

关于世纪证券全天候进取1号FOF集合资产管理计划 合同变更的公告

尊敬的投资者：

由我司作为管理人，兴业银行股份有限公司作为托管人的世纪证券全天候进取1号FOF集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于2021年2月5日成立，为满足客户需求，拟对《世纪证券全天候进取1号FOF集合资产管理计划资产管理合同》、《世纪证券全天候进取1号FOF集合资产管理计划说明书》、《世纪证券全天候进取1号FOF集合资产管理计划风险揭示书》进行变更，详细内容见本公告附件。

为保证投资者利益，本计划变更事宜已经获得托管人兴业银行股份有限公司的书面同意确认。投资者不同意本次合同变更的应在2024年12月27日提出退出申请。未提出退出申请的，视同投资者已经同意本次合同变更。截止2024年12月27日，若同意合同变更的投资者数量不少于2人（含2人），则我司约定2024年12月30日为合同变更生效日；若同意合同变更的投资者数量少于2人，则本计划终止。

特此公告

附件1：世纪证券全天候进取1号FOF集合资产管理计划资产管理合同变更明细表

附件2：世纪证券全天候进取1号FOF集合资产管理计划说明书变更明细表

附件3：世纪证券全天候进取1号FOF集合资产管理计划风险揭示书变更明细表

世纪证券有限责任公司

2024年12月27日

附件 1：世纪证券全天候进取 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同变更明细表

序号	位置	原合同	变更后合同
1	“全文”	全文中“投资者委托资产”、“委托财产”、“委托资产”	修改为“受托资产”
2	“二、释义”	《管理办法》 中国证券监督管理委员会在 2018 年 10 月 22 日发布的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；	《管理办法》 指中国证监会发布的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（2023 年 1 月 12 日证监会令第 203 号修订并于 2023 年 3 月 1 日施行）；
3	“二、释义”	《运作规定》 中国证券监督管理委员会在 2018 年 10 月 22 日发布的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》；	《运作规定》 指中国证监会发布的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（2023 年 1 月 12 日证监会公告（2023）2 号修订并于 2023 年 3 月 1 日施行）；
4	“二、释义”	合格投资者 （三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构； （五）基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金、慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；	合格投资者 （三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、 商业银理财子公司 、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构； （五）基本养老金、社会保障基金、 年金基金 等养老基金、慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；
5	“二、释义”	删除 托管协议	删除
6	“三、承诺与声明”	（三）投资者声明 投资者声明 财产 的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划，且投资	（三）投资者声明 投资者声明 参与资金 的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划，且投资

		<p>事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。</p> <p>投资者声明其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；声明用于证券投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；声明证券投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；声明出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；声明积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。</p>	<p>事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。</p> <p>投资者声明其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；声明用于证券投资的参与资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；声明证券投资的参与资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；声明出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；声明积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。</p>
7	“四、当事人及权利义务”	<p>(一) 当事人</p> <p>托管人 法定代表人/授权代表：吕家进 邮政编码：350000 联系人：林诗琪</p>	<p>(一) 当事人</p> <p>托管人 法定代表人：吕家进 邮政编码：200120 联系人：周敏敏</p>
8	“四、当事人及权利义务”	<p>(二) 权益约定</p> <p>本集合计划设定为均等份额，每份份额具有同等的合法权益。</p>	<p>(二) 权益约定</p> <p>本集合计划设定为均等份额，每份份额具有同等的合法权益，承担同等风险。</p>
9	“四、当事人及权利义务”	<p>(三) 当事人的权利和义务</p> <p>1、投资者的权利和义务</p> <p>(2) 投资者的义务</p> <p>(j) 保守商业秘密，不得泄露集合计划的投资计划、投资意向等；不得利用集合计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；</p>	<p>(三) 当事人的权利和义务</p> <p>1、投资者的权利和义务</p> <p>(2) 投资者的义务</p> <p>(j) 保守商业秘密，不得泄露集合计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；</p>
10	“四、当事人及权	2、管理人的权利和义务	2、管理人的权利和义务

	利义务”	<p>(1) 管理人的权利</p> <p>(d) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对集合计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；</p>	<p>(1) 管理人的权利</p> <p>删除 (d)</p>
11	“四、当事人及权利义务”	<p>2、管理人的权利和义务</p> <p>(2) 管理人的义务</p> <p>(h) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作本集合计划财产；</p> <p>(i) 保守商业秘密，不得泄露集合计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；</p> <p>(k) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；</p> <p>(q) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；</p> <p>(s) 根据法律法规与本合同的规定，编制向投资者披露的集合计划季度、年度等定期报告，向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；</p> <p>新增 (y)</p> <p>新增 (z)</p>	<p>2、管理人的权利和义务</p> <p>(2) 管理人的义务</p> <p>(h) 不得向管理人以及任何第三人输送利益；不得委托第三人运作资产管理计划财产；</p> <p>(i) 保守商业秘密，不得泄露集合计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；</p> <p>(k) 不得利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；</p> <p>(q) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；</p> <p>(s) 根据法律法规与本合同的规定，编制向投资者披露的集合计划季度、年度等定期报告；</p> <p>新增 (y)</p> <p>(y) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对集合计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构；</p> <p>新增 (z)</p> <p>(z) 除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传。</p>

12	“四、当事人及权利义务”	<p>3、托管人的权利和义务</p> <p>(1) 托管人的权利</p> <p>(c) 监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定或者本合同、《说明书》和托管协议约定的，要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；</p> <p>(2) 托管人的义务</p> <p>(b) 除依据法律法规规定和本合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；</p> <p>(i) 编制私募资产管理业务托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；</p> <p>(k) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；</p> <p>(m) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会；</p> <p>新增 (p)</p>	<p>3、托管人的权利和义务</p> <p>(1) 托管人的权利</p> <p>(c) 监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定或者本合同约定的，要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；</p> <p>(2) 托管人的义务</p> <p>(b) 不得为托管人以及任何第三人输送利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；</p> <p>(i) 编制托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构；</p> <p>(k) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；</p> <p>(m) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构；</p> <p>新增 (p)</p> <p>(p) 托管人向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息，具体以公开市场披露的主体信息和证券信息为准；</p>
13	“五、资产管理计划的基本情况”	<p>(四) 集合计划的投资</p> <p>2、投资范围</p> <p>(i) 金融产品类资产：包括公募证券投资基金，证券公司、基金管理公司、期货公司及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司发行的集合资产管理计划（含原法规下已设立的同类私募基金产品）和在中国证券投资基金业协会</p>	<p>(四) 集合计划的投资</p> <p>2、投资范围</p> <p>(1) 金融产品类资产：包括公募证券投资基金，证券公司、基金管理公司、期货公司、保险公司、信托公司、银行及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司发行的集合资产管理计划、信托计划、银行理财和在中国证券投资基金业</p>

		<p>备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金，前述私募基金产品的投资范围不含非标准化资产；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的债券；</p> <p>(3) 现金类资产：现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金等现金类资产；</p> <p>(4) 金融衍生品类资产：国债期货、股指期货和场内期权。</p> <p>(5) 本计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）交易。</p>	<p>协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金，前述私募基金产品的投资范围不含非标准化资产；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的债券；</p> <p>(3) 现金类资产：现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金等现金类资产；</p> <p>(4) 期货和衍生品类资产：国债期货、股指期货和场内期权。</p> <p>(5) 本计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）交易。</p>
14	“五、资产管理计划的基本情况”	<p>(四) 集合计划的投资</p> <p>3、投资比例</p> <p>(3) 金融衍生品类产品的投资比例低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%；</p>	<p>(四) 集合计划的投资</p> <p>3、投资比例</p> <p>(3) 期货和衍生品类产品的投资比例低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%；</p>
15	“五、资产管理计划的基本情况”	<p>(四) 集合计划的投资</p> <p>3、投资比例</p> <p>本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的有关规定，因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合相关要求。如确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p>	<p>(四) 集合计划的投资</p> <p>3、投资比例</p> <p>本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的有关规定，因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合相关要求。如确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p>
16	“五、资产管理计划的基本情况”	<p>(十) 封闭期、开放期安排</p> <p>本集合计划成立后，每季度开放一次，每年 3 月、6 月、9 月、12 月份的最后一个周五开放，如对应周五非工作日则当周最后一个工作日开放，开放期可以办理参与、退出业务。</p>	<p>(十) 封闭期、开放期安排</p> <p>本集合计划自合同变更生效日起每月第三周最后一个工作日为开放日，投资者可以办理参与、退出业务。每笔份额锁定 6 个月，投资者可在锁定期满 6 个月之后的退出开放日办理退出</p>

		<p>1、临时开放期 因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、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或因本计划运作的实际情况需要变更合同及在发生其他必要情况时，管理人有权设定临时开放期。投资者在临时开放期仅可以办理退出业务。临时开放期的具体安排以管理人公告或管理人向投资者发出的通知为准，管理人需提前通知托管人及运营服务机构。</p> <p>如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放期时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排执行。</p> <p>2、预约服务 对于开放期的参与、退出业务，本集合计划采取预约申请机制。以开放日为T日，开放日当天交易时间内管理人仅接受委托人参与不接受委托人退出申请，委托人参与申请在T日15:00后不可撤销。T-15到T-10日为预约申请期，在预约申请期内管理人接受委托人预约退出申请和预约参与申请，预约申请在T-10日15:00后不可撤销，在非预约申请期不接受委托人预约参与和预约退出申请，所有的有效预约申请在最近的开放日进行受理。具体预约规则以管理人公告为准。</p>	<p>业务。</p> <p>1、临时开放期 临时开放期指因法律、法规、规章、中国证监会、基金业协会的规定、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或因本计划运作的实际情况需要变更合同及在发生其他必要情况时，管理人有权设定临时开放期。投资者在临时开放期仅可以办理退出业务。临时开放期的具体安排以管理人公告或管理人向投资者发出的通知为准。</p> <p>如因其他目前未可预见的监管变动或行业特殊情况须安排临时开放期时，管理人将按照监管要求或征询监管意见后安排执行。</p> <p>2、预约服务 对于开放期的参与、退出业务，本集合计划采取预约申请机制。以开放日为T日，开放日当天交易时间内管理人仅接受投资者参与不接受投资者退出申请，投资者参与申请在T日15:00后不可撤销。T-15到T-10日为预约申请期，在预约申请期内管理人接受投资者预约退出申请和预约参与申请，预约申请在T-10日15:00后不可撤销，在非预约申请期不接受投资者预约参与和预约退出申请，所有的有效预约申请在最近的开放日进行受理。具体预约规则以管理人公告为准。</p>
17	“五、资产管理计划的基本情况”	<p>(十二) 本集合计划的各项费用</p> <p>1、认购/申购费：0.6%；</p> <p>2、退出费：按持有期天数计算；</p> <p>3、管理费率：0.6%；</p> <p>4、业绩报酬：参见合同集合计划的费用与税收部分；</p> <p>5、托管费率：0.02%；</p>	<p>(十二) 本集合计划的各项费用</p> <p>1、认购/申购费：无；</p> <p>2、退出费：无；</p> <p>3、管理费率：0.5%；</p> <p>4、业绩报酬：参见合同集合计划的费用与税收部分；</p> <p>5、托管费率：0.02%；</p>

