

中信证券新制造 1 号集合资产管理计划合同变更征询函

尊敬的投资者：

为了持续服务广大投资者，并满足广大投资者对中信证券新制造 1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）的需求，根据此前已经生效的《中信证券新制造 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及其附件（以下简称“原合同”）的约定及相关规定的要求，经征得托管人同意，我司拟对本集合计划的资产管理合同、说明书、风险揭示书进行变更。

拟变更的内容主要为：

- 1、调整开放期，调整为每周一开放（如遇非工作日不开放、不顺延）。
- 2、调低退出费率，由 0.15% 下调至 0.1%。
- 3、调整投资比例相关条款。
- 4、调整证券期货经营机构自有资金参与的相关条款。
- 5、调整关联交易相关条款。
- 6、调整估值方法。
- 7、增加份额净值精度应急调整机制，并相应增加风险揭示。
- 8、根据管理人发布的《关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告》，本集合计划的管理人于 2023 年 11 月 1 日起由“中信证券股份有限公司”变更为“中信证券资产管理有限公司”，因此相应修改与管理人主体变更相关的内容。
- 9、其他修改更新。

拟变更的条款详情请详见附件一《中信证券新制造 1 号集合资产管理计划资产管理合同变更条款对照表》、附件二《中信证券新制造 1 号集合资产管理计划说明书变更条款对照表》、附件三《中信证券新制造 1 号集合资产管理计划风险揭示书变更条款对照表》。原合同内容与本次变更内容不一致的，以本次变更内容为准。

根据原合同第五十七条的约定：

- 1、管理人有权在合同变更征询期对本集合计划设置特殊赎回开放日，不同意合同变更的投资者，应在该赎回开放日办理本集合计划的退出事宜。

此次合同变更征询期为 2025 年 12 月 18 日，在合同变更征询期内的指定特殊赎回开放期为 2025 年 12 月 18 日。如合同变更征询期结束时，本集合计划投资者不少于 2 个，则此次合同变更事项将于 2025 年 12 月 22 日起正式生效。

2、如果投资者未在合同变更征询期内的指定特殊赎回开放期办理其持有本集合计划全部份额的退出事宜，则视为投资者同意此次合同变更。

3、此次合同变更生效后，投资者有权在开放日按照本集合计划资产管理合同的相关约定办理退出事宜。

征询意见结束后，我司将在公司网站公告此次合同变更是否生效等事宜。若此次合同变更符合生效条件，则本征询函及相关公告文件在变更生效之日起成为原合同的组成部分，作为原合同附件，共同组成新的资产管理合同、说明书、风险揭示书（以下简称“新合同”）。原合同内容与本征询函及相关公告文件不一致的，以本征询函及相关公告文件内容为准。本集合计划自变更生效日起将适用新合同，我司将按规定报相关机构备案。合同变更生效后，现有投资者无需另行签署新合同，新参与的投资者则需签署新合同。

如有疑问，可咨询电话：95548 转 5。

管理人网站：www.citicsam.com



附件一：中信证券新制造 1 号集合资产管理计划资产管理合同变更条款对照表

变更前	变更后
根据管理人发布的《关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告》，本集合计划的管理人于 2023 年 11 月 1 日起由“中信证券股份有限公司”变更为“中信证券资产管理有限公司”，因此相应修改与管理人主体变更相关的内容： 1、原合同中所涉及的管理人“中信证券股份有限公司”均更新为“中信证券资产管理有限公司”； 2、原合同中所涉及的管理人网站网址均更新为“www.citicsam.com”； 3、原合同中所涉及的管理人证券投资基金业协会登记的业务登记编码更新为 PT0700033054； 4、原合同中所涉及的“管理人自有资金参与退出”均变更为“证券期货经营机构自有资金参与退出”； 5、原合同中所涉及的“资产管理部”均更新为“管理人”； 6、原合同管理人信息更新为： 名称：中信证券资产管理有限公司 住所：北京市丰台区金丽南路 3 号院 2 号楼 1 至 16 层 01 内六层 1-288 室 法定代表人：杨冰 通讯地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 16 层 联系电话：95548 转 5 公司网址：www.citicsam.com 7、原合同中所涉及的“第二十八节 或有事件”全部删除，后续章节、条款序号相应顺延调整； 8、原合同中与此次变更后的内容不一致之处，以此次变更后的内容为准。	
特别约定	
..... 投资者同意，管理人可能会将本合同相关信息提供给管理人的控股股东或关联方。	 投资者同意，管理人可能会将本合同及本计划相关数据及信息报送给管理人的关联方、控股股东及实际控制人。 投资者充分知情并同意，管理人为履行本合同约定或遵守相关法律法规规定，有权按照《中华人民共和国个人信息保护法》及其他相关法律法规的规定处理投资者相关的个人信息（包括但不限于收集、存储、使用、加工、传输、提供、公开、删除等）。特别的，投资者充分知悉并同意管理人向关联方、控股股东及实际控制人披露投资者的个人信息。投资者知悉并同意，管理人有权将投资者的相关信息按照法律法规、监管要求或本计划所投资资产管理产品的需要提供给本计划所投资资产管理产品的管理人。投资者充分知悉并同意本计划投资的资产管理产品的管理人有权向其同一集团的公司或其他关联方、该管理人为履行法定义务或为履行产品合同而向相关专业机构（前述信息接收方可能含境外机构）提供投资者的个

	人信息。 如果投资者违反适当性、资金来源或其他投资者承诺与声明的，管理人有权强制退出其持有的份额，且管理人有权以投资者参与金额与以管理人确定的强制赎回日份额净值为基础计算的投资者持有份额对应资产净值两者孰低原则强制退出该投资者持有的全部份额。
第二条 释义	
..... 关联方关系:说明书和集合资产管理合同所指关联方关系的含义与《企业会计准则第36号—关联方披露》中的关联方关系的含义相同。 	 (增加)证券期货经营机构:在本集合计划中指管理人及中信证券股份有限公司。 (删除原关联方关系释义)
第四条 承诺与声明	
..... <u>(三) 投资者承诺与声明</u> 	 <u>(三) 投资者承诺与声明</u> 7、投资者承诺本投资者及投资者的关联方不得违规参与结构化发行。
第十五条 资产管理计划的基本情况	
..... (四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级 3、投资比例 (4) 集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 200%。 (6) 本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。 (十一) 本集合计划的各项费用 	 (四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级 3、投资比例 (4) 集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 200%；除国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种外，如集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产的 50%，集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 120%。 (6) 本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。 (十一) 本集合计划的各项费用

2、退出费：投资者持有不满 365 天的本集合计划份额，退出费率为 0.15%，持有满 365 天的本集合计划份额，退出费率为 0%；
.....

2、退出费：投资者持有不满 365 天的本集合计划份额，退出费率为 0.1%，持有满 365 天的本集合计划份额，退出费率为 0%；
.....

第二十三条 集合计划的参与、退出与转让

.....
(二) 参与和退出的开放日和时间
1、开放期：本集合计划成立满 6 个月后，每月的首个工作日为开放期，投资者可以在开放期办理参与、退出业务（管理人通告暂停参与、退出时除外）。

.....
(二) 参与和退出的开放日和时间
1、开放期：每个星期一为开放日（如遇非工作日不开放、不顺延），投资者可以在开放期办理参与、退出业务（管理人通告暂停参与、退出时除外）。

(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认

(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认

6、退出的原则

6、退出的原则

(5) 退出款项计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产损益；
.....

