

东吴证券股份有限公司

关于东吴证券汇天益月月盈3号集合资产管理计划 变更合同条款及临时开放有关事项的公告

尊敬的投资者：

根据《东吴证券汇天益月月盈3号集合资产管理计划资产管理合同》第二十四章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”的相关约定，经管理人与托管人书面达成一致并在管理人网站公告，可对资产管理合同条款进行变更，投资者不同意变更的，可在公告指定的时间内提出退出本集合计划的申请。现经管理人与本集合计划托管人北京银行股份有限公司苏州分行书面协商一致，拟修改本集合计划的产品类型、产品开放期、产品费率、投资范围、投资比例、投资限制、投资策略、投资经理、风险揭示等条款，并根据变更后的资产管理合同内容对本集合计划的说明书、风险揭示书进行了相应更新。

资产管理合同变更条款详见附件《<东吴证券汇天益月月盈3号集合资产管理计划资产管理合同>变更内容对照表》。更新后的《东吴证券汇天益月月盈3号集合资产管理计划资产管理合同》、《东吴证券汇天益月月盈3号集合资产管理计划说明书》及《东吴证券汇天益月月盈3号集合资产管理计划风险揭示书》通过管理人网站进行披露，敬请各位投资者认真阅读。

本集合计划将于2026年1月7日至2026年1月13日设置临时开放期，进行合同变更的征询，临时开放期只开放赎回，不开放申购。不同意本次资产管理合同变更事项的投资者可于2026年1月7日至2026年1月13日的交易时间内（每日15:00前），自行通过本集合计划推广机构办理退出事宜。未提出退出申请的或未将持有的全部份额退出的，视同投资者已经同意本次合同变更。本次合同变更将于2026年1月14日生效，届时不再另行公告。

特此公告。

东吴证券股份有限公司

2026年1月6日

3205000146974

附件：《东吴证券汇天益月月盈 3 号集合资产管理计划资产管理合同》变更内容对照表

修改前的条款	修改后的条款
五、资产管理计划的基本情况	
(二) 资产管理计划的类别：固定收益类集合资产管理计划	(二) 资产管理计划的类别：混合类（偏固定收益类）集合资产管理计划
(五) 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 2、主要投资方向及投资范围 (1) 固定收益类资产，包括在银行间和交易所市场发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债（政策性银行债券、商业银行债券、非银行金融机构债券、特种金融债）、可交换债券、可转换债券、可分离交易债券、次级债、企业债（含项目债）、公司债（包括面向公众公开发行、面向合格投资者公开发行以及非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据（含长期限含权中期票据）、超过 7 天的债券逆回购、债券型基金、非公开定向债务融资工具、资产支持票据、资产支持证券等交易所、银行间交易商协会等上市发行的各类债务融资工具等； (2) 现金类资产，包括现金、银行存款（包括活期存款和定期存款、协议存款）、同业存单、货币市场基金、不超过 7 天的债券逆回购、到期日在 1 年内的政府债券。 本集合计划可参与债券正回购业务。 	(五) 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 2、主要投资方向及投资范围 (1) 固定收益类资产，包括在银行间和交易所市场发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债（政策性银行债券、商业银行债券、非银行金融机构债券、特种金融债）、次级债、企业债（含项目债）、公司债（包括面向公众公开发行、面向合格投资者公开发行以及非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据（含长期限含权中期票据）、超过 7 天的债券逆回购、非公开定向债务融资工具、资产支持票据、资产支持证券； (2) 公开募集证券投资基金（含 ETF），包括货币基金、债券型基金、股票型基金、混合型基金等； (3) 现金类资产，包括现金、银行存款、同业存单、货币市场基金、不超过 7 天的债券逆回购、到期日在 1 年内的政府债券； (4) 期货和衍生品类资产：仅限为对冲债券市场风险敞口目的订立的国债期货合约。 本集合计划可参与债券正回购业务及债券逆回购业务。
3、资产投资比例 本计划属于固定收益类产品，投资于存款、债券等债权类资产占集合计划总资产的比	3、资产投资比例 (1) 本集合计划投资于存款、债券等债权类资产占集合计划总资产的比例为 70%-

修改前的条款	修改后的条款
例合计不低于 80%。 本集合计划可参与债券正/逆回购业务，债券正/逆回购余额不超过集合计划资产净值的 100%，如法律法规或中国证监会对债券正/逆回购比例有新的监管口径，管理人将在与托管人达成一致意见后执行新的标准，届时以管理人公告为准。 为规避市场趋势性风险等特定风险，本计划投资于存款、债券类等债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于本计划总资产的 80%。投资者签署资产管理合同即视为同意前述安排并知悉相关风险。	100%； (2) 本集合计划投资于股票型基金（含 ETF）、混合型基金（含 ETF）等权益类资产的比例合计不超过资产净值的 30%； (3) 期货和衍生品资产的合约价值占集合计划总资产的比例为不超过 80%（含），或期货和衍生品账户权益占集合计划总资产的比例不超过 20%； (4) 本集合计划投资于同一资产的资金不得超过该计划资产净值的 25%；管理人全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%；银行活期存款、国债、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除外；单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算； (5) 本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其净资产 50% 的，集合计划总资产不得超过净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、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不受前述规定限制； (6) 本集合计划可参与债券正/逆回购业务，债券正/逆回购余额不超过集合计划资产净值的 100%，如法律法规或中国证监会对债券正/逆回购比例有新的监管口径，管理人将在与托管人达成一致意见后执行新的标准，届时以管理人公告为准； (7) 本集合计划的总资产不得超过本集合计划净资产的 200%，中国证监会另有规定的除外。 本集合计划如投资于其他资产管理产品（仅限公募证券投资基金），大类资产配置