		6、其他费用：参见合同集合计划的费用税收部分。	6、其他费用：参见合同集合计划的费用税收部分。
18	“五、资产管理计划的基本情况”	<p>(十三) 预警止损机制</p> <p>本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人应于 R+1 日日终计划份额单位净值核对一致后以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：</p> <p>1、本计划预警线为 0.85 元。当本计划份额日终单位净值<0.85 元时（该交易日称为“R”日），则自 R+2 日起，管理人仅可卖出、赎回金融产品和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至 0.85 元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>2、本计划止损线为 0.80 元。本计划份额日终单位净值<0.80 元时（该交易日称为“R”），则自 R+2 日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的下一交易日为本计划提前终止日。</p>	<p>(十三) 预警止损机制</p> <p>本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人应于日终计划份额单位净值核对一致后及时以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：</p> <p>1、本计划预警线为 0.85 元。当本计划份额日终单位净值<0.85 元时（该交易日称为“R”日），则自 R+2 日起，管理人仅可卖出、赎回金融产品和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至 0.85 元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>2、本计划止损线为 0.80 元。本计划份额日终单位净值<0.80 元时（该交易日称为“R”），则自 R+2 日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的下一交易日为本计划提前终止日。</p>
19	“六、集合计划的募集”	<p>(五) 集合计划认购</p> <p>1、认购费：0.6%</p>	<p>(五) 集合计划认购</p> <p>1、认购费：0%</p>
20	“七、集合计划的成立与备案”	<p>(一) 集合计划成立的条件和日期</p> <p>募集期内，集合计划的参与资金总额不低于 1000 万元人民币，投资者的人数为 2 人（含）以上且不超过 200 人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并在集合计划募</p>	<p>(一) 集合计划成立的条件和日期</p> <p>募集期内，集合计划的参与资金总额不低于 1000 万元人民币，投资者的人数为 2 人（含）以上且不超过 200 人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定的，管理人宣布本集合</p>

		集资金缴足之日起 10 个工作日内经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本集合计划成立。集合计划成立时间以管理人正式发出的成立公告为准。	计划成立。集合计划成立时间以管理人正式发出的成立公告为准。						
21	“七、集合计划的成立与备案”	<p>(三) 集合计划开始运作的条件和日期</p> <p>1、本集合计划开始运作的前提条件：本集合计划符合本合同约定的成立条件并经管理人公告成立。</p> <p>2、本集合计划的备案：管理人应在集合计划成立起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。集合计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。</p> <p>3、本集合计划开始运作的日期：本集合计划自完成备案之日起开始投资运作，但以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</p>	<p>(三) 集合计划开始运作的条件和日期</p> <p>1、本集合计划开始运作的前提条件：本集合计划符合本合同约定的成立条件并经管理人公告成立。</p> <p>2、本集合计划的备案：管理人应在集合计划成立起 5 个工作日内报证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。集合计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。本集合计划自完成备案之日前不得开始投资运作，但以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</p> <p>3、管理人开展投资活动前，应及时向托管人发送成立通知。备案完成后，应及时向托管人发送备案通过的材料。</p>						
22	“八、集合计划的参与、退出与转让”	<p>(二) 集合计划的参与</p> <p>3、参与费及参与份额的计算</p> <p>(1) 参与费率：0.6%</p> <p>(三) 集合计划的退出</p> <p>3、退出费率及退出金额的计算</p> <p>(1) 本集合计划退出费率：</p> <table border="1" data-bbox="555 1171 1158 1351"> <thead> <tr> <th>持有期天数 R (自然日)</th> <th>退出费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>R ≤ 100 天</td> <td>1.5%</td> </tr> <tr> <td>100 天 < R ≤ 200 天</td> <td>1.0%</td> </tr> </tbody> </table>	持有期天数 R (自然日)	退出费率	R ≤ 100 天	1.5%	100 天 < R ≤ 200 天	1.0%	<p>(二) 集合计划的参与</p> <p>3、参与费及参与份额的计算</p> <p>(1) 参与费率：0%</p> <p>(三) 集合计划的退出</p> <p>3、退出费率及退出金额的计算</p> <p>(1) 本集合计划退出费率：0%</p>
持有期天数 R (自然日)	退出费率								
R ≤ 100 天	1.5%								
100 天 < R ≤ 200 天	1.0%								

		<table border="1"> <tr> <td>200天<R≤360天</td> <td>0.5%</td> </tr> <tr> <td>R>360天</td> <td>0%</td> </tr> </table>	200天<R≤360天	0.5%	R>360天	0%	
200天<R≤360天	0.5%						
R>360天	0%						
		退出费 100%归计划资产。					
23	“八、集合计划的参与、退出与转让”	<p>(十一) 证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与集合计划</p> <p>1、全体投资者和托管人在此不可撤销地同意并授权证券期货经营机构及其附属机构可在募集期以自有资金参与本集合计划，事后管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者，并及时通过电子邮件、纸质文件等方式告知托管人。</p> <p>在开放期内由于投资者退出导致的管理人自有资金投资被动超标的，无需事先取得投资者同意，但管理人在自有资金退出后及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者，并及时通过电子邮件、纸质文件等方式告知托管人。</p> <p>除上述情形外的自有资金参与、退出情形，管理人应当提前五个工作日通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者，并提前五个工作日通过电子邮件、纸质文件等方式告知托管人，并取得投资者和托管人的同意。</p> <p>证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与、退出本集合计划的，应符合《管理办法》《运作规定》和中国证监会等监管机构的规定。</p> <p>2、管理人将与投资者按照持有本集合计划份额的比例共担风险和共享收益。</p>	<p>(十一) 证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与和退出集合计划</p> <p>1、全体投资者和托管人在此不可撤销地同意并授权证券期货经营机构及其附属机构可在募集期以自有资金参与本集合计划，事后证券期货经营机构应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者，并及时通过电子邮件、纸质文件等方式告知托管人。</p> <p>在开放期内由于投资者退出导致的证券期货经营机构自有资金投资被动超标的，无需事先取得投资者同意，但证券期货经营机构在自有资金退出后及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者，并及时通过电子邮件、纸质文件等方式告知托管人。</p> <p>除上述情形外的自有资金参与、退出情形，证券期货经营机构应当提前五个工作日通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者，并提前五个工作日通过电子邮件、纸质文件等方式告知托管人，并取得投资者和托管人的同意。</p> <p>证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与、退出本集合计划的，应符合《管理办法》《运作规定》和中国证监会等监管机构的规定。</p> <p>2、证券期货经营机构将与投资者按照持有本集合计划份额的比例共担风险和共享收益。</p>				

		<p>3、证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与本集合资产管理计划的份额合计不得超过该计划总份额的 50%，中国证监会对管理人自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超比例的，管理人应在上述情形出现的 20 个工作日内进行调整。</p> <p>4、自有资金参与本集合计划的持有期限不得少于 6 个月。</p> <p>5、为应对巨额退出以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与、退出可不受上述条款的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p>	<p>3、证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与本集合资产管理计划的份额合计不得超过该计划总份额的 50%，中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超比例的，证券期货经营机构应在上述情形出现的 20 个工作日内进行调整。</p> <p>4、证券期货经营机构及其附属机构自有资金参与本集合计划的持有期限不得少于 6 个月。</p> <p>5、为应对巨额退出以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与、退出可不受上述条款的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p>
24	“八、集合计划的参与、退出与转让”	新增（十三）其他事项	（十三）其他事项 资产管理计划向投资者支付的受托资金及收益应当返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或者同名账户。
25	“十一、集合计划的投资”	<p>（二）投资范围</p> <p>（1）金融产品类资产：包括公募证券投资基金，证券公司、基金管理公司、期货公司及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司发行的集合资产管理计划（含原法规下已设立的同类私募基金产品）和在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金，前述私募基金产品的投资范围不含非标准化资产；</p> <p>（2）固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的债券；</p> <p>（3）现金类资产：现金、银行存款、货币市场工具、货币市</p>	<p>（二）投资范围</p> <p>（1）金融产品类资产：包括公募证券投资基金，证券公司、基金管理公司、期货公司、保险公司、信托公司、银行及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司发行的集合资产管理计划、信托计划、银行理财和在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金，前述私募基金产品的投资范围不含非标准化资产；</p> <p>（2）固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的债券；</p> <p>（3）现金类资产：现金、银行存款、货币市场工具、货币市</p>

		<p>场基金等现金类资产。</p> <p>(4) 金融衍生品类资产：国债期货、股指期货和场内期权。</p> <p>(5) 本计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）交易。</p>	<p>场基金等现金类资产。</p> <p>(4) 期货和衍生品类资产：国债期货、股指期货和场内期权。</p> <p>(5) 本计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）交易。</p>
26	“十一、集合计划的 投资”	<p>(三) 投资比例</p> <p>3、金融衍生品类产品的投资比例低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%；</p>	<p>(三) 投资比例</p> <p>3、期货和衍生品类产品的投资比例低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%；</p>
27	“十一、集合计划的 投资”	<p>(三) 投资比例</p> <p>本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的有关规定，因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个工作日内调整至符合相关要求。如确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p>	<p>(三) 投资比例</p> <p>本集合计划投资组合应当符合法律、行政法规和中国证监会的有关规定，因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个工作日内调整至符合相关要求。如确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p>
28	“十一、集合计划的 投资”	<p>(八) 投资限制及禁止行为</p> <p>1、投资限制</p> <p>新增 (4)</p> <p>新增 (5)</p>	<p>(八) 投资限制及禁止行为</p> <p>1、投资限制</p> <p>新增 (4)</p> <p>(4) 本集合计划参与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，且不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>新增 (5)</p> <p>(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，本集合计划的总资产不得超过净资产的120%。本集合计划投资于国债、中央银行票据、政策性金</p>