(增加) (5) 如确认 T 日的退出、转出（如有）申请将导致本集合计划投资者少于 2 人的，管理人有权拒绝本集合计划 T 日全部的退出、转出（如有）申请并应在拒绝退出、转出（如有）申请的下一个工作日前（含该日）终止本集合计划；

(六) 参与和退出的费用
参与费用由投资者另行承担，主要用于支付市场销售等各项费用，不列入集合计划资产。

(6) 退出款项计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产损益；

本集合计划的参与费率为 1%。

(后续条款序号按顺序调整)

退出费用由投资者另行承担，本集合计划的退出费率如下：

持有期限 (D)	退出费率
D < 365 天	0.15%
365 天 ≤ D	0%
集合计划终止或清算	0%

(六) 参与和退出的费用
参与费用由投资者另行承担，主要用于支付市场销售等各项费用，不列入集合计划资产。

本集合计划的参与费率为 1%。

(十) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式

退出费用由投资者另行承担，本集合计划的退出费率如下：

6、合同约定、法律法规规定或中国证监会认定的其它情形。

持有期限 (D)	退出费率
D < 365 天	0.1%
365 天 ≤ D	0%
集合计划终止或清算	0%

(十) 拒绝或暂停参与、退出的情形及处理方式

	 <u>(增加)6、如确认 T 日的退出、转出(如有)申请将导致本集合计划投资者少于 2 人的,管理人有权拒绝本集合计划 T 日全部的退出、转出(如有)申请并应在拒绝退出、转出(如有)申请的下一个工作日前(含该日)终止本集合计划;</u> <u>7、合同约定、法律法规规定或中国证监会认定的其它情形。</u>
--	---

第二十六条

管理人自有资金参与情况	证券期货经营机构自有资金参与情况
管理人及其附属机构有权以自有资金参与本集合计划,与集合计划其他客户份额享有同等权益,承担同等风险;若管理人或管理人的附属机构以其自有资金参与的,则管理人以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该计划总份额的 16%,管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过该计划总份额的 50%,未来监管机构对自有资金参与有新规定的,本计划将按照新规定执行。因集合计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的,不视为管理人违反此项约定,但在客观条件允许的情况下,管理人及其附属机构应当在超标情况发生后的 10 个工作日内调整自有资金参与份额,并在调整后 5 个工作日内通过管理人网站公告告知投资者和托管机构,确保符合前述约定。 集合计划存续期间,公司自有资金参与计划的持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时,应当提前 5 个工作日通过管理人网站公告告知投资者和资产托管机构。为避免争议,发生前款管理人自有资金参与比例超标时,管理人退出部分自有资金,不受前款持有期限不少于 6 个月和提前 5 个工作日的限制。 为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险,或者中国证监会认可的其他情形,在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下,管理人及其附属机构以自有资金参与或退出计划可不受上述两款限制,但需事后及时通过管理人网站公告告知投资者和资产托管机构,并根据相关规定报告。	证券期货经营机构及其子公司有权以自有资金参与本集合计划,与集合计划其他投资者份额享有同等权益,承担同等风险。若证券期货经营机构或其子公司以其自有资金参与的,证券期货经营机构及其子公司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 40%,中国证监会对证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例另有规定的,证券期货经营机构及其子公司将从其规定。未来监管机构对自有资金参与有新规定的,本计划将按照新规定执行。因集合计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的,不视为证券期货经营机构或其子公司违反此项约定,但在客观条件允许的情况下,证券期货经营机构及其子公司应当在超标情况发生后的 10 个工作日内调整自有资金参与份额,并在调整后 5 个工作日内通过管理人网站公告告知投资者和托管人,确保符合前述约定。 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与本集合计划的持有期限不得少于 6 个月。集合计划存续期间,证券期货经营机构或其子公司自有资金参与、退出本集合计划的,应当提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人,并取得其同意。 集合计划存续期间,证券期货经营机构或其子公司自有资金参与或退出本集合计划的,管理人应当提前至少 5 个工作日选择通过管理人网站公告向托管人征询意见,若托管人不同意的,应当按照管理人征询通知中要求的方式并在管理人征询通知中限定的期

<u>全体投资者同意，尽管有其他约定，但集合计划存续期内当法律法规或有关针对自有资金投资集合计划的政策发生变化时，管理人经与托管人协商一致，可以按照新的法律法规或有关政策，根据本合同约定对本集合计划合同及说明书的内容进行更新或修改。</u>	限内及时向管理人明确反馈不同意的意见。<u>如果托管人未按照管理人征询通知中要求的方式进行反馈，或未在管理人征询通知中限定的期限内及时反馈，或在反馈中意见表示不明确的，则均视为托管人同意证券期货经营机构及其子公司可以按该征询通知披露的情况、进行自有资金参与或退出。</u>管理人将提前 5 个工作日通过管理人网站公告征询全体投资者的意见，投资者不同意的，应在管理人征询公告中披露的证券期货经营机构或其子公司自有资金参与或退出的开放日前（含该日）的任意一个开放日内办理其持有本集合计划全部份额的退出事宜。<u>投资者未在前述期限内退出其持有本集合计划全部份额的，则视为该投资者同意证券期货经营机构及其子公司可以按该征询公告披露的情况、进行自有资金参与或退出。</u>经托管人和全体投资者同意，证券期货经营机构及其子公司可以按该征询公告披露的情况、进行自有资金参与或退出。 <u>特别的，在本集合计划开放期内由于投资者退出份额导致证券期货经营机构或其子公司自有资金投资被动超标、需要退出自有资金的，不受持有期限不少于 6 个月的限制，且管理人无须按照上述约定提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人并取得其同意，但管理人将在自有资金退出后，及时通过管理人网站告知全体投资者和托管人，并按相关监管要求进行报告。</u> 为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与或退出本集合计划可不受本条前述按相关法律法规要求执行的限制，但需事后及时通过管理人网站公告告知投资者和托管人，并按相关监管要求进行报告。 <u>全体投资者、托管人同意，前述内容如法律法规或监管部门另有规定的，按其规定处理，管理人通过本合同约定的信息披露方式告知投资者和托管人相关事宜，无须另行履行合同变更程序。</u>
第三十二条 资产管理计划的投资	

..... (二) 投资范围及比例 2、投资比例 (4) 集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 200%。 (6) 本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时, 所申报的金额不得超过本集合计划的总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。 (三) 投资比例超限的处理方式及流程 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非因管理人主观因素导致突破本合同或法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例限制的, 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 15 个交易日内调整至符合要求, 并按相关规定报告或备案。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的, 应当按照相关规定及时报告或备案。 (七) 投资限制 全体投资者同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易。交易完成 5 个工作日内, 管理人应书面通知托管人, 通过管理人的网站告知投资者, 并按相关规定报告或备案。 	 (二) 投资范围及比例 (4) 集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 200%; 除国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种外, 如集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产的 50%, 集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 120%。 (6) 本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时, 所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产, 所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。 (三) 投资比例超限的处理方式及流程 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资产管理计划投资不符合本合同或法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例和投资限制的, 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要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的, 应当按照相关规定及时报告。 (七) 投资限制 (删除) 全体投资者同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易。交易完成 5 个工作日内, 管理人应书面通知托管人, 通过管理人的网站告知投资者, 并按相关规定报告或备案。
第三十五条 集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形	
本集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形包括但不限于: (一) 管理人或将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制	本集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形包括但不限于: (一) 从事关联交易, 包括重大关联交易和一般关联交易。

人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易；

（二）管理人及其附属机构有权以自有资金参与本集合计划；

（三）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方均有权参与本集合计划；

（四）其他可能产生利益冲突的情形。

关联方按照《企业会计准则》的规定确定。本集合计划关联方指管理人、托管人、投资顾问及前述机构的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司。本集合计划不聘请投资顾问，投资者可通过管理人网站、托管人年度报告查阅本集合计划的关联方。