修改前的条款	修改后的条款
	比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算。 本计划为混合类（偏固定收益类）资产管理计划，固定收益类资产投资比例不低于总资产的 70%，管理人将根据市场变化动态调整投资组合并以固定收益类资产作为重点配置品种，当管理人判断固定收益类资产具备较大投资价值时或需要规避权益类资产趋势性风险时可能高比例投资于固定收益类资产，有可能出现固定收益类资产投资比例超过总资产 80%的情形。为规避市场趋势性风险等特定风险，本计划投资于存款、债券类等债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于本计划总资产的 80%。投资者签署资产管理合同即视为同意前述安排并知悉相关风险。
4、产品风险等级 本集合计划属于集合资产管理计划，属于 R2 风险收益等级的投资品种。	4、产品风险等级 本集合计划属于混合类（偏固定收益类）集合资产管理计划，属于 R3 风险收益等级的投资品种。
（十）本集合计划的注册登记机构、估值与核算、信息技术系统等服务机构均为东吴证券股份有限公司（基金服务业务备案编号：A00040）	（十）本集合计划的注册登记机构、估值与核算、信息技术系统等服务机构均为东吴证券股份有限公司（中国证券投资基金业协会登记编号：PT0300000339）
六、资产管理计划的募集	
（一）本集合计划的募集对象、募集方式、募集期限 1、募集对象 本资管计划属于集合资产管理计划，面向合格投资者通过非公开方式发行，属于 R2 风险收益的投资品种。 本计划适用合格投资者，本集合计划属于	（一）本集合计划的募集对象、募集方式、募集期限 1、募集对象 本资管计划属于混合类（偏固定收益类）集合资产管理计划，面向合格投资者通过非公开方式发行，属于 R3 风险收益的投资品种。

修改前的条款	修改后的条款
R2 风险等级产品, 本集合计划推广对象为专业投资者和风险承受能力等级为 C2 及以上的投资者。	本计划适用合格投资者, 本集合计划属于 R3 风险等级产品, 本集合计划推广对象为专业投资者和风险承受能力等级为 C3 及以上的投资者。
(二) 资产管理计划的认购事项 1、最低认购参与金额 本资管计划采取“金额参与”原则, 首次参与的最低认购参与金额为人民币 30 万元(最低认购参与金额不包含认购参与费), 追加参与的金额不低于人民币 1 万元。如相关法律法规对于投资者首次参与最低金额有最新规定的, 管理人向监管机构履行相关报备程序, 并在管理人网站和推广机构网点公告后即可按照最新规定执行。	(二) 资产管理计划的认购事项 1、最低认购参与金额 本资管计划采取“金额参与”原则, 首次参与的最低认购参与金额为人民币 40 万元(最低认购参与金额不包含认购参与费), 追加参与的金额不低于人民币 1000 元。如相关法律法规对于投资者首次参与最低金额有最新规定的, 管理人向监管机构履行相关报备程序, 并在管理人网站和推广机构网点公告后即可按照最新规定执行。
八、资产管理计划的参与、退出与转让	
(二) 参与和退出的开放日 本集合计划自成立之日起每月开放一次, 每月 19 日开放, 如遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法开放的则相应顺延, 集合计划存续期间, 投资者可以在开放期内办理集合计划的参与和退出业务, 但是在合同规定的某些情况下, 管理人有权不接受投资者的参与申请, 管理人可根据市场情况对各开放期净申购规模上限及单个投资者参与集合计划份额的上限分别进行限定, 具体见届时管理人公告。	(二) 参与和退出的开放日 本集合计划每月 15 日起的 5 个交易日(含 15 日当日)为开放期, 如当月 15 日为非交易日, 则顺延至下一交易日。开放期间投资者可办理申购、赎回业务。管理人有权根据情况调整固定开放期, 具体见届时管理人公告。
(四) 参与的方式、价格、程序及确认 1、参与的原则 (3) 投资者首次参与的最低净参与金额为人民币 300,000 元, 追加参与金额不低于人民币 10,000 元。 存续期开放日购买资产管理计划份额的, 投资者应符合合格投资者标准, 且参与金额应	(四) 参与的方式、价格、程序及确认 1、参与的原则 (3) 投资者首次参与的最低净参与金额为人民币 400,000 元, 追加参与金额不低于人民币 1,000 元。 存续期开放日购买资产管理计划份额的, 投资者应符合合格投资者标准, 且参与

