u></p> <p><u>2、记账本位币为人民币，记账单位为元。</u></p> <p><u>3、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>(十二) 会计核算方法</p> <p><u>1、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><u>2、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><u>3、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>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、报表编制等进行核对。</p> <p>6、证券账目及交易记录的核对</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>4、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>	
二十一、 集合计划 的费用与 税收	<p>(一) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>2、管理费</p> <p>(1) 固定管理费</p> <p>本集合计划固定管理费按前一日的资产净值的<u>0.50%</u>的年费率计提。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>1) 业绩报酬的计提原则</p> <p>①按投资者每笔参与份额分别计算收益并计提业绩报酬；</p> <p>②符合业绩报酬计提条件时，在分红日、投资者退出日或本集合计划终止日计提业绩报酬；从分红资金中提</p>	<p>(一) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>2、管理费</p> <p>(1) 固定管理费</p> <p>本集合计划固定管理费按前一日的资产净值的 0.25% 的年费率计提。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>1) 业绩报酬的计提原则</p> <p>①按投资者每笔参与份额分别计算收益并计提业绩报酬；</p> <p>②符合业绩报酬计提条件时，在分红日、投资者退出日或本集合计划终止日计提业绩报酬；从分红资金中提</p>

<p>退出日或本集合计划终止日计提业绩报酬；从分红资金中提取的，业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次。业绩报酬的提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的 60%。</p> <p>③在分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红中扣除，当分红金额不足于扣除业绩报酬时，以分红金额为限进行扣除，超过部分未来不再追溯；在投资者退出或计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；</p> <p>④投资者退出或集合计划终止时，业绩报酬按照投资者退出份额或集合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，则该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与份额的剩余部分不受影响。</p> <p>⑤业绩报酬计提日为分红日、投资者退出日及计划终止日。</p> <p>2) 管理人于业绩报酬计提日，按照投资者每笔参与份额分别计算业绩报酬。如每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（若上一个业绩报酬计提日不存在，则初始募集期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与确认日，红利再投资的份额为红利再投确认日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率高于本集合计划的业绩报酬计提基准，管理人对超过业绩报酬计提基准的部分提取 60%作为业绩报酬。</p> <p><u>业绩报酬计提区间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>其中：</p> <p>R_i=第 i 个业绩报酬计提日的年化收益率；</p> <p>P_i=第 i 个业绩报酬计提日的计划累计单位净</p>	<p>取的，业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次。业绩报酬的提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的 60%。</p> <p>③在分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红中扣除，当分红金额不足于扣除业绩报酬时，以分红金额为限进行扣除，超过部分未来不再追溯；在投资者退出或计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；</p> <p>④投资者退出或集合计划终止时，业绩报酬按照投资者退出份额或集合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，则该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与份额的剩余部分不受影响。</p> <p>⑤业绩报酬计提日为分红日、投资者退出日及计划终止日。</p> <p>2) 本集合计划首个业绩报酬计提基准 r_i 及业绩报酬计提比例 B_i 将于初始募集期由管理人公告。在每个开放期之前，管理人公告新的业绩报酬计提基准及计提比例，如果不公告的，则适用最近一次公告的业绩报酬计提基准及计提比例（如无最近一次公告的业绩报酬计提基准及计提比例的，则为初始募集期公告的业绩报酬计提基准及计提比例）。业绩报酬计提比例 B_i 不得超过 60%，如果监管机构对业绩报酬计提比例另有规定的，从其规定，具体以管理人公告为准。</p> <p>对于每笔参与份额，若上一个已计提出业绩报酬的业绩报酬计提日（若上一个已计提出业绩报酬的业绩报酬计提日不存在，则初始募集期参与份额的业绩报酬计提日为本集合计划成立日，存续期参与份额的业绩报酬计提日为参与确认日，红利再投资份额的业绩报酬计提日为红利再投确认日，下同）到本次业绩报酬计提日计算出的年化收益率高于管理人公告的业绩报酬计提基准 r_i，管理人对超过业绩报酬计提基准的部分提取 B_i 作为业绩报酬。</p>
---	---