关联交易是指资产管理计划与管理人、托管人、投资顾问及其关联方之间发生的交易，具体包括：1）在一级市场买入管理人关联方、托管人及其关联方、投资顾问及其关联方承销期内承销的证券（不含资产管理产品）；2）买入管理人及其关联方、托管人及其关联方、投资顾问及其关联方发行的证券（不含资产管理产品）；3）认购或申购管理人及其关联方、托管人及其关联方管理的资产管理产品、资产支持证券；4）开展以管理人及其关联方发行的证券为质押品的逆回购交易；5）租用管理人关联方的证券交易单元；6）与管理人或其关联方进行对手方交易（含转融通出借、融资融券、场外衍生品等）。

其中重大关联交易指：1）投资于管理人及其关联方发行的证券（不含资产管理产品）或投资于管理人的关联方管理的资产支持证券，且单日交易金额合计达到资产管理计划资产净值的5%以上；2）投资于管理人的关联方承销期内承销的证券（不含资产管理产品、含资产支持证券），且单笔交易金额达到资产管理计划资产净值的10%以上的一级市场交易；3）与管理人及其关联方开展场外衍生品交易时，单笔交易可能造成的最大损失达到资产管理计划资产净值的10%以上。

一般关联交易指除重大关联交易以外的关联交易。

管理人有权根据法律法规、监管部门、管理人内部制度等相关要求更新修改关联交易、重大关联交易、一般关联交易的定义或认定标准，并通过本合同约定的信息披露方式告知投资者和托管人相关事宜，无须另行履行合同变更程序。

（二）证券期货经营机构及其子公司有权以自有资金参与、退出本集合计划。

（三）管理人的董事、监事、从业人员

	及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方均有权参与本集合计划。 (四) 其他可能产生利益冲突的情形。
第三十六条 利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率	
管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度,采取有效措施,做好充分的信息隔离和利益冲突管理,遵循投资者利益优先的原则,防范、管控可能的利益冲突。管理人运用资产管理计划财产从事关联交易的,事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露;运用资产管理计划财产从事重大关联交易的,事先取得投资者同意,并避免损害投资者利益。具体安排包括: (一) 投资者签署本合同即视为其授权管理人可以从事本合同第三十五条第(一)款情形下的关联交易,管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定,在交易完成后及时书面通知托管人,通过管理人的网站告知投资者,并按相关规定报告或备案。 (二) 若涉及了本合同第三十五条第(二)款利益冲突情形的,管理人及其附属机构应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定,与集合计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险。 集合计划存续期间,管理人自有资金参与计划的持有期限不得少于6个月,参与、退出时,提前5个工作日通过管理人网站公告告知投资者和托管人。为避免争议,发生本合同第二十六条第一款管理人自有资金参与比例超标时,管理人退出部分自有资金,不受本款持有期限不少于6个月和提前5个工作日的限制。 为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险,或者中国证监会认可的其他情形,在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下,管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出本集合计划可不受本合同第二十六条第一款和第二款限制,但事后将及时通过管理人网站公告告知投资者和托管人,并根据相关规定报告。 (三) 若涉及了本合同第三十五条第(三)款利益冲突情形的,管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及	管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度,采取有效措施,做好充分的信息隔离和利益冲突管理,遵循投资者利益优先的原则,防范、管控可能的利益冲突。具体安排包括: (一) 管理人将建立健全关联交易内部管控机制;在投资决策时,投资经理确定好拟投资的具体品种、规模和时机后,管理人将通过系统或人工的方式对每笔投资进行事前监控和审批,判断其是否属于本合同约定的重大关联交易或一般关联交易。 若涉及本合同第三十五条第(一)款中的重大关联交易,在开展重大关联交易前,管理人将选择通过管理人网站公告、电子邮件(管理人联系邮箱为:tengyi@citics.com、song_yi@citics.com,前述邮箱如有变更,管理人将选择通过管理人网站公告、电子邮件、电话、短信等任意一种或多种方式告知投资者,无须履行合同变更程序)、电话、短信等任意一种或多种方式向全体投资者征询意见。 若投资者不同意该笔重大关联交易的,应当按照管理人征询通知中要求的方式并在管理人征询通知中限定的期限内及时向管理人明确反馈不同意的意见。 如果投资者未按照管理人征询通知中要求的方式进行反馈,或未在管理人征询通知中限定的期限内及时反馈,或在反馈中意见表示不明确的,则均视为投资者同意进行该笔重大关联交易。 在获得全体投资者同意后,管理人可以从事该笔重大关联交易,管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定,在交易完成后,管理人将及时书面通知托管人、通过管理人网站告知投资者,并按相关监管要求进行报告。 投资者签署本合同即视为其授权管理人可以将本集合计划资产从事本合同第三十五条第(一)款中的一般关联交易。管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规

本合同的约定，该部分投资者与集合计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险。管理人将及时向投资者进行披露，并对该资产管理计划账户进行监控，以及根据相关规定及时进行报告。 （四）若管理人涉及了其他利益冲突情形的，管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，及时履行相应的信息披露义务。	定以及本合同的约定，在交易完成后，管理人将及时书面通知托管人、通过管理人网站告知投资者，并按相关监管要求进行报告。 （二）若涉及了本合同第三十五条第（二）款利益冲突情形的，证券期货经营机构及其子公司将严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，按照法律法规及本合同第二十六条的约定履行意见征询、信息披露、监管报告等程序，与集合计划其他投资者份额享有同等权益、承担同等风险，严格遵守法律法规和监管要求的持有期限、投资比例等要求。 （三）若涉及了本合同第三十五条第（三）款利益冲突情形的，管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，该部分投资者与集合计划其他投资者份额享有同等权益、承担同等风险。管理人将及时向投资者进行披露，并对该资产管理计划账户进行监控，以及根据相关规定及时进行报告。 （四）若管理人涉及了其他利益冲突情形的，管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，及时履行相应的信息披露义务。 前述内容如法律法规或监管部门另有规定的，按其规定处理，管理人通过本合同约定的信息披露方式告知投资者和托管人相关事宜，无须另行履行合同变更程序。
第四十二条 集合计划的估值	
..... （三）估值方法 1、债权类资产估值方法 （1）银行存款以成本列示，按商定的存款利率以当日银行营业终了的存款余额为基数在实际持有期间内逐日计提应收利息。 （2）回购以成本列示，按实际利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。 （3）同一债权类资产同时在两个或两个以上市场交易的，按债权类资产所处的市场分别估值。 （4）对银行间市场的债权类资产按中央国债登记结算有限责任公司提供的债券估值数据进行估值。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权类资	 （三）估值方法 1、债权类资产估值方法 （1）银行存款以成本列示，按商定的存款利率以当日银行营业终了的存款余额为基数在实际持有期间内逐日计提应收利息。 （2）同一债权类资产同时在两个或两个以上市场交易的，按债权类资产所处的市场分别估值。 （3）银行间市场的债权类资产按中央国债登记结算有限责任公司提供的估值价格进行估值。 （4）证券交易所上市交易的实行全价交易的可转换公司债券以估值日收盘价作为估值全价；证券交易所上市交易的实行净价交

产,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。

(5)交易所上市交易的可转换公司债券以每日收盘价作为估值全价。

(6)交易所上市交易或挂牌转让的其他债权类资产按中证指数有限公司提供的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值。

(7)对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债权类资产,存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,应采用估值技术确定其公允价值。

2、股权类资产估值方法

上市流通的股票和存托凭证,以其估值日在证券交易所挂牌的市价(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,且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件,以最近交易日的市价(收盘价)估值。