修改前的条款	修改后的条款
满足资产管理计划最低参与金额限制(人民币 300,000 元), 已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的每次追加参与的金额不低于人民币 10,000 元。 3、参与费及参与份额的计算 (1) 参与费率: 本集合计划参与费率为 0% 参与费用=参与金额×参与费率 (2) 参与份额的计算方法: 参与费用=参与金额×参与费率 净参与金额=参与金额-参与费用+参与金额在参与期内参与所带来的利息 参与份额=净参与金额÷认购或申购参与价格 其中: A、份额计算时采用四舍五入、保留至小数点后两位,由此产生的误差计入本集合计划资产的损益; B、多笔参与时,按上述公式进行逐笔计算。 5、参与的金额限制 投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的,投资者应符合合格投资者标准,且参与金额应不低于 300,000 元(不含参与费用),已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。	金额应满足资产管理计划最低参与金额限制(人民币 400,000 元), 已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的每次追加参与的金额不低于人民币 1,000 元。 3、参与费及参与份额的计算 (1) 参与费率: 本集合计划参与费率为 0% 参与费用=参与金额×参与费率/(1+参与费率) (2) 参与份额的计算方法: 参与费用=参与金额×参与费率/(1+参与费率) 净参与金额=参与金额-参与费用+参与金额在参与期内参与所带来的利息 参与份额=(净参与金额+参与金额在参与期内参与所带来的利息(如有))÷认购或申购参与价格 其中: A、份额计算时采用四舍五入、保留至小数点后两位,由此产生的误差计入本集合计划资产的损益; B、多笔参与时,按上述公式进行逐笔计算。 5、参与的金额限制 投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的,投资者应符合合格投资者标准,且参与金额应不低于 400,000 元(不含参与费用),已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。

修改前的条款	修改后的条款
(五) 退出的方式、价格、程序及确认 1、退出的原则 (6) 单笔退出最低份额的约定: 参与份额单笔退出最低份额为 10,000 份, 当投资者持有的资产净值低于 300,000 元 (含 300,000.00 元人民币) 时, 需要退出计划的, 投资者必须选择一次性全部退出集合计划, 若某笔退出导致该投资者持有的资产净值少于 300,000 元, 则管理人有权对该余额部分做强制退出处理。管理人有权对以上标准进行重新规定并及时在管理人指定网站公告。 4、退出限制与次数 (1) 投资者可以选择全部退出, 也可以选择部分退出。部分退出资产管理计划的, 其退出后持有的资产管理计划资产净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者参与份额单笔退出最低份额为 10,000 份, 若某笔退出导致该投资者的资产净值少于 300,000 元, 则管理人有权对该余额部分做强制退出处理。管理人有权对以上标准进行重新规定并及时在管理人指定网站公告。 (2) 投资者在某一开放日内的退出次数不受限制。	(五) 退出的方式、价格、程序及确认 1、退出的原则 (6) 单笔退出最低份额的约定: 参与份额单笔退出最低份额为 1,000 份, 当投资者持有的资产净值低于 400,000 元 (含 400,000.00 元人民币) 时, 需要退出计划的, 投资者必须选择一次性全部退出集合计划, 若某笔退出导致该投资者持有的资产净值少于 400,000 元, 则管理人有权对该余额部分做强制退出处理。管理人有权对以上标准进行重新规定并及时在管理人指定网站公告。 4、退出限制与次数 (1) 投资者可以选择全部退出, 也可以选择部分退出。部分退出资产管理计划的, 其退出后持有的资产管理计划资产净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者参与份额单笔退出最低份额为 1,000 份, 若某笔退出导致该投资者的资产净值少于 400,000 元, 则管理人有权对该余额部分做强制退出处理。管理人有权对以上标准进行重新规定并及时在管理人指定网站公告。 (2) 投资者在某一开放日内的退出次数不受限制。
十一、资产管理计划的投资	
(二) 投资范围与投资比例 1、投资范围 本集合计划属于固定收益类集合资产管理计划。 本集合计划投资范围包括: (1) 固定收益类资产, 包括在银行间和交易所市场发行的国债、地方政府债、央行票	(二) 投资范围与投资比例 1、投资范围 本集合计划属于混合类(偏固定收益类)集合资产管理计划, 投资范围包括: (1) 固定收益类资产, 包括在银行间和交易所市场发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债(政策性银行债券、商业银行

修改前的条款	修改后的条款
据、金融债（政策性银行债券、商业银行债券、非银行金融机构债券、特种金融债）、可交换债券、可转换债券、可分离交易债券、次级债、企业债（含项目债）、公司债（包括面向公众公开发行、面向合格投资者公开发行以及非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据（含长期限含权中期票据）、超过 7 天的债券逆回购、债券型基金、非公开定向债务融资工具、资产支持票据、资产支持证券等交易所、银行间交易商协会等上市发行的各类债务融资工具等； （2）现金类资产，包括现金、银行存款（包括活期存款和定期存款、协议存款）、同业存单、货币市场基金、不超过 7 天的债券逆回购、到期日在 1 年内的政府债券。 本集合计划可参与债券正回购业务。 2、资产投资比例 本计划属于固定收益类产品，投资于存款、债券等债权类资产占集合计划总资产的比例合计不低于 80%。 本集合计划可参与债券正/逆回购业务，债券正/逆回购余额不超过集合计划资产净值的 100%，如法律法规或中国证监会对债券正/逆回购比例有新的监管口径，管理人将在与托管人达成一致意见后执行新的标准，届时以管理人公告为准。 为规避市场趋势性风险等特定风险，本计划投资于存款、债券类等债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于本计划总资产的 80%。投资者签署资产管理合同即视为同意前述安排并知悉相关风险。	债券、非银行金融机构债券、特种金融债）、次级债、企业债（含项目债）、公司债（包括面向公众公开发行、面向合格投资者公开发行以及非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据（含长期限含权中期票据）、超过 7 天的债券逆回购、非公开定向债务融资工具、资产支持票据、资产支持证券； （2）公开募集证券投资基金（含 ETF），包括货币基金、债券型基金、股票型基金、混合型基金等； （3）现金类资产，包括现金、银行存款、同业存单、货币市场基金、不超过 7 天的债券逆回购、到期日在 1 年内的政府债券； （4）期货和衍生品类资产：仅限为对冲债券市场风险敞口目的订立的国债期货合约。 本集合计划可参与债券正回购业务及债券逆回购业务。 2、资产投资比例 （1）本集合计划投资于存款、债券等债权类资产占集合计划总资产的比例为 70%-100%； （2）本集合计划投资于股票型基金（含 ETF）、混合型基金（含 ETF）等权益类资产的比例合计不超过资产净值的 30%； （3）期货和衍生品资产的合约价值占集合计划总资产的比例为不超过 80%（含），或期货和衍生品账户权益占集合计划总资产的比例不超过 20%； （4）本集合计划投资于同一资产的资金不得超过该计划资产净值的 25%；管理人全部集合资产管理计划投资于同一资产的资