			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；
29	“十一、集合计划的投资”	<p>(十二) 预警止损机制</p> <p>本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人应于 R+1 日日终计划份额单位净值核对一致后以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：</p> <p>1、本计划预警线为 0.85 元。当本计划份额日终单位净值 < 0.85 元时（该交易日称为“R”日），则自 R+2 日起，管理人仅可卖出、赎回金融产品和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至 0.85 元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>2、本计划止损线为 0.80 元。本计划份额日终单位净值 < 0.80 元时（该交易日称为“R”），则自 R+2 日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的下一交易日为本计划提前终止日。</p>	<p>(十二) 预警止损机制</p> <p>本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人应于日终计划份额单位净值核对一致后及时以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：</p> <p>1、本计划预警线为 0.85 元。当本计划份额日终单位净值 < 0.85 元时（该交易日称为“R”日），则自 R+2 日起，管理人仅可卖出、赎回金融产品和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至 0.85 元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>2、本计划止损线为 0.80 元。本计划份额日终单位净值 < 0.80 元时（该交易日称为“R”），则自 R+2 日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的下一交易日为本计划提前终止日。</p>
30	“十四、利益冲突及关联交易”	<p>(二) 存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容及频率</p> <p>3、存在利益冲突时的披露内容和频率</p> <p>(1) 管理人运用受托管理资产从事一般关联交易的，一般关联交易事后，管理人将定期通过电子邮件、传真、纸质文件</p>	<p>(二) 存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容及频率</p> <p>3、存在利益冲突时的披露内容和频率</p> <p>(1) 管理人运用受托资产从事一般关联交易的，一般关联交易事后，管理人将定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站</p>

	<p>或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，管理人将及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前取得投资者同意；重大关联交易事后，管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>（三）关联交易</p> <p>1、本合同所称关联方包括：</p> <p>（1）管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>（2）资产管理计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>（3）法律法规、其他规范性文件或中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构对关联方另有规定的，从其规定。</p> <p>2、一般关联交易和重大关联交易</p> <p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易具体指管理人运用委托财产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销证券，除此以外的其他关联交易为一般关联交易。法律法规、监管及自律机构对关联交易业务规范有其他规定的，从其规定。</p> <p>投资者在此不可撤销地确认，投资者签署本合同即事先同意并授权管理人可将本资产管理计划从事一般关联交易；一般关联交易事后，管理人应定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会派出机构报告，具体以法律法规、中国证监会或证券投资基</p>	<p>公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>管理人运用受托资产从事重大关联交易的，管理人将及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前取得投资者同意；重大关联交易事后，管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>（三）关联交易</p> <p>1、本合同所称关联方包括：资产管理计划管理人以及管理人管理的其他账户，管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方，管理人的子公司以及子公司管理的账户，资产管理计划托管人以及托管人的关联方，其他与资产管理计划管理人或托管人有重大利害关系的机构。管理人的关联方名单将于管理人网站披露，托管人的关联方名单以本合同约定为准或以托管人公布的年度报告或其他定期报告中披露的关联方名单为准，投资者可按上述路径进行查阅。</p> <p>2、资产管理计划的关联方与资产管理计划之间的交易视为资产管理计划的关联交易，包括但不限于：</p> <p>（1）投资关联方发行或承销的证券；</p> <p>（2）以关联方为交易对手进行银行间市场等场外交易；</p> <p>（3）通过关联方席位进行交易；</p> <p>（4）其他导致资产管理计划与关联方之间发生利益转移的活动。</p> <p>3、一般关联交易和重大关联交易</p> <p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易具体指管理人运用财产出资投资于管理人、托管</p>
--	---	---

	<p>金业协会等监管机构的规定为准。</p> <p>若从事重大关联交易的，管理人应当通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前通知投资者，事先取得投资者的同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。投资者未在约定时间内提出书面异议的视为同意，投资者提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确；重大关联交易事后，管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>3、关联交易的内部控制机制</p> <p>管理人应当遵循诚信公平、投资者利益优先原则，以公平、合理的市场价格进行关联交易，防范利益冲突，禁止利益输送，保护投资者权益。管理人已制定相应的关联交易管理制度，明确了关联交易的认定标准、交易定价方法、信息披露、内部审批和评估机制等。本集合计划开展关联交易前，将采取一事一批的形式，说明交易的必要性和相关费用定价的公允性、合理性。不得以集合计划的资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场。管理人内部制度对关联交易有新的规定的，从其规定。</p> <p>（四）其他</p> <p>1、除将本资产管理计划资产投资于管理人、托管人、及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券外，管理人不得将本资产管理计划资产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业</p>	<p>人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销证券，除此以外的其他关联交易为一般关联交易。法律法规、监管及自律机构对关联交易业务规范有其他规定的，从其规定。</p> <p>投资者在此不可撤销地确认，投资者签署本合同即事先同意并授权管理人可将本资产管理计划从事一般关联交易；一般关联交易事后，管理人应定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会派出机构报告，具体以法律法规、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构的规定为准。</p> <p>若从事重大关联交易的，管理人应当通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前通知投资者，事先取得投资者的同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。投资者未在约定时间内提出书面异议的视为同意，投资者提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确；重大关联交易事后，管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>4、关联交易的内部控制机制</p> <p>（1）管理人应当遵循诚信公平、投资者利益优先原则，以公平、合理的市场价格进行关联交易，防范利益冲突，禁止利益输送，保护投资者权益。管理人已制定相应的关联交易管理制度，明确了关联交易的认定标准、交易定价方法、信息披露、内部审批和评估机制等。本集合计划开展关联交易前，将采取一事一批的形式，说明交易的必要性和相关费用定价的公允性、合理性。不得以集合计划的资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场。管理人内部制度对关联交易</p>
--	---	--

		<p>投资者（专业投资者为私募资产管理产品的，穿透认定该私募资产管理产品的投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元）且单个委托人投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得投资者同意的除外。</p> <p>2、法律法规、其他规范性文件、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构或管理人内部制度对关联方的范围、一般关联交易和重大关联交易的区分、管理人的内控机制、存在利益冲突的情形、存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容和频率等另有规定或要求的，管理人遵照执行。</p> <p>3、管理人将通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式向投资者披露关联方名单。</p>	<p>有新的规定的，从其规定。</p> <p>（2）审批程序</p> <p>业务部门在上报业务审批时，应就业务是否存在关联交易进行明确说明。暂时不存在关联交易的无需说明，后期投资过程中如涉及的需另行发起审批。在公司关联交易已审批额度内的投资者认购和标准化资产通过系统直接交易的，仍应按照规定进行信息披露、报送、报告等。</p> <p>交易事项经判断属于重大关联交易的，投资经理及其他业务人员在每次投资执行前应提交投资决策委员会审议，经投资决策委员会审议同意后方可执行，并按公司制度要求报备，根据规定接受审计。</p> <p>所有关联交易在投资前均应当按照法律法规和资管合同的约定履行投资者的提前告知并征得投资者同意方可执行。在资管合同中明确约定已经取得投资者的概括授权同意的一般关联交易除外。</p> <p>（四）其他</p> <p>1、除将本资产管理计划资产投资于管理人、托管人、及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券外，管理人不得将本资产管理计划资产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者为私募资产管理产品的，穿透认定该私募资产管理产品的投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元）且单个投资者投资金额不低于</p>
--	--	--	---

			<p>1000 万元，并且事先取得投资者同意的除外。</p> <p>2、法律法规、其他规范性文件、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构或管理人内部制度对关联方的范围、一般关联交易和重大关联交易的区分、管理人的内控机制、存在利益冲突的情形、存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容和频率等另有规定或要求的，管理人遵照执行。</p>
31	“十五、投资经理的指定与变更”	<p>(一) 投资经理简介</p> <p>管理人指定乔伟与吴贤敏为本集合计划投资经理。</p> <p>乔伟简历如下：</p> <p>乔伟，2019 年 10 月入职世纪证券有限责任公司，现任资产管理部副总经理兼 FOF 投资总监。毕业于清华大学软件工程专业，硕士研究生学历。乔伟对宏观经济走势、资产轮动规律、策略归因分析理解深刻，擅长定性与定量分析相结合、自上而下和自下而上相结合的投资方式，积累出一套行之有效的基金筛选和配置模型，在市场变化中优化调整大类资产及策略配置方向，拥有 12 年金融从业经验。乔伟历任中国外汇交易中心暨全国银行间拆借中心经理；上海光大证券资产管理有限公司研究员、投资经理、固定收益投资部副总经理；东吴证券资产管理总部投研总监；国联证券证券投资部副总经理。具有管理固定收益类、股债混合类、基金类资产的丰富经验，历史业绩优秀。</p> <p>吴贤敏简历如下：</p> <p>吴贤敏，男，2020 年 7 月加入世纪证券有限责任公司，现任资产管理部 FOF 投资经理。浙江大学数学与应用数学学士，美国哥伦比亚大学金融数学硕士。曾任高盛资管另类投资部</p>	<p>(一) 投资经理简介</p> <p>管理人指定吴贤敏为本集合计划投资经理。</p> <p>吴贤敏简历如下：</p> <p>吴贤敏，男，2020 年 7 月加入世纪证券有限责任公司，现任资产管理部 FOF 投资经理。浙江大学数学与应用数学学士，美国哥伦比亚大学金融数学硕士。曾任高盛资管另类投资部副总裁，擅长结合量化模型搭建包括基金筛选、尽职调查、资产配置、组合优化、风险管理、投后监控等在内的海外成熟基金投研框架。</p> <p>管理人承诺投资经理吴贤敏已取得证券从业资格、基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p>

		<p>副总裁，擅长结合量化模型搭建包括基金筛选、尽职调查、资产配置、组合优化、风险管理、投后监控等在内的海外成熟基金投研框架。</p> <p>管理人承诺投资经理乔伟与吴贤敏已取得证券从业资格、基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p>	
32	“十六、集合计划的财产”	<p>(二) 集合计划财产的保管与处分</p> <p>1、集合计划的债务由集合计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对集合计划财产的债务承担责任。</p>	<p>(二) 集合计划财产的保管与处分</p> <p>1、资产管理计划财产为信托财产，其债务由资产管理计划财产本身承担，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。</p>
33	“十六、集合计划的财产”	<p>(三) 集合计划财产相关账户的开立和管理</p> <p>3、定期存款账户</p> <p>集合计划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，其预留印鉴经各方商议后预留。本着便于集合计划的安全保管和日常监督核查的原则，存款行应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专户（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或者复印件。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（即本集合计划</p>	<p>(三) 集合计划财产相关账户的开立和管理</p> <p>3、定期存款账户</p> <p>投资定期存款的银行账户的开立和管理 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</p>