交易所发行未上市品种的估值:

①送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票和存托凭证,按估值日交易所上市的同一股票或存托凭证的收盘价估值,该日无交易的,以最近一交易日收盘价计算。

②首次发行未上市的股票和存托凭证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,按成本估值。

③首次公开发行有明确锁定期的股票和存托凭证,同一股票或存托凭证在交易所上市后,按估值日交易所上市的同一股票或存托凭证的收盘价估值,该日无交易的,以最近一交易日收盘价计算。

④通过非公开发行等其他方式获取且有明确锁定期的股票和存托凭证,按以下方法估值:

估值日在证券交易所上市交易的同一股票或存托凭证的收盘价低于非公开发行股票或存托凭证的初始取得成本时,可采用在证券交易所上市交易的同一股票或存托凭证的

易的可转换公司债券以估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

(5)证券交易所上市交易或挂牌转让的其他债权类资产按中证指数有限公司提供的估值价格进行估值。

(6)对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的债权类资产,应采用估值技术确定其公允价值。

(7)持有型不动产资产支持证券按照法律法规规定确定其公允价值。

2、股权类资产估值方法

上市流通的股票,以其估值日在证券交易所挂牌的市价(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,且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件,以最近交易日的市价(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,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。

优先股按照第三方估值机构提供的估值数据进行估值。第三方估值机构未提供估值价格的,应采用估值技术确定其公允价值,若有股息率的则按照该优先股约定的股息率每日计提收益。

证券交易所发行未上市品种的估值:

①送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票,按估值日交易所上市的同一股票的收盘价估值,该日无交易的,以最近一交易日收盘价计算。

②首次公开发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下,可采用发行价格估值。

③在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,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

“港股通”标的证券估值方法按照交易所、登记公司、监管机构公布准则执行。汇率使用中登汇率。

收盘价作为估值日该非公开发行股票或存托凭证的价值；

估值日在证券交易所上市交易的同一股票或存托凭证的收盘价高于非公开发行股票或存托凭证的初始取得成本时，可按下列公式确定估值日该非公开发行股票或存托凭证的价值：

$$FV = C + (P - C) \times \frac{D_t - D_r}{D_t}$$

其中：FV 为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票或存托凭证的价值；C 为该非公开发行有明确锁定期的股票或存托凭证的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得成本作相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票或存托凭证的收盘价； D_t 为该非公开发行有明确锁定期的股票或存托凭证锁定期所含的交易日的交易天数； D_r 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易日的交易天数（不含估值日当天）。

通过非公开发行等其他方式获取且有明确锁定期的股票和存托凭证自锁定期起始日开始估值，锁定期起始日为上市公司发布公告日。

计划中持有的已停牌股票若其停牌期限超过 31 个自然日且潜在估值调整对前一估值日计划资产净值影响在 0.25% 以上的，相关停牌股票采用“指数收益法”进行估值。其中指数为停牌股票所在的中国证券投资基金业协会的行业指数（AMAC）。

“港股通”股票估值方法按照交易所、登记公司、监管机构公布准则执行。汇率按中国结算使用的汇率执行。

3、基金估值方法

开放式公募证券投资基金（包括场外购买的上市型开放式基金 LOF）以估值日基金净值估值；估值日基金净值未能及时公布的，以前最近公布的基金净值估值。交易所上市交易的基金（含分级基金），以估值日收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。

3、基金估值方法

证券交易所上市交易的公募基金（不含货币市场基金、LOF 基金），按估值日收盘价估值；估值日无交易的，按最近交易日的收盘价估值。境内上市开放式基金（LOF 基金），按所投资基金估值日的份额净值估值。非上市交易的公募基金（不含货币市场基金）按估值日基金份额净值估值；估值日基金份额净值未公布的，按此前最近公布的基金份额净值估值。

上市交易型货币市场基金，如披露份额净值，则按估值日基金份额净值估值，如披露万份（百份）收益，则按前一估值日至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提基金收益。非上市交易型货币市场基金，按前一估值日至估值日期间（含节假日）的万份收益计提基金收益。

如遇到基金拆分、到期、转型及封转开等情况，管理人应根据基金公告与托管人共同协商确定估值办法。

4、回购以成本列示，按实际利率在回购期间内逐日计提应收或应付利息。

.....

（五）估值程序

日常估值由管理人进行，托管人进行复核。用于披露的资产净值由管理人完成估值后将估值结果交托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核，由管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与本集合计划会计账目的核对同时进行。集合计划每份额净值的估值结果精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。各方一致同意，管理人有权启用份额净值精度应急调整机制，即管理人可视赎回情况在一定时间内临时提高本集合计划的份额净值精度。如启用份额净值精度应急调整机制，管理人将不再另行公告。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

持有的市值型货币市场基金以估值日基金净值估值；持有的非市值型货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日每万份收益计提红利。 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值。 如遇到基金拆分、到期、转型及封转开等情况，管理人应根据基金公告与托管人共同协商确定估值办法。 （五）估值程序 日常估值由管理人进行，托管人进行复核。用于披露的资产净值由管理人完成估值后将估值结果交托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核，由管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与本集合计划会计账目的核对同时进行。	
第四十八条 其他事项：	
..... <u>集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。各方一致同意，根据国家法律法规、部门规章和其他规范性文件，如果本集合计划的运营过程中产生增值税等应税行为，需要缴纳增值税等税费的，管理人有权从集合计划资产中提取与应承担税费等额的费用。具体提取时间及提取金额参考相关税费征缴情况由管理人确定，由托管人根据管理人划款指令从集合计划资产中支付给管理人。</u>	 <u>集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。各方一致同意，根据国家法律法规、部门规章和其他规范性文件，如果本集合计划的运营过程中产生增值税等应税行为，需要缴纳增值税等税费的，管理人有权从集合计划资产中提取与应承担税费等额的费用。具体提取时间及提取金额参考相关税费征缴情况由管理人确定，由托管人根据管理人划款指令从集合计划资产中支付给管理人。在投资者赎回份额或本集合计划终止后，根据法律法规规定，税务机关要求补缴本集合计划投资运作过程中产生的税费的（包括但不限于所投资的资产被要求补缴税费的），管理人有权向投资者按投资者持有期应分摊的补缴金额进行追偿。</u>
第五十一条 披露信息的种类、内容、频率和方式	
..... （三）披露信息的方式 除特别明确约定外，本合同中约定的管理人向投资者进行的通知、通告、告知等都通过管理人网站（www.cs.ecitic.com）向投资者披露，不另行单独通知投资者。	 （三）披露信息的方式 除特别明确约定外，本合同中约定的管理人向投资者进行的通知、通告、告知等都通过管理人网站（www.citicsam.com）向投资者披露，不另行单独通知投资者。