修改前的条款	修改后的条款
	金，不得超过该资产的 25%（托管人对于上述指标的监督义务仅限于监督由管理人管理且由托管人托管的全部集合资产管理计划是否符合上述比例限制）；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算； （5）本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其净资产 50% 的，集合计划总资产不得超过净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、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不受前述规定限制； （6）本集合计划可参与债券正/逆回购业务，债券正/逆回购余额不超过集合计划资产净值的 100%，如法律法规或中国证监会对债券正/逆回购比例有新的监管口径，管理人将在与托管人达成一致意见后执行新的标准，届时以管理人公告为准； （7）本集合计划的总资产不得超过本集合计划净资产的 200%，中国证监会另有规定的除外。 本集合计划如投资于其他资产管理产品（仅限公募证券投资基金），大类资产配置比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算。 本计划为混合类（偏固定收益类）资产管理计划，固定收益类资产投资比例不低于总资产的 70%，管理人将根据市场变化动态调整投资组合并以固定收益类资产作为重点配置品种，当管理人判断固定收益类资产具

修改前的条款	修改后的条款
	备较大投资价值时或需要规避权益类资产趋势性风险时可能高比例投资于固定收益类资产，有可能出现固定收益类资产投资比例超过总资产 80%的情形。为规避市场趋势性风险等特定风险，本计划投资于存款、债券类等债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于本计划总资产的 80%。投资者签署资产管理合同即视为同意前述安排并知悉相关风险。
（三）投资比例超限的处理方式及流程 如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 20 个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、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，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 20 个交易日内将投资比例降至许可范围内。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，证券期货经营机构应当及时向中国证监会相关派出机构报告。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。	（三）投资比例超限的处理方式及流程 如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 20 个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、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，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 20 个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券期货市场波动、资产管理计划规模变动等证券公司之外的原因致使国债期货交易比例不符合规定的，管理人应当在 10 个交易日内调整完毕。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，证券期货经营机构应当及时向中国证监会相关派出机构报告。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。
（五）风险收益特征 本集合资管计划属于 R2 风险收益的投资品种。	（五）风险收益特征 本集合资管计划属于 R3 风险收益的投资品种。
（七）投资策略 本集合计划主要投资于固定收益类资产，管理人依据丰富的投资经验及专业的研究能力，严格控制业务风险，在有效控制风险的前提下追求稳定的收益。	（七）投资策略 本计划为混合类资产管理计划，投资策略为混合偏固定收益类策略，固定收益类资产投资比例不低于总资产的 70%，管理人将根据市场变化动态调整投资组合并以固定收

修改前的条款	修改后的条款
1、资产配置策略 本计划通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、资本市场资金环境的分析,预测宏观经济的发展趋势和利率政策的变化,并据此评价未来一段时间债券市场相对收益率和主要风险。在确定资产管理计划整体流动性要求、投资品种流动性强弱程度和收益创造能力大小的基础上,确定现金、类现金资产和固定收益类资产的配置比例。 2、债券投资策略 	益类资产作为重点配置品种,当管理人判断固定收益类资产具备较大投资价值时或需要规避权益类资产趋势性风险时可能高比例投资于固定收益类资产,有可能出现固定收益类资产投资比例超过总资产 80%的情形。本集合计划主要投资于固定收益类资产,管理人依据丰富的投资经验及专业的研究能力,严格控制业务风险,在有效控制风险的前提下追求稳定的收益。 1、股债资产配置策略 选择关注度较高的、月度更新的宏观及中观经济因子,搭建宏观数据库,从数据库中进一步筛选领先指标,进而搭建股市前瞻指数从而实现对股市的预测,并形成股债投资的仓位建议。 2、债券投资策略 补充: 3、公开募集证券投资基金投资策略 从公司平台、基金产品等角度对基金进行定量定性的全方位评估,全市场筛选符合投资需求的公募基金,在综合考虑业绩持续性、风格偏好、可交易性等因素后,结合市场环境及本计划特性,自上而下和自下而上相结合地选择投资标的。 4、国债期货投资策略 (1) 投资策略 本集合计划对国债期货的投资以套期保值、回避市场风险为主要目的。管理人将结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作,获取超额收益。 (2) 风险控制