		<p>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> <p>6、通过代销方式投资开放式基金的账户开立 管理人应在通过销售机构投资于开放式证券投资基金前, 书面告知托管人指定销售机构名称及监管账户信息, 格式如下: (1) 指定的销售机构为: (2) 销售机构银行监管账户如下: 开户行: 开户名: 账户号: 新增7</p>	<p>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> <p>6、通过代销方式投资开放式基金的账户开立 管理人应在通过销售机构投资于开放式证券投资基金前, 书面告知托管人指定销售机构名称及监管账户信息。 新增7 7、期货账户的开立和管理</p>
34	“十七、投资指令的发送、确认和执行”	修改 (一) 交易清算授权	(一) 投资指令的授权
35	“十七、投资指令的发送、确认和执行”	<p>(十) 交易及清算交收安排 本集合资产管理计划交易及清算交收安排适用于管理人与托管人另行签署的《世纪证券系列集合资产管理计划之资产托管协议 (托管人结算模式【统签】)》</p>	<p>(十) 交易及清算交收安排 1、选择证券经纪机构的程序 (1) 资产管理人负责选择代理本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构, 并与其签订证券交易单元使用协议。 (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。 (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。 2、投资证券后的清算交收安排</p>

			<p>(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： 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>(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：</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），根据相关授权文件约定，资产管理人无需向资产托管人发送交易应付资金划款指令，系统自动从对应产品的托管账户将该笔金额划入非担保备付金账户用以完成交收，划款成功后系统自动勾单。其中对于 15:45 产品托管账户仍头寸不足的深圳 RTGS 交易交收，知悉并授权贵行进行交收撤销。</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</p>
--	--	--	--

			<p>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>（a）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；</p> <p>（b）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>（c）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>（d）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, 根据相关授权文件约定, 当需勾单确认的交易为收款时, 即该笔交易不需管理人划款, 系统自动勾单。</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</p> <p>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。</p> <p>3、银行间交易资金结算安排</p> <p>(1) 管理人负责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发生的纠纷。</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发送给托管人, 并电话确认 (已向托管人出具银行间交易取消成交单传送授权函的除外)。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。</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</p>
--	--	--	---

			<p>账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足导致的损失，由过错方承担相应的责任。</p> <p>4、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）申请单一并发送至托管人。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，应立即发送至托管人。</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发送至托管人；管理人在收到赎回确认回单后，应及时发送至托管人。</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/扫描件，要求并督促基金管理公司于当日发送给管理人，管理人收到后应立即发送至托管人。</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定期存款协议。</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</p>
--	--	--	--

			<p>行存款投资的，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、期货投资的清算交收安排 本计划相关期货投资的具体操作按照管理人、托管人及期货经纪机构签署的《期货投资操作备忘录》（以实际名称为准）的约定执行。</p> <p>7、股票质押式回购交易的清算交收 （1）股票质押式回购交易按照沪深交易所与登记结算公司交易规则执行，具体由管理人与融入方签订《股票质押式回购交易业务协议》及相关表单，由管理人或管理人委托的证券公司负责股票质押式回购交易的融入方的资质审核、交易议价、交易申报、盯市管理、违约处置、质押监控等事宜，并对股票质押回购初始交易及相应的补充质押、部分解除质押进行合并管理，如融入方出现违约、司法冻结情形的，管理人应按照本合同的约定履行信息披露义务，托管人仅配合进行账务处理。 （2）股票质押式回购交易的质权人为管理人。</p> <p>8、其他场外交易资金结算 （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提供至托管人，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。 （2）托管人负责审核划款指令要素和交易文件中对应要素（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>(3) 投资私募证券投资基金的清算交收安排 本计划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托管人提供。</p> <p>(4) 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>(a) 协议转让 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。 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、被投资公司分红等情形）的唯一收款账户。</p> <p>(b) 上市变现 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> <p>9、资金、证券账目及交易记录的核对</p>
--	--	--	---

			<p>管理人和托管人应定期对账。</p> <p>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。</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>
36	“十八、越权交易的界定”	<p>(二) 越权交易的处理程序</p> <p>1、违反有关法律法规和本合同的规定进行的投资交易行为：</p> <p>(3) 管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地中国证监会派出机构。</p>	<p>(二) 越权交易的处理程序</p> <p>1、违反有关法律法规和本合同的规定进行的投资交易行为：</p> <p>(3) 管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会派出机构。</p>
37	“十八、越权交易的界定”	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、对本合同约定的投资范围按照如下标准进行监督：</p> <p>(1) 金融产品类资产：包括公募证券投资基金，证券公司、基金管理公司、期货公司及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司发行的集合资产管理计划（含原法规下已设立的同类私募基金产品）和在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金，前述私募基金产品的投资范围不含非标准化资产；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的债券；</p> <p>(3) 现金类资产：现金、银行存款、货币市场工具、货币市</p>	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、对本合同约定的投资范围按照如下标准进行监督：</p> <p>(1) 金融产品类资产：包括公募证券投资基金，证券公司、基金管理公司、期货公司、保险公司、信托公司、银行及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司发行的集合资产管理计划、信托计划、银行理财和在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金，前述私募基金产品的投资范围不含非标准化资产；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的债券；</p> <p>(3) 现金类资产：现金、银行存款、货币市场工具、货币市</p>

		<p>场基金等现金类资产。</p> <p>(4) 金融衍生品类资产：国债期货、股指期货和场内期权。</p> <p>(5) 本计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）交易。</p>	<p>场基金等现金类资产。</p> <p>(4) 期货和衍生品类资产：国债期货、股指期货和场内期权。</p> <p>(5) 本计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）交易。</p>
38	“十八、越权交易的界定”	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>2、对本计划以下投资比例和投资限制进行监督：</p> <p>(4) 金融衍生品类产品的投资比例低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%；</p> <p>新增（8）</p> <p>新增（9）</p>	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>2、对本计划以下投资比例和投资限制进行监督：</p> <p>(4) 期货和衍生品类产品的投资比例低于资产总值的80%或衍生品账户权益不超过资产总值的20%；</p> <p>新增（8）</p> <p>(8) 本集合计划参与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，且不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>新增（9）</p> <p>(9) 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，本集合计划的总资产不得超过净资产的120%。本集合计划投资于国债、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；</p>
39	“十八、越权交易的界定”	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>3、托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内，对本计划的直接投资履行监督职能。托管人发现管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同时，不予执行，应当通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式向托管人进行解释或举证，由此造成的损失由管理人承担。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能</p>	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>3、托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内，对本计划的投资履行监督职能。托管人发现管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同时，不予执行，应当通知管理人限期纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式向托管人进行解释或举证，由此造成的损失由管理人承担。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，托</p>

		<p>在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地证监会派出机构、证券投资基金业协会。</p> <p>6、如需托管人对本计划关联交易进行监督的，管理人应于合同生效前提供管理人关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。若管理人没有及时提供关联方信息，导致托管人无法及时对关联方证券进行监督，所产生的一切后果过错方承担责任。托管人应根据自身的关联方名单对本计划关联交易进行监督。</p> <p>新增7</p>	<p>管人应报告证监会派出机构。</p> <p>6、如需托管人对本计划关联交易进行监督的，管理人应于合同生效前提供管理人关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。托管人仅根据上述名单对资产管理计划买卖关联方发行的或者承销期内承销的证券进行关联交易监督。若管理人没有及时提供关联方信息，导致托管人无法及时对关联方证券进行监督，所产生的一切后果过错方承担责任。托管人应根据自身的关联方名单对本计划关联交易进行监督。</p> <p>新增7</p> <p>7、投资监督事项涉及穿透核查或穿透计算的，管理人应当定期向托管人提供穿透所需的相关材料和数据，托管人仅凭管理人提供的材料进行核查监督，托管人核查监督的及时性、准确性受限于管理人提供信息的频率和信息的完整性、准确性。</p>
40	“十八、越权交易的界定”	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督 删除</p> <p>9、对本合同约定的预警止损线按照如下标准进行监督： 本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当R日计划份额净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人应于R+1日日终计划份额单位净值核对一致后以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下： (1) 本计划预警线为0.85元。当本计划份额日终单位净值<0.85元时（该交易日称为“R”日），则自R+2日起，管理人</p>	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督 删除</p>

		<p>仅可卖出、赎回金融产品和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至0.85元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>（2）本计划止损线为0.80元。本计划份额日终单位净值<0.80元时（该交易日称为“R”），则自R+2日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的下一交易日为本计划提前终止日。</p>	
41	“十九、集合计划财产的估值和会计核算”	<p>7、估值方法</p> <p>（2）具体投资品种估值方法：</p> <p>（f）投资证券投资基金的估值方法</p> <p>持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。</p> <p>（h）私募基金产品，包括证券公司、基金管理公司、期货公司及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司发行的集合资产管理计划（含原法规下已设立的同类私募基金产品）和在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金，按照估值日私募基金产品的单位净值估值（若公布净值的同时，也提供扣除掉业绩报酬后的虚拟净值，优先选择按虚拟净值估值），如估值日单位净值未公布的，以前最近一个交易日产品份额净值计算。托管人不复核净值信息是否准确，仅根据管理人提供的净值信息估值。</p> <p>9、估值错误与遗漏的处理方式</p> <p>（3）管理人计算的集合计划单位净值由托管人复核确认后向</p>	<p>7、估值方法</p> <p>（2）具体投资品种估值方法：</p> <p>（f）投资证券投资基金的估值方法</p> <p>持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照估值技术估值。</p> <p>（h）证券公司、基金管理公司、期货公司、保险公司、信托公司、银行及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司发行的资产管理计划、信托计划、银行理财、在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金以及其它受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品，按照估值日产品的单位净值估值（若公布净值的同时，也提供扣除掉业绩报酬后的虚拟净值，优先选择按虚拟净值估值），如估值日单位净值未公布的，以前最近一个交易日产品份额净值计算。托管人不复核净值信息是否准确，仅根据管理人提供的净值信息估值。</p> <p>9、估值错误与遗漏的处理方式</p> <p>（3）管理人计算的集合计划单位净值由托管人复核确认后向</p>