	<u>(增加)</u> 本集合计划每份额净值的估值结果精确到 0.0001 元, 小数点后第 5 位四舍五入, 但管理人可能视赎回情况启用份额净值精度应急调整机制, 在一定时间内临时提高本集合计划的份额净值精度。因为技术系统等原因, 本集合计划的销售机构可能无法按提高后的份额净值精度进行展示, 投资者可以通过管理人网站查阅本集合计划准确的份额净值。
第五十六条	
本集合资产管理计划面临的风险, 包括但不限于: (二) 一般风险揭示 9、投资者参与、退出集合计划风险 <u>(2) 出现拒绝或暂停接受投资者参与(退出)的情况导致投资者不能及时参与(退出)的风险, 具体参见本合同“集合计划的参与、退出与转让”章约定。</u> 13、关联交易的风险 管理人可能将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易, 相关投资存在一定风险, 提请投资者知悉、充分关注, 投资者签订本合同即代表投资者认可同意上述关联交易并自愿承担相关风险。 	本集合资产管理计划面临的风险, 包括但不限于: <u>(二) 一般风险揭示</u> 9、投资者参与、退出集合计划风险 <u>(2) 出现拒绝或暂停接受投资者参与(退出)的情况时, 可能导致投资者不能及时参与(退出)的风险。如确认 T 日的退出、转出(如有)申请将导致本集合计划投资者少于 2 人, 管理人可能拒绝本集合计划 T 日全部的退出、转出(如有)申请, 如果管理人此时拒绝本集合计划 T 日全部的退出、转出(如有)申请, 则本集合计划在拒绝退出、转出(如有)申请的下一个工作日前(含该日)终止, 因此存在触发本集合计划提前终止的风险。具体参见本合同“集合计划的参与、退出与转让”章约定。</u> <u>(增加)</u> (7) 存续期内, 证券期货经营机构或其子公司自有资金参与或退出本集合计划的, 管理人采用管理人网站公告的方式征询全体投资者的意见, 不会单独通知每个投资者, 可能存在投资者没有及时查阅管理人网站相关信息, 从而投资者未第一时间获知证券期货经营机构及其子公司的自有资金参与或退出安排的风险, 并可能进而导致投资者未及时办理其持有的本集合计划全部份额的退出事宜, 而被视为反馈了同意意见的情形, 从而可能存在证券期货经营机构或其子公司的自有资金参与或退出与投资者主观意愿不相符的风险。

**13、从事重大关联交易、一般关联交易
所涉风险**

管理人可能运用资产管理计划财产从事关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、充分关注。同时，托管人关联方名单由托管人提供，可能存在托管人不提供前述名单或提供名单不及时、不完整、不准确的情形。投资者可能面临因本计划关联方名单的获取、界定、识别不准确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关关联交易，以至于本集合计划从事前述关联交易未能事后及时向投资者披露的风险、或者从事前述相关重大关联交易未事先再单独征询投资者意见的风险及其他可能的相关风险，也可能存在投资者认知的本计划关联方、一般和重大关联交易的区分标准与托管人提供的名单及管理人采用的名单和标准不完全一致的风险。

此外，投资者一旦签署本合同即代表投资者同意管理人从事除重大关联交易以外的一般关联交易，管理人将不会另行逐笔事先征询投资者的意见，因此存在投资者无法事前知悉每笔一般关联交易的风险。同时，管理人从事重大关联交易的，会事先征询全体投资者的意见，但管理人征询的方式、投资者反馈的方式和时限均由管理人确定，可能存在投资者在管理人或销售机构留存的通讯信息（包括但不限于联系电话/手机、通讯地址、住所地、电子邮箱等）不准确、未更新而导致管理人无法及时通知到投资者，或发生投资者未及时查阅相关信息导致最终未及时反馈意见的风险；或发生因投资者未按照管理人通知中要求的时间和方式进行反馈、或在反馈中意见表示不明确，而被视为反馈了同意意见的情形，从而可能存在进行该笔重大关联交易与投资者主观意愿不相符的风险。

同时，管理人可能通过本合同约定的信息披露方式更新修改关联交易、重大关联交易、一般关联交易的定义或认定标准，可能存在投资者未及时查阅相关信息导致投资者理解的关联交易事项与实际监控标准不一致的风险。

.....

	<u>(增加) 17、管理人可能启用份额净值精度应急调整机制的风险</u> <u>本集合计划每份额净值的估值结果精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，但管理人可能视赎回情况启用份额净值精度应急调整机制，在一定时间内临时提高本集合计划的份额净值精度。因为技术系统等原因，本集合计划的销售机构可能无法按提高后的净值精度进行展示，导致投资者在销售机构与在管理人网站查询的份额净值不同，进而存在投资者按照销售机构展示的份额净值计算的申购份额、赎回金额与登记结算机构的确认结果不一致的风险，请投资者对此充分知悉。</u> <u>另外，如启用份额净值精度应急调整机制（包括提高或恢复份额净值精度等），管理人将不再另行公告。可能存在投资者无法提前获知本集合计划份额净值精度调整的相关事宜，并进而导致本集合计划的份额净值与投资者自行计算的结果不一致的风险。</u>
第五十七条 合同变更	
<u>(一) 一般情形下合同变更的方式及程序：</u> <u>2、管理人有权在合同变更征询期对本集合计划设置特殊赎回开放日，不同意合同变更的投资者，应在该赎回开放日办理本集合计划的退出事宜，投资者未退出的视为同意合同变更。本资产管理合同变更生效后，投资者有权在任何开放日按照本资产管理合同的相关约定申请退出。</u> 	<u>(一) 一般情形下合同变更的方式及程序：</u> <u>2、管理人有权在合同变更征询期对本集合计划设置特殊赎回开放日，不同意合同变更的投资者，应在该赎回开放日办理本集合计划的退出事宜，投资者未退出的视为同意合同变更。征询期结束后，如本集合计划投资者不少于 2 个，则该次合同变更事项将于管理人公告中记载的合同变更生效日起正式生效。本资产管理合同变更生效后，投资者有权在任何开放日按照本资产管理合同的相关约定申请退出。</u>
第六十条	
<u>各方在此一致同意，出现下列情形之一时，本集合计划应当终止：</u> <u>(五) 存续期内，本集合计划的投资者少于 2 人，且管理人决定终止的；但若发生持续五个工作日本集合计划的投资者少于 2 人的，则本集合计划自动终止；</u>	<u>各方在此一致同意，出现下列情形之一时，本集合计划应当终止：</u> <u>(增加)(五) 存续期内，如确认 T 日的退出、转出（如有）申请将导致本集合计划投资者少于 2 人，且管理人拒绝本集合计划 T 日全部的退出、转出（如有）申请的，则本</u>

.....	集合计划在管理人拒绝退出、转出（如有）申请的下一个工作日前（含该日）终止； （六）存续期内，本集合计划的投资者少于 2 人，且管理人决定终止的；但若发生持续 5 个工作日本集合计划的投资者少于 2 人的，则本集合计划自动终止； <i>（后续条款序号按顺序调整）</i>
-------	--

附件二：中信证券新制造 1 号集合资产管理计划说明书变更条款对照表

变更前	变更后
根据管理人发布的《关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告》，本集合计划的管理人于 2023 年 11 月 1 日起由“中信证券股份有限公司”变更为“中信证券资产管理有限公司”，因此相应修改与管理人主体变更相关的内容： 1、原说明书中所涉及的管理人“中信证券股份有限公司”均更新为“中信证券资产管理有限公司”； 2、原说明书中所涉及的管理人网站网址均更新为“www.citicsam.com”； 3、原说明书中所涉及的“资产管理部”均更新为“管理人”； 4、原说明书中与此次变更后的内容不一致之处，以此次变更后的内容为准。	
一、集合计划基本信息	
封闭期、开放期： 1、开放期：本集合计划成立满 6 个月后，每月的首个工作日为开放期，投资者可以在开放期办理参与、退出业务（管理人通告暂停参与、退出时除外）。	封闭期、开放期： 1、开放期：每个星期一为开放日（如遇非工作日不开放、不顺延），投资者可以在开放期办理参与、退出业务（管理人通告暂停参与、退出时除外）。
二、集合计划当事人	
管理人 名称：中信证券股份有限公司 住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 法定代表人：张佑君 通讯地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 联系电话：95548 转 5 公司网址：www.cs.ecitic.com 中信证券股份有限公司成立于 1995 年 10 月，2003 年在上海证券交易所挂牌上市交易，2011 年在香港联合交易所挂牌上市交易，是中国第一家 A+H 股上市的证券公司。公司收入和净利润连续十多年保持行业第一；净资本、净资产和总资产等规模优势显著；各项业务保持市场领先地位，在国内市场积累了广泛的声誉和品牌优势。公司多年来获得亚洲货币、英国金融时报、福布斯、沪深证券交易所等境内外机构颁发的各类奖项。	管理人： 名称：中信证券资产管理有限公司 住所：北京市丰台区金丽南路 3 号院 2 号楼 1 至 16 层 01 内六层 1-288 室 法定代表人：杨冰 通讯地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 16 层 联系电话：95548 转 5 中信证券资产管理有限公司成立于 2023 年 3 月 1 日，主要从事证券资产管理业务，致力于以专业的投研力量、完整的产品体系、周到的客户服务为投资者创造价值，为支持经济转型发展和满足人民群众财富管理需求提供高质量的综合资产管理服务。
三、投资范围及投资限制	
投资范围及比例： 2、投资比例 （4）集合资产管理计划的总资产占净资	投资范围及比例： 2、投资比例