<p>值；</p> <p>P_{i-1}=第 $i-1$ 个业绩报酬计提日的计划累计单位净值；</p> <p>P'_{i-1}=第 $i-1$ 个业绩报酬计提日的单位净值；</p> <p>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。</p> <p>本集合计划的业绩报酬计提基准为 2.7%</p> <p>管理人业绩报酬的计算方法如下：</p>	<p>业绩报酬计提日的年化收益率的计算公式如下：</p> $R_i = (P_i - P_{i-1}) \div P'_{i-1} \times 365 \div N \times 100\%$ <p>其中：</p> <p>R_i=第 i 个业绩报酬计提日的年化收益率；</p> <p>P_i=第 i 个业绩报酬计提日的计划累计单位净值；</p> <p>P_{i-1}=第 $i-1$ 个业绩报酬计提日的计划累计单位净值；</p> <p>P'_{i-1}=第 $i-1$ 个业绩报酬计提日的单位净值；</p> <p>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。</p> <p>管理人业绩报酬的计算方法如下：</p>																		
<table border="1" data-bbox="208 646 811 938"> <thead> <tr> <th>年化收益率 (R_i)</th><th>计提比例 例</th><th>业绩报酬 (H_i) 计算方法</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R_i \leqslant 2.7\%$</td><td>0</td><td>$H_i = 0$</td></tr> <tr> <td>$R_i > 2.7\%$</td><td>60%</td><td>$H_i = (R_i - 2.7\%) \times 60\% \times A \times N \div 365$</td></tr> </tbody> </table>	年化收益率 (R_i)	计提比例 例	业绩报酬 (H_i) 计算方法	$R_i \leqslant 2.7\%$	0	$H_i = 0$	$R_i > 2.7\%$	60%	$H_i = (R_i - 2.7\%) \times 60\% \times A \times N \div 365$	<table border="1" data-bbox="838 759 1541 990"> <thead> <tr> <th>年化收益率 (R_i)</th><th>计提比例</th><th>业绩报酬 (H_i) 计算方法</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R_i \leqslant r_i$</td><td>0</td><td>$H_i = 0$</td></tr> <tr> <td>$R_i > r_i$</td><td>B_i</td><td>$H_i = (R_i - r_i) \times B_i \times A \times N \div 365$</td></tr> </tbody> </table>	年化收益率 (R_i)	计提比例	业绩报酬 (H_i) 计算方法	$R_i \leqslant r_i$	0	$H_i = 0$	$R_i > r_i$	B_i	$H_i = (R_i - r_i) \times B_i \times A \times N \div 365$
年化收益率 (R_i)	计提比例 例	业绩报酬 (H_i) 计算方法																	
$R_i \leqslant 2.7\%$	0	$H_i = 0$																	
$R_i > 2.7\%$	60%	$H_i = (R_i - 2.7\%) \times 60\% \times A \times N \div 365$																	
年化收益率 (R_i)	计提比例	业绩报酬 (H_i) 计算方法																	
$R_i \leqslant r_i$	0	$H_i = 0$																	
$R_i > r_i$	B_i	$H_i = (R_i - r_i) \times B_i \times A \times N \div 365$																	