		<p>投资者披露，当发生估值错误时，由管理人负责处理，托管人应予以配合并协助处理。如果该等估值给集合计划投资者或集合计划资产造成了实际损失，除本集合计划资产管理合同和托管协议约定的免责条款外，管理人和托管人应根据实际情况界定双方承担的责任；对于不应由其承担的责任，管理人有权按照以下约定向过错方追偿。</p> <p>(b) 差错处理原则</p> <p>5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因集合计划管理人过错造成集合计划资产损失，集合计划托管人应为集合计划的利益向集合计划管理人追偿；如果因集合计划托管人过错造成集合计划资产损失，集合计划管理人应为集合计划的利益向集合计划托管人追偿。除集合计划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，由集合计划管理人负责向差错方追偿。</p>	<p>投资者披露，当发生估值错误时，由管理人负责处理，托管人应予以配合并协助处理。如果该等估值给集合计划投资者或集合计划资产造成了实际损失，除本集合计划资产管理合同约定的免责条款外，管理人和托管人应根据实际情况界定双方承担的责任；对于不应由其承担的责任，管理人有权按照以下约定向过错方追偿。</p> <p>(b) 差错处理原则</p> <p>5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因集合计划托管人过错造成集合计划资产损失，集合计划管理人应为集合计划的利益向集合计划托管人追偿。除集合计划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，由集合计划管理人负责向差错方追偿。</p>
42	“二十、集合计划的费用与税收”	<p>(一) 集合计划费用</p> <p>1、集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>(1) 管理费</p> <p>管理费按前一日集合计划资产净值的 0.6% 年化费率计算，成立日当日按照成立规模计提管理费。具体计算方法如下： $H = E \times 0.6\% \div 365$</p>	<p>(一) 集合计划费用</p> <p>1、集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>(1) 管理费</p> <p>管理费按前一日集合计划资产净值的 0.5% 年化费率计算，成立日当日按照成立规模计提管理费。具体计算方法如下： $H = E \times 0.5\% \div 365$</p>
43	“二十、集合计划的费用与税收”	<p>(一) 集合计划费用</p> <p>3、业绩报酬</p> <p>(2) 业绩报酬计提办法</p>	<p>(一) 集合计划费用</p> <p>3、业绩报酬</p> <p>(2) 业绩报酬计提办法</p>

		年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬总额 (Y) 的计提公式	年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬总额 (Y) 的计提公式
		$R \leq K$	0	$Y=0$	$R \leq K$	0	$Y=0$
		$R > K$	20%	$Y=A \times (R-K) \times 20\% \times D/365$	$R > K$	10%	$Y=A \times (R-K) \times 10\% \times D/365$
		<p>(3) 业绩报酬支付</p> <p>由于涉及份额注册登记, 业绩报酬的计算及复核由管理人完成。业绩报酬在业绩报酬计提日 (如有) 计提, 由管理人在计提次日向托管人发送业绩报酬划付指令, 托管人根据管理人的划付指令从集合计划资产中将计提的业绩报酬划付给管理人。如托管人与管理人对业绩报酬金额无法达成一致意见的, 以管理人数据为准。若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。</p>			<p>(3) 业绩报酬支付</p> <p>因涉及注册登记数据, 业绩报酬的计算和复核由管理人完成, 托管人根据管理人的划款指令进行划款。业绩报酬在业绩报酬计提日 (如有) 计提, 由管理人在计提次日向托管人发送业绩报酬划付指令, 托管人根据管理人的划付指令从集合计划资产中将计提的业绩报酬划付给管理人。若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。</p>		
44	“二十二、信息披露与报告”	<p>(一) 定期报告</p> <p>3、年度审计报告</p> <p>管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计, 审计机构应当对本集合计划会计核算及净值计算等出具意见。管理人应在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给投资者和托管人。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的, 管理人不编制集合计划当期的年度审计报告。</p>			<p>(一) 定期报告</p> <p>3、年度审计报告</p> <p>管理人应当聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计, 审计机构应当对本集合计划会计核算及净值计算等出具意见。管理人应在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给投资者和托管人。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的, 管理人不编制集合计划当期的年度审计报告。</p>		
45	“二十二、信息披露与报告”	<p>(二) 临时报告</p> <p>8、发生本合同约定的关联交易的事项;</p>			<p>(二) 临时报告</p> <p>8、发生本合同约定的重大关联交易的事项;</p>		
46	“二十二、信息披露与报告”	<p>(三) 托管人履职报告 (以下称“托管报告”)</p> <p>1. 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分, 由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后, 确定托管人履职报告内容并向管理人反馈, 同时在管理</p>			<p>(三) 托管人履职报告 (以下称“托管报告”)</p> <p>1. 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分, 由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后, 确定托管人履职报告内容并向管理人反馈, 由管理人根据本合</p>		

		人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。 3. 管理人应当在每年度结束后两个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。	同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。 3. 管理人应当在每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。																								
47	“二十二、信息披露与报告”	(五) 特殊主体参与披露 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参与集合计划，管理人应通过季度报告或其他方式向投资者进行披露，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。	(五) 特殊主体参与披露 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参与集合计划，管理人应通过季度报告或其他方式向投资者进行披露，并向中国证监会相关派出机构报告。																								
48	“二十二、信息披露与报告”	(六) 监管报告 表格 报送主体：管理人 <table border="1"> <thead> <tr> <th>种类</th> <th>事项</th> <th>时间</th> <th>途径</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>报告</td> <td>资管计划成立</td> <td>资产管理计划成立之日起五个工作日内</td> <td>证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构</td> </tr> <tr> <td>报告</td> <td>资管计划变更</td> <td>资产管理合同变更之日起五个工作日内</td> <td>证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构</td> </tr> </tbody> </table>	种类	事项	时间	途径	报告	资管计划成立	资产管理计划成立之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划变更	资产管理合同变更之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	(六) 监管报告 表格 报送主体：管理人 <table border="1"> <thead> <tr> <th>种类</th> <th>事项</th> <th>时间</th> <th>途径</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>报告</td> <td>资管计划成立</td> <td>资产管理计划成立之日起五个工作日内</td> <td>证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构</td> </tr> <tr> <td>报告</td> <td>资管计划变更</td> <td>资产管理合同变更之日起五个工作日内</td> <td>证券投资基金业协会</td> </tr> </tbody> </table>	种类	事项	时间	途径	报告	资管计划成立	资产管理计划成立之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划变更	资产管理合同变更之日起五个工作日内	证券投资基金业协会
种类	事项	时间	途径																								
报告	资管计划成立	资产管理计划成立之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构																								
报告	资管计划变更	资产管理合同变更之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构																								
种类	事项	时间	途径																								
报告	资管计划成立	资产管理计划成立之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构																								
报告	资管计划变更	资产管理合同变更之日起五个工作日内	证券投资基金业协会																								

	报告	资管计划终止	自资产管理计划终止之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构		报告	资管计划终止	自资产管理计划终止之日起五个工作日内	中国证监会相关派出机构
	报告	资管计划清算结果	在资产管理计划清算结束后五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构		报告	资管计划清算结果	在资产管理计划清算结束后五个工作日内	中国证监会相关派出机构
	报告	资管计划因流动性受限等原因延期清算	及时	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构		报告	资管计划因流动性受限等原因延期清算	及时	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
	报告	资管计划产品季报	每季度结束之日起一个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构		报告	资管计划产品季报	每季度结束之日起一个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
	报告	资管计划产品年报	每年度结束之日起四个月内披露	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构		报告	资管计划产品年报	每年度结束之日起四个月内披露	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
	报告	私募资产管理业务季报	每季度结束之日起一个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构		报告	私募资产管理业务季报	每季度结束之日起一个月内	中国证监会相关派出机构
	报告	私募资产管理业务年报	每年度结束之日起四个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构		报告	私募资产管理业务年报	每年度结束之日起四个月内	中国证监会相关派出机构
	报	对私募资产管理业	每年度结束	证券投资基金业		报告	对私募资产管理业务的内部控制情况进行年度审计	每年度结束之日起四个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构

	告	务的内部控制情况进行年度审计	之日起四个月内	协会、中国证监会相关派出机构	报告	重大关联交易	及时	中国证监会相关派出机构
	报告	重大关联交易	发生之日起10个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构、证券期货交易所（如涉及）	报告	一般关联交易	定期	中国证监会相关派出机构
	报告	高级管理人员、私募资产管理业务部门负责人以及投资经理离任	自离任之日起三十个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	高级管理人员、私募资产管理业务部门负责人以及投资经理离任	自离任之日起三十个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
	报表	持续募集情况、投资运作情况、资产最终投向等信息	每月10日前	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报表	持续募集情况、投资运作情况、资产最终投向等信息	每月10日前	证券投资基金业协会
	报表	资管产品数据报送	每月10日前	人民银行	报表	资管产品数据报送	每月10日前	证券投资基金业协会
	报送主体：托管人				报送主体：托管人			
	种类	事项	时间	途径	种类	事项	时间	途径
	报告	私募资产管理业务托管年度报告	每年度结束之日起四个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	私募资产管理业务托管年度报告	每年度结束之日起四个月内	中国证监会相关派出机构
	报	监督管理人的投资	及时	证券投资基金	报告	监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同	及时	中国证监会相关派出机构