产的比例不超过 200%。 (6) 本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时, 所申报的金额不得超过本集合计划的总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。 投资限制: 全体投资者同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易。交易完成 5 个工作日内, 管理人应书面通知托管人, 通过管理人的网站告知投资者, 并按相关规定报告或备案。 	(4) 集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 200%; 除国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种外, 如集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产的 50%, 集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 120%。 (6) 本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时, 所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产, 所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。 投资限制: (删除) 全体投资者同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券, 或者从事其他重大关联交易。交易完成 5 个工作日内, 管理人应书面通知托管人, 通过管理人的网站告知投资者, 并按相关规定报告或备案。
五、集合计划费用、业绩报酬	
参与、退出费: 参与费 (认购/申购费率): 1%; 退出费: 投资者持有不满 365 天的本集合计划份额, 退出费率为 0.15%, 持有满 365 天的本集合计划份额, 退出费率为 0%; 其他事项: 集合计划运作过程中涉及的各纳税主体, 依照国家法律法规的规定履行纳税义务。各方一致同意, 根据国家法律法规、部门规章和其他规范性文件, 如果本集合计划的运营过程中产生增值税等应税行为, 需要缴纳增值税等税费的, 管理人有权从集合计划资产中提取与应承担税费等额的费用。具体提取时间及提取金额参考相关税费征缴情况由管理人确定, 由托管人根据管理人划款指令	参与、退出费: 参与费 (认购/申购费率): 1%; 退出费: 投资者持有不满 365 天的本集合计划份额, 退出费率为 0.1%, 持有满 365 天的本集合计划份额, 退出费率为 0%; 其他事项: 集合计划运作过程中涉及的各纳税主体, 依照国家法律法规的规定履行纳税义务。各方一致同意, 根据国家法律法规、部门规章和其他规范性文件, 如果本集合计划的运营过程中产生增值税等应税行为, 需要缴纳增值税等税费的, 管理人有权从集合计划资产中提取与应承担税费等额的费用。具体提取时间及提取金额参考相关税费征缴情况由管理人确定, 由托管人根据管理人划款指令从集合计划资产中支

从集合计划资产中支付给管理人。	付给管理人。在投资者赎回份额或本集合计划终止后，根据法律法规规定，税务机关要求补缴本集合计划投资运作过程中产生的税费的（包括但不限于所投资的资产被要求补缴税费的），管理人有权向投资者按投资者持有期应分摊的补缴金额进行追偿。																
七、集合计划的参与及退出																	
..... 退出的原则： （5）退出款项计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产损益； 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式： 6、合同约定、法律法规规定或中国证监会认定的其它情形。 参与和退出的费用： 参与费用由投资者另行承担，主要用于支付市场销售等各项费用，不列入集合计划资产。 本集合计划的参与费率为1%。 退出费用由投资者另行承担，本集合计划的退出费率如下： <table border="1" data-bbox="236 1370 778 1541"> <tr> <th>持有期限（D）</th><th>退出费率</th></tr> <tr> <td>D<365天</td><td>0.15%</td></tr> <tr> <td>365天≤D</td><td>0%</td></tr> <tr> <td>集合计划终止或清算</td><td>0%</td></tr> </table> 	持有期限（D）	退出费率	D<365天	0.15%	365天≤D	0%	集合计划终止或清算	0%	 退出的原则： （增加）（5）如确认T日的退出、转出（如有）申请将导致本集合计划投资者少于2人的，管理人有权拒绝本集合计划T日全部的退出、转出（如有）申请并应在拒绝退出、转出（如有）申请的下一个工作日前（含该日）终止本集合计划； （6）退出款项计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产损益； （后续条款序号按顺序调整） 拒绝或暂停参与、退出的情形及处理方式： （增加）6、如确认T日的退出、转出（如有）申请将导致本集合计划投资者少于2人的，管理人有权拒绝本集合计划T日全部的退出、转出（如有）申请并应在拒绝退出、转出（如有）申请的下一个工作日前（含该日）终止本集合计划； 7、合同约定、法律法规规定或中国证监会认定的其它情形。 参与和退出的费用： 参与费用由投资者另行承担，主要用于支付市场销售等各项费用，不列入集合计划资产。 本集合计划的参与费率为1%。 退出费用由投资者另行承担，本集合计划的退出费率如下： <table border="1" data-bbox="794 1832 1353 1998"> <tr> <th>持有期限（D）</th><th>退出费率</th></tr> <tr> <td>D<365天</td><td>0.1%</td></tr> <tr> <td>365天≤D</td><td>0%</td></tr> <tr> <td>集合计划终止或清算</td><td>0%</td></tr> </table>	持有期限（D）	退出费率	D<365天	0.1%	365天≤D	0%	集合计划终止或清算	0%
持有期限（D）	退出费率																
D<365天	0.15%																
365天≤D	0%																
集合计划终止或清算	0%																
持有期限（D）	退出费率																
D<365天	0.1%																
365天≤D	0%																
集合计划终止或清算	0%																

	
八、信息披露	
..... 披露信息的方式： 除特别明确约定外，《集合资产管理合同》中约定的管理人向投资者进行的通知、通告、告知等都通过管理人网站（www.cs.ecitic.com）向投资者披露，不另行单独通知投资者。	 披露信息的方式 除特别明确约定外，《集合资产管理合同》中约定的管理人向投资者进行的通知、通告、告知等都通过管理人网站（www.citicsam.com）向投资者披露，不另行单独通知投资者。 <u>本集合计划每份额净值的估值结果精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入，但管理人可能视赎回情况启用份额净值精度应急调整机制，在一定时间内临时提高本集合计划的份额净值精度。因为技术系统等原因，本集合计划的销售机构可能无法按提高后的份额净值精度进行展示，投资者可以通过管理人网站查阅本集合计划准确的份额净值。</u>
十一、集合计划终止和清算	
集合计划的终止： 各方在此一致同意，出现下列情形之一时，本集合计划应当终止： （五）存续期内，本集合计划的投资者少于2人，且管理人决定终止的；但若发生持续五个工作日本集合计划的投资者少于2人的，则本集合计划自动终止； 	集合计划的终止： 各方在此一致同意，出现下列情形之一时，本集合计划应当终止： <i>（增加）</i>（五）存续期内，如确认T日的退出、转出（如有）申请将导致本集合计划投资者少于2人，且管理人拒绝本集合计划T日全部的退出、转出（如有）申请的，则本集合计划在管理人拒绝退出、转出（如有）申请的下一个工作日前（含该日）终止； （六）存续期内，本集合计划的投资者少于2人，且管理人决定终止的；但若发生持续5个工作日本集合计划的投资者少于2人的，则本集合计划自动终止； <i>（后续条款序号按顺序调整）</i>
十二、利益冲突及其他重要事项	
本集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形包括但不限于： （一）管理人或将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易； （二）管理人及其附属机构有权以自有	本集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形包括但不限于： （一）从事关联交易，包括重大关联交易和一般关联交易。 关联方按照《企业会计准则》的规定确定。本集合计划关联方指管理人、托管人、投资顾问及前述机构的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司。本