修改前的条款	修改后的条款
	为控制资产管理业务投资期货的业务风险，根据《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引（2022 年修订）》等法律法规，管理人制定了资产管理业务国债期货投资管理办法的相关内部制度，对资产管理计划参与国债期货进行风险控制。集合计划参与国债期货过程中可能产生包括但不限于保证金追加等突发事件，在保证金比率达到预警水平或者收到期货公司追加保证金通知后，按照管理人制定的处理突发事件的应急预案和操作流程进行操作。 （3）责任承担 管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定，因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应承担相应责任，但出资资产的变现损失及未及时追加保证金的损失（包括穿仓损失）除外。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议（如有）为准。 （4）应急处理机制 1）应急触发条件 管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。 2）保证金补充机制 如出现保证金不足的情况时，管理人将

修改前的条款	修改后的条款
	首先运用集合计划资产从市场上拆借资金，如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现集合计划资产，变现时应重点考虑变现资产的流动性，以最大限度的降低损失。
(八) 投资限制 1、投资限制 为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为： (1) 本集合计划可参与债券正回购业务，本集合计划的总资产不得超过本集合计划净资产的 200%，中国证监会另有规定的除外； (2) 投资于信用债的，需满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别（中债资信评级除外）； (3) 持有的可交换债券和可转换债券不得进行转换类操作； (4) 本集合计划不投资中小企业私募债； (5) 集合资产管理计划投资于同一资产的资金不得超过该计划资产净值的 25%；管理人全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%；银行活期存款、国债、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除外。单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算； (6) 本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其净资产 50% 的，集合计划总资产不得超过净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、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不受前述规定限制； (7) 在退出开放期内，组合资产中 7 日可变现资产（包括可在交易所、银行间市场正	(八) 投资限制 1、投资限制 为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为： (1) 投资于信用债的，债券主体评级或债项评级不得投资在 AA 以下级别，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，且取最新的评级结果； (2) 本集合计划不得投资中小企业私募债； (3) 本集合计划资产支持票据、资产支持证券仅可投资于优先级。

修改前的条款	修改后的条款
常交易的债券、非金融企业债务融资工具、同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款等）的价值，不低于资产净值的10%，并且主动投资于流动性受限资产（包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产）的市值合计不得超过该资产管理计划资产净值的20%； （8）证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。 	
（十）本集合资产管理计划主要投资于标准化债券、现金、银行存款等资产，资产流动性较强，资管计划每月开放一次，为确保投资者的合理退出安排，管理人将在开放期内保留适当比例的现金类资产，包括但不限于现金、银行存款（包括活期存款和定期存款、协议存款）、同业存单、货币市场基金、不超过7天的债券逆回购、到期日在1年内的政府债券等。在退出开放期内，组合资产中7日可变现资产（包括可在交易所、银行间市场正常交易的债券、非金融企业债务融资工具、同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款等）的价值，不低于资产净值的10%。在开放退出期内主动投资于流动性受限资产（包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非	（十）本集合资产管理计划主要投资于标准化债券、现金、银行存款等资产，资产流动性较强，本计划每月15日起的5个交易日（含15日当日）为开放期，如当月15日为非交易日，则顺延至下一交易日资管计划每月开放一次。为确保投资者的合理退出安排，管理人将在开放期内保留适当比例的现金类资产，包括但不限于现金、银行存款（包括活期存款和定期存款、协议存款）、同业存单、货币市场基金、不超过7天的债券逆回购、到期日在1年内的政府债券等。在退出开放期内，组合资产中7日可变现资产（包括可在交易所、银行间市场正常交易的债券、非金融企业债务融资工具、同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款等）的价值，不低于资产净值的10%。在开放退出期内主动投资于流动性受限资产（包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银

修改前的条款	修改后的条款
金融企业债务融资工具等资产)的市值合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。	行存款)、资产支持证券(票据)、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产)的市值合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。
	补充: (十一) 预警止损机制 本资产管理计划设置预警线为计划份额净值 0.9200 元(以管理人与托管人核对一致的计划份额净值为准),若 T 日资产管理计划份额净值触及预警线,资产管理人自 T+1 日起进行风险评估,视情况评估是否需主动降低非现金资产规模以稳定净值。
十五、投资经理的指定与变更	
(一)管理人指定陈叶闻女士为本计划投资经理。陈叶闻女士,硕士研究生,曾任职于天风资管,担任投资经理助理。2021 年加入东吴证券资管,现任东吴证券资管总部固定收益部投资经理。已取得基金从业资格,最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。	(一) 管理人指定施周蕾女士、高宇先生和郑玉琪女士为本计划投资经理。 施周蕾女士,上海对外经贸大学金融学硕士,CPA,曾任华信证券销售交易部交易员,江海证券债券投资部投资顾问、固定收益部交易员,2021 年 2 月加入东吴证券,先后担任交易员和投资助理,现任东吴证券资产管理总部投资经理。已取得基金从业资格,最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。 高宇先生,厦门大学金融学硕士,CFA,曾任职宝盈基金固定收益部副总经理、研究部副总经理兼基金经理;博时基金固定收益部基金经理;第一创业证券资产管理部研究员;浙商证券研究所固定收益首席;天风证券机构业务部总助;国信证券研究所债券分析师。2023 年加入东吴证券,任资产管理总部副总经理。已取得基金从业资格,最近三