<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，<u>下调后的管理费、托管费在管理人网站公告满 5 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>6、按照国家有关规定可以列入的其他费用</p> <p>银行结算费用、银行账户维护费、银行间市场账户维护费、服务费、开户费、银行间交易相关维护费、转托管费、份额转让费、注册登记机构收取的费用等集合计划运营过程中发生的相关费用（包括为保护集合计划及投资者权益向第三方追偿所发生的诉讼费用、律师费等）可从集合计划列支。</p> <p><u>银行结算费用、银行账户维护费一次计入集合计划费用。</u></p> <p><u>银行间市场账户维护费及服务费，按银行间市场规定的金额，在发生时一次性计入费用。</u></p> <p><u>开户费、银行间交易相关维护费、转托管费（如有）在发生时一次计入集合计划费用。</u></p> <p>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；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。管理人有权决定是否按直线法摊销，托管人根据管理人出具的函件进行账务调整。与集合计划运营有关的其他费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额从集合计划资产中支付。</p>	<p>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。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。本计划管理费、业绩报酬、席位佣金及管理人代扣增值税划入账户均为：</p> <p>户名：湘财证券股份有限公司北京资产管理分公司 开户银行：浙商银行北京分行营业部 帐号：1000000010120100162067</p> <p>3、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，<u>下调后的固定管理费、托管费在管理人公告后生效</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>6、按照国家有关规定可以列入的其他费用</p> <p>银行结算费用、银行账户维护费、银行间市场账户维护费、服务费、开户费、银行间交易相关维护费、转托管费、份额转让费、注册登记机构收取的费用等集合计划运营过程中发生的相关费用（包括为保护集合计划及投资者权益向第三方追偿所发生的诉讼费用、律师费等）可从集合计划列支。</p> <p><u>银行结算费用、银行账户汇划费、银行账户询证费用、服务费、开户费、转托管费、份额转让费、注册登记机构收取的费用等可以一次计入集合计划费用。</u></p> <p><u>银行间市场账户维护费、银行间相关费用，按银行间市场规定的金额，在每个自然日平均预提，也可根据业务</u></p>
--	--

	<p>需要，在发生时一次性计入费用。</p> <p>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；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。管理人有权决定是否按直线法摊销，托管人根据管理人出具的函件进行账务调整。与集合计划运营有关的其他费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额从集合计划资产中支付。</p>
二十四、 风险揭示	<p>增加如下风险揭示：</p> <p>9、投资公募基金的特有风险</p> <p>(1) 信用风险：因公募基金的管理人未按投资合同的约定履行兑付义务而导致的风险。</p> <p>(2) 市场风险：因宏观政策、经济周期、市场价格等因素的变化，导致计划投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。</p> <p>(3) 操作风险：在计划投资管理过程中，由于不完善或有问题的程序和不适当的管理措施，导致投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。</p> <p>(4) 流动性风险 因公募基金管理人发行的交收规则或者设置单一客户巨额赎回、巨额赎回规则等，导致持有的基金不能迅速、低成本地转变为现金的风险。</p> <p>(5) 估值风险 由于基金份额净值当日开市时不能获取数据，只能参考前一期份额净值，对于计划估值及风险控制均有滞后作用，影响管理人的投资判断，从而影响计划的投资收益。</p> <p>(6) ETF 基金投资风险 本集合计划主要投资于 ETF 基金，本集合计划净值会由于所持基金份额净值的波动而波动，所持基金面临</p>

		<p>的风险也将直接或间接成为本集合计划的风险。</p> <p>(7) 不可抗力风险：因发生投资者或受托人不能预见、不能避免和不能克服的客观情况，导致计划投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。</p> <p>(8) 其他风险：是指除上述风险外，所有导致计划投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。</p>
三十、特别声明		<p>增加如下内容：</p> <p>合同其他方签署本合同即视为知悉/授权托管人可为订立、履行个人作为一方当事人的合同所必需或为履行法定职责或者法定义务所必需而处理个人信息；托管人承诺对上述个人信息的处理合法合规，其他方亦已知悉其享有《个人信息保护法》项下所有相关权利。如果个人信息系由一方向另一方提供的，该方承诺已告知并获得相关个人同意向另一方提供个人信息，且个人已知晓个人信息的使用用途。</p>

附件二：湘财证券周周安享 1 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
湘财证券周周安享 1 号集合资产管理计划 资产管理合同第二次变更		
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。		