资金参与本集合计划；

(三) 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方均有权参与本集合计划；

(四) 其他可能产生利益冲突的情形。

管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，采取有效措施，做好充分的信息隔离和利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范、管控可能的利益冲突。管理人运用资产管理计划财产从事关联交易的，事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露；运用资产管理计划财产从事重大关联交易的，事先取得投资者同意，并避免损害投资者利益。

集合计划不聘请投资顾问，投资者可通过管理人网站、托管人年度报告查阅本集合计划的关联方。

关联交易是指资产管理计划与管理人、托管人、投资顾问及其关联方之间发生的交易，具体包括：1) 在一级市场买入管理人关联方、托管人及其关联方、投资顾问及其关联方承销期内承销的证券（不含资产管理产品）；2) 买入管理人及其关联方、托管人及其关联方、投资顾问及其关联方发行的证券（不含资产管理产品）；3) 认购或申购管理人及其关联方、托管人及其关联方管理的资产管理产品、资产支持证券；4) 开展以管理人及其关联方发行的证券为质押品的逆回购交易；5) 租用管理人关联方的证券交易单元；6) 与管理人或其关联方进行对手方交易（含转融通出借、融资融券、场外衍生品等）。

其中重大关联交易指：1) 投资于管理人及其关联方发行的证券（不含资产管理产品）或投资于管理人的关联方管理的资产支持证券，且单日交易金额合计达到资产管理计划资产净值的 5%以上；2) 投资于管理人的关联方承销期内承销的证券（不含资产管理产品、含资产支持证券），且单笔交易金额达到资产管理计划资产净值的 10%以上的一级市场交易；3) 与管理人及其关联方开展场外衍生品交易时，单笔交易可能造成的最大损失达到资产管理计划资产净值的 10%以上。

一般关联交易指除重大关联交易以外的关联交易。

管理人有权根据法律法规、监管部门、管理人内部制度等相关要求更新修改关联交易、重大关联交易、一般关联交易的定义或认定标准，并通过《集合资产管理合同》约定的信息披露方式告知投资者和托管人相关事宜，无须另行履行合同变更程序。

(二) 证券期货经营机构及其子公司有权以自有资金参与、退出本集合计划。

(三) 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方均有权参与本集合计划。

(四) 其他可能产生利益冲突的情形。

利益冲突的处理方式、披露方式、披露

内容以及披露频率：

管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，采取有效措施，做好充分的信息隔离和利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范、管控可能的利益冲突。具体安排包括：

（一）管理人将建立健全关联交易内部管控机制：在投资决策时，投资经理确定好拟投资的具体品种、规模和时机后，管理人将通过系统或人工的方式对每笔投资进行事前监控和审批，判断其是否属于《集合资产管理合同》约定的重大关联交易或一般关联交易。

若涉及《集合资产管理合同》第三十五条第（一）款中的重大关联交易，在开展重大关联交易前，管理人将选择通过管理人网站公告、电子邮件（管理人联系邮箱为：tengyi@citics.com、song_yi@citics.com，前述邮箱如有变更，管理人将选择通过管理人网站公告、电子邮件、电话、短信等任意一种或多种方式告知投资者，无须履行合同变更程序）、电话、短信等任意一种或多种方式向全体投资者征询意见。

若投资者不同意该笔重大关联交易的，应当按照管理人征询通知中要求的方式并在管理人征询通知中限定的期限内及时向管理人明确反馈不同意的意见。

如果投资者未按照管理人征询通知中要求的方式进行反馈，或未在管理人征询通知中限定的期限内及时反馈，或在反馈中意见表示不明确的，则均视为投资者同意进行该笔重大关联交易。

在获得全体投资者同意后，管理人可以从事该笔重大关联交易，管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及《集合资产管理合同》的约定，在交易完成后，管理人将及时书面通知托管人、通过管理人网站告知投资者，并按相关监管要求进行报告。

投资者签署《集合资产管理合同》即视为其授权管理人可以将本集合计划资产从事《集合资产管理合同》第三十五条第（一）款中的一般关联交易。管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及《集

	合资产管理合同》的约定，在交易完成后，管理人将及时书面通知托管人、通过管理人网站告知投资者，并按相关监管要求进行报告。 （二）若涉及了《集合资产管理合同》第三十五条第（二）款利益冲突情形的，证券期货经营机构及其子公司将严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及《集合资产管理合同》的约定，按照法律法规及《集合资产管理合同》第二十六条的约定履行意见征询、信息披露、监管报告等程序，与集合计划其他投资者份额享有同等权益、承担同等风险，严格遵守法律法规和监管要求的持有期限、投资比例等要求。 （三）若涉及了《集合资产管理合同》第三十五条第（三）款利益冲突情形的，管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及《集合资产管理合同》的约定，该部分投资者与集合计划其他投资者份额享有同等权益、承担同等风险。管理人将及时向投资者进行披露，并对该资产管理计划账户进行监控，以及根据相关规定及时进行报告。 （四）若管理人涉及了其他利益冲突情形的，管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及《集合资产管理合同》的约定，及时履行相应的信息披露义务。 前述内容如法律法规或监管部门另有规定的，按其规定处理，管理人通过《集合资产管理合同》约定的信息披露方式告知投资者和托管人相关事宜，无须另行履行合同变更程序。
十三、风险揭示	
..... （二）一般风险揭示 9、投资者参与、退出集合计划风险 （2）出现拒绝或暂停接受投资者参与（退出）的情况导致投资者不能及时参与（退出）的风险，具体参见《集合资产管理合同》“集合计划的参与、退出与转让”章约定。 	 （二）一般风险揭示 9、投资者参与、退出集合计划风险 （2）出现拒绝或暂停接受投资者参与（退出）的情况时，可能导致投资者不能及时参与（退出）的风险。如确认T日的退出、转出（如有）申请将导致本集合计划投资者少于2人，管理人可能拒绝本集合计划T日全部的退出、转出（如有）申请，如果管理

13、关联交易的风险

管理人可能将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、充分关注，投资者签订《集合资产管理合同》即代表投资者认可同意上述关联交易并自愿承担相关风险。

.....

人此时拒绝本集合计划 T 日全部的退出、转出（如有）申请，则本集合计划在拒绝退出、转出（如有）申请的下一个工作日前（含该日）终止，因此存在触发本集合计划提前终止的风险。具体参见《集合资产管理合同》“集合计划的参与、退出与转让”章节约定。

.....

（增加）（7）存续期内，证券期货经营机构或其子公司自有资金参与或退出本集合计划的，管理人采用管理人网站公告的方式征询全体投资者的意见，不会单独通知每个投资者，可能存在投资者没有及时查阅管理人网站相关信息，从而投资者未第一时间获知证券期货经营机构及其子公司的自有资金参与或退出安排的风险，并可能进而导致投资者未及时处理其持有的本集合计划全部份额的退出事宜，而被视为反馈了同意意见的情形，从而可能存在证券期货经营机构或其子公司的自有资金参与或退出与投资者主观意愿不相符的风险。

.....