		告	运作,发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的	业协会、中国证监会相关派出机构	约定的
49	“二十三、风险揭示”	<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>7、本集合计划属于混合类产品。本集合计划直接投资或通过私募基金产品投资于固定收益类资产、权益类资产和商品及金融衍生品类资产:</p> <p>(1) 当本集合计划投资债券等固定收益类资产时,将面临利率、汇率变化等市场风险带来的债券价格波动风险和信用风险,并进而影响集合计划的收益水平,从而产生风险;</p> <p>(2) 当本集合计划投资股票等权益类资产时,将面临上市公司经营风险以及股票价格波动风险,并进而影响集合计划的收益水平,从而产生风险;</p> <p>(3) 当本集合计划投资商品及金融衍生品时,将面临商品及金融衍生品的高杠杆性、强制平仓等风险,并进而影响集合计划的收益水平,从而产生风险。</p> <p>12、备案风险</p> <p>本集合计划完成备案前不得开展投资活动,仅可以现金管理为目的投资于高流动性资产,如本集合计划不能在短期内完成备案,则将影响本集合计划的投资收益。如本集合计划未能在成立之日起3个月内取得证券投资基金业协会产品备案成功的确认,管理人单方面选择终止本集合计划的或基金业协会不予备案,投资者不但面临投资收益不及预期的风险,</p>	<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>7、本集合计划属于混合类产品。本集合计划直接投资或通过私募基金产品投资于固定收益类资产、权益类资产和期货和衍生品类资产:</p> <p>(1) 当本集合计划投资债券等固定收益类资产时,将面临利率、汇率变化等市场风险带来的债券价格波动风险和信用风险,并进而影响集合计划的收益水平,从而产生风险;</p> <p>(2) 当本集合计划投资股票等权益类资产时,将面临上市公司经营风险以及股票价格波动风险,并进而影响集合计划的收益水平,从而产生风险;</p> <p>(3) 当本集合计划投资期货和衍生品类资产时,将面临期货和衍生品类资产的高杠杆性、强制平仓等风险,并进而影响集合计划的收益水平,从而产生风险。</p> <p>12、备案风险</p> <p>如本集合计划未能在成立之日起3个月内取得证券投资基金业协会产品备案成功的确认,管理人单方面选择终止本集合计划的或基金业协会不予备案,投资者不但面临投资收益不及预期的风险,而且面临资金未按照预期回流的再投资风险。</p> <p>(三) 一般风险揭示</p> <p>7、投资标的风险</p>		

		<p>而且面临资金未按照预期回流的再投资风险。</p> <p>(二) 一般风险揭示</p> <p>7、投资标的风险</p> <p>4) 金融衍生品类资产(如有)的投资可能以套期保值、套利、投机为目的,具有杠杆效应且价格波动剧烈,会放大收益或损失,在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。</p>	<p>4) 期货和衍生品类资产(如有)的投资可能以套期保值、套利、投机为目的,具有杠杆效应且价格波动剧烈,会放大收益或损失,在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。</p>
50	“二十四、合同的变更、终止与财产清算”	<p>(一) 合同的补充、修改与变更</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或根据中国证券投资基金业协会的要求须变更、调整合同条款的,本集合计划将变更合同的相关内容,本合同相关内容及条款按该要求办理并在管理人网站公告。投资者特此授权管理人经与托管人协商,可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改,更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定,更新或修改的内容在管理人网站公告满5个工作日后生效。投资者对更新或修改的内容有异议,可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。</p> <p>6、管理人应当自合同变更之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案,并抄报中国证监会相关派出机构。</p>	<p>(一) 合同的补充、修改与变更</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或根据中国证券投资基金业协会的要求须变更、调整合同条款的,本集合计划将变更合同的相关内容,本合同相关内容及条款按该要求办理并在管理人网站公告。投资者特此授权管理人经与托管人协商,可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改,更新或修改的内容于管理人网站公告所载明的日期起生效。投资者对更新或修改的内容有异议,可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。</p> <p>6、管理人应当自合同变更之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案。</p>
51	“二十四、合同的变更、终止与财产清算”	<p>(四) 集合计划的终止</p> <p>新增(8)</p> <p>管理人应自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案,并抄报中国证监会相关派出机构,前述第(7)项约定的情形除外。</p>	<p>(四) 集合计划的终止</p> <p>新增(8)</p> <p>(8) 管理人有权根据产品的运作情况决定提前终止本计划;管理人应自资产管理计划终止之日起五个工作日内报告证券投资基金业协会,前述第(7)项约定的情形除外。</p>

52	“二十四、合同的变更、终止与财产清算”	<p>(五) 集合计划的清算</p> <p>6、管理人应当在集合计划清算结束后 5 个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；</p> <p>7、集合计划因资产流动性受限等原因延期清算的，管理人可对此制定延期清算方案，该方案应经托管人认可，并在管理人网站公告或其他方式通知投资者。当本集合计划达到可清算条件时，管理人须按照上述清算流程予以清算。当延期清算发生时，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告；</p>	<p>(五) 集合计划的清算</p> <p>6、管理人应当在集合计划清算结束后 5 个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案；</p> <p>7、集合计划因资产流动性受限等原因延期清算的，管理人可对此制定延期清算方案，该方案应经托管人认可，并在管理人网站公告或其他方式通知投资者。当本集合计划达到可清算条件时，管理人须按照上述清算流程予以清算。当延期清算发生时，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告；</p>
53	“二十七、合同效力”	<p>(一) 合同的成立与生效</p> <p>新增</p>	<p>(一) 合同的成立与生效</p> <p>本计划存续期内，管理人应依据法律法规履行相应反洗钱义务，并主动配合托管账户开立结算银行根据监管部门有关反洗钱要求开展客户身份识别工作，提供真实、准确、完整的客户资料；根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，遵守各方反洗钱与反恐怖融资相关管理规定。对具备合理理由怀疑涉嫌洗钱、恐怖融资的客户，任何一方有权按照中国人民银行反洗钱监管规定采取必要管控措施，或单方面终止本合作。</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 2：世纪证券全天候进取 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书变更明细表

序号	位置	原风险揭示书	变更后风险揭示书
1		<p>投资者承诺以真实身份参与集合计划，保证委托资产的来源及用途合法，不得以贷款、发行债券等筹集的非自有资金参与集合计划，所披露或提供的信息和资料真实，并已阅知《世纪证券全天候进取 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”或“《管理合同》”）和集合计划说明书全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。</p> <p>投资者承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于证券投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺证券投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和</p>	<p>投资者承诺以真实身份参与集合计划，保证受托资产的来源及用途合法，不得以贷款、发行债券等筹集的非自有资金参与集合计划，所披露或提供的信息和资料真实，并已阅知《世纪证券全天候进取 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”或“《管理合同》”）和集合计划说明书全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。</p> <p>投资者承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于证券投资的参与资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺证券投资的参与资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。</p>

		逃税等行为；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。	
2	开放期	本集合计划成立后，每季度开放一次，每年3月、6月、9月、12月份的最后一个周五开放，如对应周五非工作日则当周最后一个工作日开放，开放期可以办理参与、退出业务。	本集合计划自合同变更生效日起每月第三周最后一个工作日为开放日，投资者可以办理参与、退出业务。每笔份额锁定6个月，投资者可在锁定期满6个月之后的退出开放日办理退出业务。
3	投资范围	<p>(1) 金融产品类资产：包括公募证券投资基金，证券公司、基金管理公司、期货公司及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司发行的集合资产管理计划（含原法规下已设立的同类私募基金产品）和在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金，前述私募基金产品的投资范围不含非标准化资产；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的债券；</p> <p>(3) 现金类资产：现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金等现金类资产。</p> <p>(4) 金融衍生品类资产：国债期货、股指期货和场内期权。</p> <p>(5) 本计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）交易。</p>	<p>(1) 金融产品类资产：包括公募证券投资基金，证券公司、基金管理公司、期货公司、保险公司、信托公司、银行及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司发行的集合资产管理计划、信托计划、银行理财和在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金，前述私募基金产品的投资范围不含非标准化资产；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所交易的债券；</p> <p>(3) 现金类资产：现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金等现金类资产；</p> <p>(4) 期货和衍生品类资产：国债期货、股指期货和场内期权。</p> <p>(5) 本计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）交易。</p>

			法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。
4	集合计划成立的条件和日期	募集期内，集合计划的参与资金总额不低于1000万元人民币，投资者的人数为2人（含）以上且不超过200人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并在集合计划募集资金缴足之日起10个工作日内经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本集合计划成立。集合计划成立时间以管理人正式发出的成立公告为准。	募集期内，集合计划的参与资金总额不低于 1000 万元人民币，投资者的人数为 2 人（含）以上且不超过 200 人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定的，管理人宣布本集合计划成立。集合计划成立时间以管理人正式发出的成立公告为准。
5	投资限制	新增（4） 新增（5）	新增（4） （4）本集合计划参与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，且不得超过拟发行公司本次发行的总量； 新增（5） （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，本集合计划的总资产不得超过净资产的 120%。本集合计划投资于国债、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	参与、退出	<p>集合计划的参与</p> <p>3、参与费及参与份额的计算</p> <p>(1) 参与费率：0.6%</p> <p>二、集合计划的退出</p> <p>3、退出费率及退出金额的计算</p> <p>(1) 本集合计划退出费率：</p> <table border="1" data-bbox="573 501 1182 778"> <thead> <tr> <th>持有期天数 R (自然日)</th> <th>退出费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>R ≤ 100 天</td> <td>1.5%</td> </tr> <tr> <td>100 天 < R ≤ 200 天</td> <td>1.0%</td> </tr> <tr> <td>200 天 < R ≤ 360 天</td> <td>0.5%</td> </tr> <tr> <td>R > 360 天</td> <td>0%</td> </tr> </tbody> </table> <p>退出费 100% 归计划资产。</p>	持有期天数 R (自然日)	退出费率	R ≤ 100 天	1.5%	100 天 < R ≤ 200 天	1.0%	200 天 < R ≤ 360 天	0.5%	R > 360 天	0%	<p>一、集合计划的参与</p> <p>3、参与费及参与份额的计算</p> <p>(1) 参与费率：0%</p> <p>二、集合计划的退出</p> <p>3、退出费率及退出金额的计算</p> <p>(1) 本集合计划退出费率：0%</p>
持有期天数 R (自然日)	退出费率												
R ≤ 100 天	1.5%												
100 天 < R ≤ 200 天	1.0%												
200 天 < R ≤ 360 天	0.5%												
R > 360 天	0%												
7	费用与税收	<p>1、集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>(1) 管理费</p> <p>管理费按前一日集合计划资产净值的 0.6% 年化费率计算，成立日当日按照成立规模计提管理费。具体计算方法如下： $H = E \times 0.6\% \div 365$</p>	<p>1、集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>(1) 管理费</p> <p>管理费按前一日集合计划资产净值的 0.5% 年化费率计算，成立日当日按照成立规模计提管理费。具体计算方法如下： $H = E \times 0.5\% \div 365$</p>										
8	费用与税收	<p>3、业绩报酬</p> <p>(2) 业绩报酬计提办法</p>	<p>3、业绩报酬</p> <p>(2) 业绩报酬计提办法</p>										