修改前的条款	修改后的条款
	年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。 郑玉琪女士，硕士研究生。历任江苏张家港农村商业银行资产管理部投资经理助理、投资经理。2022年7月加入东吴证券，现任东吴证券资管总部固定收益部投资经理。已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。
十八、越权交易的界定	
(三) 托管人对管理人的投资运作进行监督 资产托管人对本计划的投资范围和投资比例、投资限制、关联方交易等监管规定要求的监督事项进行监督。托管人在系统支持及可观测范围内依据管理人提供的关联方信息对关联交易进行监督。资产托管人对本计划的以下投资限制进行监督： 1、投资限制 为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为： (1) 本集合计划可参与债券正回购业务，本集合计划的总资产不得超过本集合计划净资产的 200%，中国证监会另有规定的除外； (2) 投资于信用债的，需满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别（中债资信评级除外）； (3) 持有的可交换债券和可转换债券不得进行转换类操作； (4) 本集合计划不投资中小企业私募债； (5) 集合资产管理计划投资于同一资产的资金不得超过该计划资产净值的 25%；管理人全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%；银行活期存款、	(三) 托管人对管理人的投资运作进行监督 资产托管人对本计划的投资范围和投资比例、投资限制、关联方交易等监管规定要求的监督事项进行监督。托管人在系统支持及可观测范围内依据管理人提供的关联方信息对关联交易进行监督。资产托管人对本计划的以下投资限制进行监督： 1、投资限制 为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为： (1) 投资于信用债的，债券主体评级或债项评级不得投资在 AA 以下级别，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，且取最新的评级结果； (2) 本集合计划不得投资中小企业私募债； (3) 本集合计划资产支持票据、资产支持证券仅可投资于优先级。

修改前的条款	修改后的条款
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除外。单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算； （6）本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其净资产 50% 的，集合计划总资产不得超过净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、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不受前述规定限制； （7）在退出开放期内，组合资产中 7 日可变现资产（包括可在交易所、银行间市场正常交易的债券、非金融企业债务融资工具、同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款等）的价值，不低于资产净值的 10%，并且主动投资于流动性受限资产（包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产）的市值合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%； （8）证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。 	
十九、资产管理计划财产的估值和会计核算	
（一）资产管理计划财产估值的相关事项 7、估值方法 （1）债券的估值方法 g. 资产支持证券等其它固定收益类品种参照债券资产标准进行估值。	（一）资产管理计划财产估值的相关事项 7、估值方法 （1）债券的估值方法 g. 资产支持证券等其它固定收益类品

修改前的条款	修改后的条款
..... (3) 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化,管理人及时进行账务调整。 (4) 其他资产的估值方法 其他资产按国家有关规定进行估值。 	种参照《关于固定收益品种的估值处理标准》债券资产标准进行估值。 (3)持有的银行定期存款或通知存款以本金列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化,管理人及时进行账务调整。 (4)国债期货合约按估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。如法律法规今后另有规定的,从其规定。 (5) 其他资产的估值方法 其他资产按国家有关规定进行估值。
二十一、资产管理计划的费用与税收	
(一)集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间 2、管理人的业绩报酬 1) 集合计划的业绩报酬计提原则 (1) 按投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提为管理人业绩报酬。 (2) 符合业绩报酬计提条件时,在投资者退出日和本集合计划终止日计提业绩报酬。其中,在集合计划终止日,对集合计划中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬;在投资者退出申请日,仅对退出份额中符合业绩报酬计提条件的份额计提业绩报酬。 (3) 在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的,业绩报酬(若有)从退出资金中扣除。 (4) 投资者申请退出时,管理人按“先进先出”的原则,即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额,计	(一) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间 2、管理人的业绩报酬 本集合计划不收取业绩报酬。

修改前的条款	修改后的条款
算、提取退出份额对应的业绩报酬。若投资者多笔参与，则按投资者每笔参与份额及持有期限分别计算年化收益率并计提业绩报酬。 (5) 本集合计划根据投资者每笔参与份额持有期间的年化收益率及持有期间内各业绩报酬核算区间对应的业绩报酬计提基准分别计算业绩报酬。如该笔份额持有期间的年化收益率小于或者等于某业绩报酬核算区间的业绩报酬计提基准，则该业绩报酬核算区间不计提业绩报酬；如该笔份额持有期间的年化收益率大于某业绩报酬核算区间的业绩报酬计提基准，则对超过该业绩报酬核算区间业绩报酬计提基准部分的 60% 计提为业绩报酬，各业绩报酬核算区间的业绩报酬在业绩报酬计提时合并收取。 2) 业绩报酬的计算方法 每笔参与份额以持有期间的年化收益率作为计提业绩报酬的依据。若持有期间，集合计划业绩报酬计提基准发生调整，需分别计算调整前后不同核算区间内的业绩报酬，并加总计算管理人业绩报酬。管理人于产品发行前公告产品业绩报酬计提基准，产品存续期间如业绩报酬计提基准发生变动，管理人将以公告形式进行告知及披露，投资者可通过管理人最新公告确认持有份额适用的业绩报酬计提基准。 若投资者 T 日参与本集合计划，适用的业绩报酬计提基准 X_t 为份额确认日 (T+1 日) 有效的业绩报酬计提基准，投资者第一个核算区间持有天数为 D_1 (第一个核算区间的起始日为产品成立日/参与份额的确认日)，第一个核算区间适用的业绩报酬计提基准为 X_1，如该笔份额持有期间的年化收益率 $R >$ 第一个核算区间的业绩报酬计提基准 X_1，则对超过业绩报	