13、从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险

管理人可能运用资产管理计划财产从事关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、充分关注。同时，托管人关联方名单由托管人提供，可能存在托管人不提供前述名单或提供名单不及时、不完整、不准确的情形。投资者可能面临因本计划关联方名单的获取、界定、识别不准确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关关联交易，以至于本集合计划从事前述关联交易未能事后及时向投资者披露的风险、或者从事前述相关重大关联交易未事先再单独征询投资者意见的风险及其他可能的相关风险，也可能存在投资者认知的本计划关联方、一般和重大关联交易的区分标准与托管人提供的名单及管理人采用的名单和标准不完全一致的风险。

此外，投资者一旦签署《集合资产管理合同》即代表投资者同意管理人从事除重大关联交易以外的一般关联交易，管理人将不会另行逐笔事先征询投资者的意见，因此存在投资者无法事前知悉每笔一般关联交易的

	风险。同时，管理人从事重大关联交易的，会事先征询全体投资者的意见，但管理人征询的方式、投资者反馈的方式和时限均由管理人确定，可能存在投资者在管理人或销售机构留存的通讯信息（包括但不限于联系电话/手机、通讯地址、住所地、电子邮箱等）不准确、未更新而导致管理人无法及时通知到投资者，或发生投资者未及时查阅相关信息导致最终未及时反馈意见的风险；或发生因投资者未按照管理人通知中要求的时间和方式进行反馈、或在反馈中意见表示不明确，而被视为反馈了同意意见的情形，从而可能存在进行该笔重大关联交易与投资者主观意愿不相符的风险。 同时，管理人可能通过《集合资产管理合同》约定的信息披露方式更新修改关联交易、重大关联交易、一般关联交易的定义或认定标准，可能存在投资者未及时查阅相关信息导致投资者理解的关联交易事项与实际监控标准不一致的风险。 （增加）17、管理人可能启用份额净值精度应急调整机制的风险 本集合计划每份额净值的估值结果精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入，但管理人可能视赎回情况启用份额净值精度应急调整机制，在一定时间内临时提高本集合计划的份额净值精度。因为技术系统等原因，本集合计划的销售机构可能无法按提高后的净值精度进行展示，导致投资者在销售机构与在管理人网站查询的份额净值不同，进而存在投资者按照销售机构展示的份额净值计算的申购份额、赎回金额与登记结算机构的确认结果不一致的风险，请投资者对此充分知悉。 另外，如启用份额净值精度应急调整机制（包括提高或恢复份额净值精度等），管理人将不再另行公告。可能存在投资者无法提前获知本集合计划份额净值精度调整的相关事宜，并进而导致本集合计划的份额净值与投资者自行计算的结果不一致的风险。
--	---

附件三：中信证券新制造1号集合资产管理计划风险揭示书变更条款对照表

变更前	变更后
根据管理人发布的《关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告》，本集合计划的管理人于 2023 年 11 月 1 日起由“中信证券股份有限公司”变更为“中信证券资产管理有限公司”，因此相应修改与管理人主体变更相关的内容： 1、原风险揭示书中所涉及的“中信证券股份有限公司”均更新为“中信证券资产管理有限公司”； 2、原风险揭示书中所涉及的管理人网站网址均更新为“www.citicsam.com”； 3、原风险揭示书中与此次变更后的内容不一致之处，以此次变更后的内容为准。	
二、风险揭示	
..... (二) 一般风险揭示 9、投资者参与、退出集合计划风险 (2) 出现拒绝或暂停接受投资者参与(退出)的情况导致投资者不能及时参与(退出)的风险，具体参见《集合资产管理合同》“集合计划的参与、退出与转让”章节约定。 13、关联交易的风险 管理人可能将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、充分关注，投资者签订《集合资产管理合同》即代表投资者认可同意上述关联交易并自愿承担相关风险。 	 (二) 一般风险揭示 9、投资者参与、退出集合计划风险 (2) 出现拒绝或暂停接受投资者参与(退出)的情况时，可能导致投资者不能及时参与(退出)的风险。如确认 T 日的退出、转出(如有)申请将导致本集合计划投资者少于 2 人，管理人可能拒绝本集合计划 T 日全部的退出、转出(如有)申请，如果管理人此时拒绝本集合计划 T 日全部的退出、转出(如有)申请，则本集合计划在拒绝退出、转出(如有)申请的下一个工作日前(含该日)终止，因此存在触发本集合计划提前终止的风险。具体参见《集合资产管理合同》“集合计划的参与、退出与转让”章节约定。 (增加) (7) 存续期内，证券期货经营机构或其子公司自有资金参与或退出本集合计划的，管理人采用管理人网站公告的方式征询全体投资者的意见，不会单独通知每个投资者，可能存在投资者没有及时查阅管理人网站相关信息，从而投资者未第一时间获知证券期货经营机构及其子公司的自有资金参与或退出安排的风险，并可能进而导致投资者未及时处理其持有的本集合计划全部份额的退出事宜，而被视为反馈了同意意见的情形，从而可能存在证券期货经营机构或其子公司的自有资金参与或退出与投资者主观意愿不相符的风险。 13、从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险

管理人可能运用资产管理计划财产从事关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、充分关注。同时，托管人关联方名单由托管人提供，可能存在托管人不提供前述名单或提供名单不及时、不完整、不准确的情形。投资者可能面临因本计划关联方名单的获取、界定、识别不准确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关关联交易，以至于本集合计划从事前述关联交易未能事后及时向投资者披露的风险、或者从事前述相关重大关联交易未事先再单独征询投资者意见的风险及其他可能的相关风险，也可能存在投资者认知的本计划关联方、一般和重大关联交易的区分标准与托管人提供的名单及管理人采用的名单和标准不完全一致的风险。

此外，投资者一旦签署《集合资产管理合同》即代表投资者同意管理人从事除重大关联交易以外的一般关联交易，管理人将不会另行逐笔事先征询投资者的意见，因此存在投资者无法事前知悉每笔一般关联交易的风险。同时，管理人从事重大关联交易的，会事先征询全体投资者的意见，但管理人征询的方式、投资者反馈的方式和时限均由管理人确定，可能存在投资者在管理人或销售机构留存的通讯信息（包括但不限于联系电话/手机、通讯地址、住所地、电子邮箱等）不准确、未更新而导致管理人无法及时通知到投资者，或发生投资者未及时查阅相关信息导致最终未及时反馈意见的风险；或发生因投资者未按照管理人通知中要求的时间和方式进行反馈、或在反馈中意见表示不明确，而被视为反馈了同意意见的情形，从而可能存在进行该笔重大关联交易与投资者主观意愿不相符的风险。

同时，管理人可能通过《集合资产管理合同》约定的信息披露方式更新修改关联交易、重大关联交易、一般关联交易的定义或认定标准，可能存在投资者未及时查阅相关信息导致投资者理解的关联交易事项与实际监控标准不一致的风险。

.....

(增加) 17、管理人可能启用份额净值精度应急调整机制的风险

	本集合计划每份额净值的估值结果精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，但管理人可能视赎回情况启用份额净值精度应急调整机制，在一定时间内临时提高本集合计划的份额净值精度。因为技术系统等原因，本集合计划的销售机构可能无法按提高后的净值精度进行展示，导致投资者在销售机构与在管理人网站查询的份额净值不同，进而存在投资者按照销售机构展示的份额净值计算的申购份额、赎回金额与登记结算机构的确认结果不一致的风险，请投资者对此充分知悉。 另外，如启用份额净值精度应急调整机制（包括提高或恢复份额净值精度等），管理人将不再另行公告。可能存在投资者无法提前获知本集合计划份额净值精度调整的相关事宜，并进而导致本集合计划的份额净值与投资者自行计算的结果不一致的风险。 *****
--	---