		<table border="1"> <thead> <tr> <th>年化收益率 (R)</th> <th>计提比例</th> <th>业绩报酬总额 (Y) 的计提公式</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R \leq K$</td> <td>0</td> <td>$Y=0$</td> </tr> <tr> <td>$R > K$</td> <td>20%</td> <td>$Y=A \times (R-K) \times 20\% \times D/365$</td> </tr> </tbody> </table> <p>K 为业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准由管理人公告，业绩报酬计提基准将在产品的推广公告中列示，若产品存续期间，管理人需变更业绩报酬计提基准的，则管理人将公告新的业绩报酬计提基准，管理人将设置临时开放期供不同意新的业绩报酬计提基准的委托人退出。</p> <p>(3) 业绩报酬支付</p> <p>由于涉及份额注册登记，业绩报酬的计算及复核由管理人完成。业绩报酬在业绩报酬计提日（如有）计提，由管理人在计提次日向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人的划付指令从集合计划资产中将计提的业绩报酬划付给管理人。如托管人与管理人对业绩报酬金额无法达成一致意见的，以管理人数据为准。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</p>	年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬总额 (Y) 的计提公式	$R \leq K$	0	$Y=0$	$R > K$	20%	$Y=A \times (R-K) \times 20\% \times D/365$	<table border="1"> <thead> <tr> <th>年化收益率 (R)</th> <th>计提比例</th> <th>业绩报酬总额 (Y) 的计提公式</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R \leq K$</td> <td>0</td> <td>$Y=0$</td> </tr> <tr> <td>$R > K$</td> <td>10%</td> <td>$Y=A \times (R-K) \times 10\% \times D/365$</td> </tr> </tbody> </table> <p>K 为业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准由管理人公告，业绩报酬计提基准将在产品的推广公告中列示，若产品存续期间，管理人需变更业绩报酬计提基准的，则管理人将公告新的业绩报酬计提基准，管理人将设置临时开放期供不同意新的业绩报酬计提基准的投资者退出。</p> <p>(3) 业绩报酬支付</p> <p>因涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核由管理人完成，托管人根据管理人的划款指令进行划款。业绩报酬在业绩报酬计提日（如有）计提，由管理人在计提次日向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人的划付指令从集合计划资产中将计提的业绩报酬划付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</p>	年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬总额 (Y) 的计提公式	$R \leq K$	0	$Y=0$	$R > K$	10%	$Y=A \times (R-K) \times 10\% \times D/365$
年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬总额 (Y) 的计提公式																			
$R \leq K$	0	$Y=0$																			
$R > K$	20%	$Y=A \times (R-K) \times 20\% \times D/365$																			
年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬总额 (Y) 的计提公式																			
$R \leq K$	0	$Y=0$																			
$R > K$	10%	$Y=A \times (R-K) \times 10\% \times D/365$																			
9	费用与税收	<p>(二) 税收</p> <p>本集合计划运营过程中发生的应税行为（含增值税）须按相关规定缴纳的，该税款由集合计划委托资产承担，由管理人从集合计划委托资产中提取并根据相关法律法规支付。如法律法规对上述税收事宜另有具体规定的，从其规定。</p>	<p>(二) 税收</p> <p>本集合计划运营过程中发生的应税行为（含增值税）须按相关规定缴纳的，该税款由集合计划受托资产承担，由管理人从集合计划受托资产中提取并根据相关法律法规支付。如法律法规对上述税收事宜另有具体规定的，从其规定。</p>																		
10	信息披露与报告	(一) 定期报告	(一) 定期报告																		

		<p>1、集合计划单位净值报告</p> <p>本集合计划成立后，委托资产的估值日为成立后的每个工作日，即上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。管理人将于估值日的第二个交易日披露上一交易日经托管人复核的集合计划单位净值，如遇特殊情况，管理人可以延迟披露，但须保证每周至少披露一次集合计划单位净值。</p> <p>3、年度审计报告</p> <p>管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，审计机构应当对本集合计划会计核算及净值计算等出具意见。管理人应在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给投资者和托管人。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人不编制集合计划当期的年度审计报告。</p>	<p>1、集合计划单位净值报告</p> <p>本集合计划成立后，受托资产的估值日为成立后的每个工作日，即上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。管理人将于估值日的第二个交易日披露上一交易日经托管人复核的集合计划单位净值，如遇特殊情况，管理人可以延迟披露，但须保证每周至少披露一次集合计划单位净值。</p> <p>3、年度审计报告</p> <p>管理人应当聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，审计机构应当对本集合计划会计核算及净值计算等出具意见。管理人应在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给投资者和托管人。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人不编制集合计划当期的年度审计报告。</p>
11	信息披露与报告	<p>(二) 临时报告</p> <p>8、发生资产管理合同约定的关联交易的事项；</p> <p>(三) 托管人履职报告（以下称“托管报告”）</p> <p>1. 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，由管理人根据资产管理合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。</p> <p>3. 管理人应当在每年度结束后两个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核</p>	<p>(二) 临时报告</p> <p>8、发生资产管理合同约定的重大关联交易的事项；</p> <p>(三) 托管人履职报告（以下称“托管报告”）</p> <p>1. 托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，由管理人根据资产管理合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。</p> <p>3. 管理人应当在每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月</p>

		管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。	内向管理人反馈复核意见。																																								
12	信息披露与报告	<p>(五) 特殊主体参与披露</p> <p>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参与集合计划，管理人应通过季度报告或其他方式向投资者进行披露，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p>	<p>(五) 特殊主体参与披露</p> <p>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参与集合计划，管理人应通过季度报告或其他方式向投资者进行披露，并向中国证监会相关派出机构报告。</p>																																								
13	信息披露与报告	<p>(六) 监管报告</p> <p>表格</p> <p>报送主体：管理人</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>种类</th> <th>事项</th> <th>时间</th> <th>途径</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>报告</td> <td>资管计划成立</td> <td>资产管理计划成立之日起五个工作日内</td> <td>证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构</td> </tr> <tr> <td>报告</td> <td>资管计划变更</td> <td>资产管理合同变更之日起五个工作日内</td> <td>证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构</td> </tr> <tr> <td>报告</td> <td>资管计划终止</td> <td>自资产管理计划终止之日起五个工作日内</td> <td>证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构</td> </tr> <tr> <td>报告</td> <td>资管计划清算结果</td> <td>在资产管理计划清算结</td> <td>证券投资基金业协会、中国证</td> </tr> </tbody> </table>	种类	事项	时间	途径	报告	资管计划成立	资产管理计划成立之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划变更	资产管理合同变更之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划终止	自资产管理计划终止之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划清算结果	在资产管理计划清算结	证券投资基金业协会、中国证	<p>(六) 监管报告</p> <p>表格</p> <p>报送主体：管理人</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>种类</th> <th>事项</th> <th>时间</th> <th>途径</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>报告</td> <td>资管计划成立</td> <td>资产管理计划成立之日起五个工作日内</td> <td>证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构</td> </tr> <tr> <td>报告</td> <td>资管计划变更</td> <td>资产管理合同变更之日起五个工作日内</td> <td>证券投资基金业协会</td> </tr> <tr> <td>报告</td> <td>资管计划终止</td> <td>自资产管理计划终止之日起五个工作日内</td> <td>中国证监会相关派出机构</td> </tr> <tr> <td>报告</td> <td>资管计划清算结果</td> <td>在资产管理计划清算结</td> <td>中国证监会相关派出机构</td> </tr> </tbody> </table>	种类	事项	时间	途径	报告	资管计划成立	资产管理计划成立之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划变更	资产管理合同变更之日起五个工作日内	证券投资基金业协会	报告	资管计划终止	自资产管理计划终止之日起五个工作日内	中国证监会相关派出机构	报告	资管计划清算结果	在资产管理计划清算结	中国证监会相关派出机构
种类	事项	时间	途径																																								
报告	资管计划成立	资产管理计划成立之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构																																								
报告	资管计划变更	资产管理合同变更之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构																																								
报告	资管计划终止	自资产管理计划终止之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构																																								
报告	资管计划清算结果	在资产管理计划清算结	证券投资基金业协会、中国证																																								
种类	事项	时间	途径																																								
报告	资管计划成立	资产管理计划成立之日起五个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构																																								
报告	资管计划变更	资产管理合同变更之日起五个工作日内	证券投资基金业协会																																								
报告	资管计划终止	自资产管理计划终止之日起五个工作日内	中国证监会相关派出机构																																								
报告	资管计划清算结果	在资产管理计划清算结	中国证监会相关派出机构																																								

			束后五个工作日内	监会相关派出机构			束后五个工作日内	
报告	资管计划因流动性受限等原因延期清算		及时	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划因流动性受限等原因延期清算	及时	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
报告	资管计划产品季报		每季度结束之日起一个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划产品季报	每季度结束之日起一个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
报告	资管计划产品年报		每年度结束之日起四个月内披露	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	资管计划产品年报	每年度结束之日起四个月内披露	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
报告	私募资产管理业务季报		每季度结束之日起一个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	私募资产管理业务季报	每季度结束之日起一个月内	中国证监会相关派出机构
报告	私募资产管理业务年报		每年度结束之日起四个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	私募资产管理业务年报	每年度结束之日起四个月内	中国证监会相关派出机构
报告	对私募资产管理业务的内部控制情况进行年度审计		每年度结束之日起四个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	对私募资产管理业务的内部控制情况进行年度审计	每年度结束之日起四个月内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构
报告	重大关联交易		发生之日起10个工作日内	证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构、证券期货交	报告	重大关联交易	及时	中国证监会相关派出机构
					报告	一般关联交易	定期	中国证监会相关派出机构
					报告	高级管理人员、私募资产管理业务部门	自离任之日起三十个工	证券投资基金业协会、中国证监

				易所（如涉及）		负责人以及投资经理离任	工作日内	会相关派出机构
报告	高级管理人员、私募资产管理业务部门负责人以及投资经理离任	自离任之日起三十个工作日内		证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报表	持续募集情况、投资运作情况、资产最终投向等信息	每月 10 日前	证券投资基金业协会
报表	持续募集情况、投资运作情况、资产最终投向等信息	每月 10 日前		证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报表	资管产品数据报送	每月 10 日前	证券投资基金业协会
报表	资管产品数据报送	每月 10 日前		人民银行	报送主体：托管人			
报送主体：托管人				种类	事项	时间	途径	
报告	私募资产管理业务托管年度报告	每年度结束之日起四个月内		证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	私募资产管理业务托管年度报告	每年度结束之日起四个月内	中国证监会相关派出机构
报告	监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的	及时		证券投资基金业协会、中国证监会相关派出机构	报告	监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的	及时	中国证监会相关派出机构