修改前的条款	修改后的条款
酬计提基准部分的 60%计提为业绩报酬，第一个核算区间的业绩报酬记为 Y_1，如该笔份额持有期间的年化收益率小于或者等于第一个核算区间的业绩报酬计提基准 X_1，则不计提业绩报酬。第二个核算区间起始日为 T_2，该笔份额第二个核算区间适用的业绩报酬计提基准为 X_2，该笔份额第二个核算区间持有天数为 D_2（第二个核算区间的起始日为业绩报酬计提基准 X_2 的生效日），如该笔份额持有期间的年化收益率 $R >$ 第二个核算区间的业绩报酬计提基准 X_2，则对超过业绩报酬计提基准部分的 60%计提为业绩报酬，第二个核算区间的业绩报酬记为 Y_2，如该笔份额持有期间的年化收益率小于或者等于第二个核算区间的业绩报酬计提基准 X_2，则不计提业绩报酬。其他情况依此类推。业绩报酬计提日投资者该笔份额应收取的业绩报酬 $Y = Y_1 + Y_2 + \dots + Y_n$。 每笔份额持有期间的年化收益率计算如下： $R = [(P_1 - P_0) / P] \times (365 / D)$ R 为集合计划份额持有期间的年化收益率； P_1 为集合计划份额退出日/集合计划终止日对应份额单位累计净值； P_0 为集合计划成立日/集合计划份额参与日对应份额单位累计净值； P 为集合计划成立日/集合计划份额参与日对应份额单位净值； D 为对应份额【集合计划成立日/集合计划参与份额确认日】（含）至【集合计划份额退出日/集合计划结束日】（含）这一时间区间的自然天数。 注：本集合计划业绩报酬计提基准管理人	

修改前的条款	修改后的条款									
在集合计划推广公告中披露,并将根据市场情况不定期调整,具体以管理人公告为准。若投资者持有计划份额期间,发生业绩报酬计提基准调整,则该笔份额持有期间存在多个核算区间,需分别计算调整前后不同核算区间内的业绩报酬,并加总计算管理人业绩报酬。管理人业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次,但因投资者退出集合计划提取业绩报酬的,不受前述提取频率的限制。 业绩报酬计算方式如下: $Y=\sum Y_i, i=1,2,\cdots n$ <table><tr><th>第 i 个核算区间年化收益率</th><th>收取比例</th><th>管理人业绩报酬计算公式 (Y_i)</th></tr><tr><td>$R\leq X_i$</td><td>0</td><td>0</td></tr><tr><td>$R>X_i$</td><td>60%</td><td>$N\times P\times (R-X_i)\times 60\%\times (D_i\div 365)$</td></tr></table> 其中: Y 为每笔份额总的业绩报酬; Y_i 为每笔份额的第 i 个核算区间的业绩报酬; N 为每笔份额持有期间的份额数; P 为集合计划成立日/集合计划份额参与日对应份额单位净值; X_i 为每笔份额第 i 个核算区间的业绩报酬计提基准; D_i 为每笔份额第 i 个核算区间的天数; 业绩报酬计提基准以管理人公布为准。 重要提示:业绩报酬计提基准关系到投资者退出资金的计算,投资者务必关注本集合计划业绩报酬计提基准调整公告。投资者的参与和退出视为投资者已充分知悉本集合计划业绩报酬计提基准及相关计提规则。	第 i 个核算区间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式 (Y _i)	$R\leq X_i$	0	0	$R>X_i$	60%	$N\times P\times (R-X_i)\times 60\%\times (D_i\div 365)$	
第 i 个核算区间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式 (Y _i)								
$R\leq X_i$	0	0								
$R>X_i$	60%	$N\times P\times (R-X_i)\times 60\%\times (D_i\div 365)$								

修改前的条款	修改后的条款
3) 业绩报酬的支付 份额退出日提取的业绩报酬由管理人在相应份额退出确认后的 7 个工作日内向托管人发送业绩报酬划付指令, 托管人根据指令从本集合计划退出资金中一次性支付给管理人。 终止清算提取的业绩报酬由管理人在集合计划到期清算日起 7 个工作日内向托管人发送集合计划业绩报酬划付指令, 托管人根据管理人指令从本集合计划清算资金中一次性支付给管理人。 上述划付过程中, 由资产管理人向资产托管人发送业绩报酬的数据, 管理人负责业务报酬的计算, 托管人对业绩报酬不承担复核责任。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。	
二十二、信息披露与报告	
(一) 定期报告 2、集合计划季度报告和年度报告 管理人应当向投资者提供资产管理计划季度报告和年度报告, 披露报告期内资产管理计划运作情况, 年度报告包括但不限于下列信息: (1) 管理人履职报告; (2) 托管人履职报告; (3) 资产管理计划投资表现; (4) 资产管理计划投资组合报告; (5) 资产管理计划运用杠杆情况(如有); (6) 资产管理计划财务会计报告; (7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式; (8) 资产管理计划投资收益分配情况; (9) 投资经理变更、关联交易等涉及投	(一) 定期报告 2、集合计划季度报告和年度报告 管理人应当向投资者提供资产管理计划季度报告和年度报告, 披露报告期内资产管理计划运作情况, 年度报告包括但不限于下列信息: (1) 管理人履职报告; (2) 托管人履职报告; (3) 资产管理计划投资表现; (4) 资产管理计划投资组合报告; (5) 资产管理计划运用杠杆情况(如有); (6) 资产管理计划财务会计报告; (7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式; (8) 资产管理计划投资收益分配情况;

修改前的条款	修改后的条款
投资者权益的重大事项； （10）中国证监会规定的其他事项。 	（9）投资经理变更、关联交易等涉及投资者权益的重大事项； （10）资产管理计划参与国债期货的有关情况； （1011）中国证监会规定的其他事项。
二十三、风险揭示	
（一）一般风险 1、本金损失风险 管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。 本计划属于 R2 风险投资品种，本集合计划面向合格投资者销售，推广对象为专业投资者和风险承受能力等级为 C2 及以上的投资	（一）一般风险 1、本金损失风险 管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。 本计划属于 R3 风险投资品种，本集合计划面向合格投资者销售，推广对象为专业投资者和风险承受能力等级为 C3 及以上的投资
（二）本集合计划特有风险 1、本集合计划每月开放一次，每月 19 日开放，在开放期间，投资者可以办理参与或退出业务。管理人有权根据情况调整开放期，具体见届时管理人公告。请投资者注意。 2、集合计划的业绩报酬计提基准无法达到的风险 管理人在公告中公告的集合计划业绩报酬计提基准仅作为管理人计提业绩报酬的依据，并非管理人向投资者做出保本保收益的承诺，最终投资者的收益以实际年化收益率为准，因此存在实际收益率低于业绩报酬计提基准的情况，管理人将在收益分配时以集合计划的实际到期年化收益率为依据进行分配。本集合计划资产出现极端损失情况下，投资者可能	（二）本集合计划特有风险 1、本集合计划每月 15 日起的 5 个交易日（含 15 日当日）为开放期，如当月 15 日为非交易日，则顺延至下一交易日。开放期间投资者可办理申购、赎回业务。投资者可能面临非开放退出日无法赎回份额的风险。管理人有权根据情况调整开放期，具体见届时管理人公告，请投资者注意。 2、固定收益类资产投资比例调整的风险 本计划为混合类（偏固定收益类）资产管理计划，固定收益类资产投资比例不低于总资产的 70%，管理人将根据市场变化动态调整投资组合并以固定收益类资产作为重点配置品种，当管理人判断固定收益类资产具备较大投资价值时或需要规避权益类资产趋

修改前的条款	修改后的条款
面临无法取得业绩报酬计提基准乃至投资本金受损的风险 3、固定收益类投资风险 	势性风险时可能高比例投资于固定收益类资产，有可能出现固定收益类资产投资比例超过总资产 80%的情形，请投资者注意。 补充： 3、参与公开募集证券投资基金的投资风险 本集合计划可通过具备中国证监会核准的证券投资基金销售资格的基金销售机构购买由其代理销售的公开募集证券投资基金，投资者可能面临由此产生的相关风险。 本集合计划在精选公开募集证券投资基金的操作过程中管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的公开募集证券投资基金的业绩表现并不一定持续的优于其他公开募集证券投资基金。 本集合计划投资者可能会承担双层费用，即本计划费用及所投资的公开募集证券投资基金自身费用。 4、期货和衍生品风险 本集合计划投资范围包括国债期货，可能给本集合计划带来额外风险，包括杠杆风险、期货价格与集合计划投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本集合计划净值的波动性。 35、固定收益类投资风险 补充： 10、资产管理合同与合同指引不一致所涉风险 本集合计划资产管理合同依据证券投资基金业协会《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》及相关法律法规制定，

修改前的条款	修改后的条款
	根据管理人自身实际情况对相关内容做出了合理调整。本计划资产管理合同中对《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》规定内容之外的部分事项进行约定，也可能存在个别内容与《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》不完全一致。 投资人应当认真阅读资产管理合同，理解资产管理合同的全部条款，独立做出是否签署资产管理合同的决定。
(三) 特别提示 5、业绩报酬计提基准波动风险 管理人将于官网公告本集合计划业绩报酬计提基准并根据市场情况不定期调整，投资者可通过管理人最新公告确认持有份额适用的业绩报酬计提基准。不同时间参与的份额适用的业绩报酬计提基准可能会不同，请投资者注意。 本集合计划的业绩报酬计提基准，仅作为管理人计提业绩报酬的依据，并非管理人向投资者做出保本保收益的承诺，投资者的实际收益率有可能低于业绩报酬计提基准，本集合计划资产出现极端损失情况下，投资者可能面临投资本金受损的风险。	(三) 特别提示 5、业绩报酬计提基准波动风险 管理人将于官网公告本集合计划业绩报酬计提基准并根据市场情况不定期调整，投资者可通过管理人最新公告确认持有份额适用的业绩报酬计提基准。不同时间参与的份额适用的业绩报酬计提基准可能会不同，请投资者注意。 本集合计划的业绩报酬计提基准，仅作为管理人计提业绩报酬的依据，并非管理人向投资者做出保本保收益的承诺，投资者的实际收益率有可能低于业绩报酬计提基准，本集合计划资产出现极端损失情况下，投资者可能面临投资本金受损的风险。