14	投资者的权利和义务	<p>2、投资者的义务</p> <p>(10) 保守商业秘密, 不得泄露集合计划的投资计划、投资意向等; 不得利用集合计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动;</p>	<p>2、投资者的义务</p> <p>(10) 保守商业秘密, 不得泄露集合计划的投资计划、投资意向、投资信息等, 依法依规提供信息的除外;</p>
15	利益冲突及关联交易	<p>(二) 存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容及频率</p> <p>3、存在利益冲突时的披露内容和频率</p> <p>(1) 管理人运用受托管理资产从事一般关联交易的, 一般关联交易事后, 管理人将定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人, 并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的, 管理人将及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前取得投资者同意; 重大关联交易事后, 管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人, 并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>通知内容包括但不限于关联交易的关联方、时间、内容、数量、金额、投资者异议的处理方式等。</p>	<p>(二) 存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容及频率</p> <p>3、存在利益冲突时的披露内容和频率</p> <p>(1) 管理人运用受托资产从事一般关联交易的, 一般关联交易事后, 管理人将定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人, 并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>管理人运用受托资产从事重大关联交易的, 管理人将及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前取得投资者同意; 重大关联交易事后, 管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人, 并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>通知内容包括但不限于关联交易的关联方、时间、内容、数量、金额、投资者异议的处理方式等。</p>
16	利益冲突及关联交易	<p>(三) 关联交易</p> <p>1、本合同所称关联方包括:</p> <p>(1) 管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方;</p> <p>(2) 资产管理计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方;</p> <p>(3) 法律法规、其他规范性文件或中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构对关联方另有规定的, 从其规定。</p> <p>2、一般关联交易和重大关联交易</p>	<p>(三) 关联交易</p> <p>1、本合同所称关联方包括: 资产管理计划管理人以及管理人管理的其他账户, 管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方, 管理人的子公司以及子公司管理的账户, 资产管理计划托管人以及托管人的关联方, 其他与资产管理计划管理人或托管人有重大利害关系的机构。管理人的关联方名单将于管理人网站披露, 托管人的关联方名单以本合同约定为准或以托管人公布的年度报告或其他定期报告中披露的关联方名单为准, 投资</p>

	<p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易具体指管理人运用委托财产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销证券，除此以外的其他关联交易为一般关联交易。法律法规、监管及自律机构对关联交易业务规范有其他规定的，从其规定。</p> <p>投资者在此不可撤销地确认，投资者签署本合同即事先同意并授权管理人可将本资产管理计划从事一般关联交易；一般关联交易事后，管理人应定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会派出机构报告，具体以法律法规、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构的规定为准。</p> <p>若从事重大关联交易的，管理人应当通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前通知投资者，事先取得投资者的同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。投资者未在约定时间内提出书面异议的视为同意，投资者提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确；重大关联交易事后，管理人应及时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>3、关联交易的内控机制</p> <p>管理人应当遵循诚信公平、投资者利益优先原则，以公平、合理的市场价格进行关联交易，防范利益冲突，禁止利益输送，保护投资者权益。管理人已制定相应的关联交易管理制度，明确了关联交易的认定标准、交易定价方法、信息披露、内部审批和评估机制等。本集合计划开展关联交易前，将采取一事一批的形式，说明交易的必要性和相关费用定价的公</p>	<p>者可按上述路径进行查阅。</p> <p>2、资产管理计划的关联方与资产管理计划之间的交易视为资产管理计划的关联交易，包括但不限于：</p> <p>(1) 投资关联方发行或承销的证券；</p> <p>(2) 以关联方为交易对手进行银行间市场等场外交易；</p> <p>(3) 通过关联方席位进行交易；</p> <p>(4) 其他导致资产管理计划与关联方之间发生利益转移的活动。</p> <p>3、一般关联交易和重大关联交易</p> <p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易具体指管理人运用财产出资投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销证券，除此以外的其他关联交易为一般关联交易。法律法规、监管及自律机构对关联交易业务规范有其他规定的，从其规定。</p> <p>投资者在此不可撤销地确认，投资者签署本合同即事先同意并授权管理人可将本资产管理计划从事一般关联交易；一般关联交易事后，管理人应定期通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会派出机构报告，具体以法律法规、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构的规定为准。</p> <p>若从事重大关联交易的，管理人应当通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式提前通知投资者，事先取得投资者的同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。投资者未在约定时间内提出书面异议的视为同意，投资者提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确；重大关联交易事后，管理人应及</p>
--	--	--

		<p>允性、合理性。不得以集合计划的资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场。管理人内部制度对关联交易有新的规定的，从其规定。</p>	<p>时通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>4、关联交易的内部控制</p> <p>(1) 管理人应当遵循诚信公平、投资者利益优先原则，以公平、合理的市场价格进行关联交易，防范利益冲突，禁止利益输送，保护投资者权益。管理人已制定相应的关联交易管理制度，明确了关联交易的认定标准、交易定价方法、信息披露、内部审批和评估机制等。本集合计划开展关联交易前，将采取一事一批的形式，说明交易的必要性和相关费用定价的公允性、合理性。不得以集合计划的资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场。管理人内部制度对关联交易有新的规定的，从其规定。</p> <p>(2) 审批程序</p> <p>业务部门在上报业务审批时，应就业务是否存在关联交易进行明确说明。暂时不存在关联交易的无需说明，后期投资过程中如涉及的需另行发起审批。在公司关联交易已审批额度内的投资者认购和标准化资产通过系统直接交易的，仍应按照规定进行信息披露、报送、报告等。</p> <p>交易事项经判断属于重大关联交易的，投资经理及其他业务人员在每次投资执行前应提交投资决策委员会审议，经投资决策委员会审议同意后方可执行，并按公司制度要求报备，根据规定接受审计。</p> <p>所有关联交易在投资前均应当按照法律法规和资管合同的约定履行投资者的提前告知并征得投资者同意方可执行。在资管合同中明确约定已经取得投资者的概括授权同意的一般关联交易除外。</p>
--	--	---	--

17	利益冲突及关联交易	<p>(四) 其他</p> <p>1、除将本资产管理计划资产投资于管理人、托管人、及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券外，管理人不得将本资产管理计划资产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者为私募资产管理产品的，穿透认定该私募资产管理产品的投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于1000万元）且单个委托人投资金额不低于1000万元，并且事先取得投资者同意的除外。</p> <p>2、法律法规、其他规范性文件、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构或管理人内部制度对关联方的范围、一般关联交易和重大关联交易的区分、管理人的内控机制、存在利益冲突的情形、存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容和频率等另有规定或要求的，管理人遵照执行。</p> <p>3、管理人将通过电子邮件、传真、纸质文件或网站公告等方式向投资者披露关联方名单。</p>	<p>(四) 其他</p> <p>1、除将本资产管理计划资产投资于管理人、托管人、及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券外，管理人不得将本资产管理计划资产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者为私募资产管理产品的，穿透认定该私募资产管理产品的投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于1000万元）且单个委托人投资金额不低于1000万元，并且事先取得投资者同意的除外。</p> <p>2、法律法规、其他规范性文件、中国证监会或证券投资基金业协会等监管机构或管理人内部制度对关联方的范围、一般关联交易和重大关联交易的区分、管理人的内控机制、存在利益冲突的情形、存在利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容和频率等另有规定或要求的，管理人遵照执行。</p>
----	-----------	---	---

附件 3：世纪证券全天候进取 1 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书变更明细表

序号	位置	原风险揭示书	变更后风险揭示书
1	“二、风险揭示”	<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>7、本集合计划属于混合类产品。本集合计划直接投资或通过私募基金产品投资于固定收益类资产、权益类资产和商品及</p>	<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>7、本集合计划属于混合类产品。本集合计划直接投资或通过私募基金产品投资于固定收益类资产、权益类资产和期货和衍</p>

		<p>金融衍生品类资产：</p> <p>(1) 当本集合计划投资债券等固定收益类资产时，将面临利率、汇率变化等市场风险带来的债券价格波动风险和信用风险，并进而影响集合计划的收益水平，从而产生风险；</p> <p>(2) 当本集合计划投资股票等权益类资产时，将面临上市公司经营风险以及股票价格波动风险，并进而影响集合计划的收益水平，从而产生风险；</p> <p>(3) 当本集合计划投资商品及金融衍生品时，将面临商品及金融衍生品的高杠杆性、强制平仓等风险，并进而影响集合计划的收益水平，从而产生风险。</p>	<p>生品类资产：</p> <p>(1) 当本集合计划投资债券等固定收益类资产时，将面临利率、汇率变化等市场风险带来的债券价格波动风险和信用风险，并进而影响集合计划的收益水平，从而产生风险；</p> <p>(2) 当本集合计划投资股票等权益类资产时，将面临上市公司经营风险以及股票价格波动风险，并进而影响集合计划的收益水平，从而产生风险；</p> <p>(3) 当本集合计划投资期货和衍生品类资产时，将面临期货和衍生品类资产的高杠杆性、强制平仓等风险，并进而影响集合计划的收益水平，从而产生风险。</p>
2	“二、风险揭示”	<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>12、备案风险</p> <p>本集合计划完成备案前不得开展投资活动，仅可以现金管理为目的投资于高流动性资产，如本集合计划不能在短期内完成备案，则将影响本集合计划的投资收益。如本集合计划未能在成立之日起3个月内取得证券投资基金业协会产品备案成功的确认，管理人单方面选择终止本集合计划的或基金业协会不予备案，投资者不但面临投资收益不及预期的风险，而且面临资金未按照预期回流的再投资风险。</p>	<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>12、备案风险</p> <p>如本集合计划未能在成立之日起3个月内取得证券投资基金业协会产品备案成功的确认，管理人单方面选择终止本集合计划的或基金业协会不予备案，投资者不但面临投资收益不及预期的风险，而且面临资金未按照预期回流的再投资风险。</p>
3	“二、风险揭示”	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>7、投资标的风险</p> <p>4) 金融衍生品（如有）的投资可能以套期保值、套利、投机为目的，具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。</p>	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>7、投资标的风险</p> <p>4) 期货和衍生品类资产（如有）的投资可能以套期保值、套利、投机为目的，具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。</p>

