

首创证券创玺 11 号集合资产管理计划

变更合同条款说明六

我司近期拟对《首创证券创玺 11 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）中的部分条款进行更改，产品条款更改涉及如下：

一、资产管理合同“四、当事人及权利义务”中：

原：

“本集合计划设定为均等份额。除本合同另有约定外，每份份额享有同等权益，承担同等风险。

（一）委托人

1、委托人简况

【个人填写】

姓名：

证件类型：

证件号码：

住所：

通信地址：

邮政编码：

联系电话：

移动电话：

电子信箱：

其他：

【机构填写】

机构名称：

法定代表人：

住所：

通信地址：

邮政编码：

代理人姓名：

身份证号码：

联系电话：

其他：

委托人的详细情况在电子签名合同数据中列示。

2、委托人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，委托人的权利包括但不限于：

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 通过管理人网站查询等方式查询有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；
- (3) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (4) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- (5) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- (6) 监督管理人、托管人履行投资管理和托管义务的情况；
- (7) 因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；
- (8) 投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，投资者可向管理人提出关于撤回同意处理个人信息授权的书面申请。投资者撤回同意，不影响撤回前基于个人同意已进行的个人信息处理活动的效力；
- (9) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和本合同约定的其他权利。

3、委托人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，委托人的义务包括但不限于：

- (1) 委托人应认真阅读并遵守本合同及《说明书》，承诺受托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；
- (2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- (3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应当向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；

(4) 按照规定向管理人或者资产管理计划销售机构提供信息资料以及身份证明文件，配合管理人或者其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

(5) 认真阅读并签署风险揭示书；

(6) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

(7) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；

(8) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

(9) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；

(10) 不得利用资产管理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；

(11) 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；

(12) 不得违规或违反本合同约定转让其所拥有的计划份额；

(13) 本集合计划如采用电子签名合同，委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料。委托人应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

(14) 除非在本合同规定的开放退出期或终止日，不得要求提前终止信托法律关系；

(15) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

(二) 管理人

1、管理人简况

机构名称：首创证券股份有限公司

法定代表人：毕劲松

住所及通信地址：北京市朝阳区安定路5号院13号楼A座11-21层

邮政编码：100029

联系人：董志成

联系电话：010-81152042

2、管理人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

- (1) 按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；
- (2) 按照资产管理合同约定及时、足额获得管理人管理费用和业绩报酬（如有）；
- (3) 按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；
- (4) 自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认可的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；
- (5) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；
- (6) 按照本合同及《说明书》的约定，暂停办理集合计划份额的参与、退出事宜；
- (7) 根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；
- (8) 集合计划资产受到损害时，以管理人名义向有关责任人追究法律责任；
- (9) 法律、行政法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定和本合同约定的其他权利。

3、管理人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

- (1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；
- (2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；
- (3) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向合格投资者非公开募集资金；
- (4) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；
- (5) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；
- (6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；
- (7) 建立健全内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同资产管理计划的受托财产分别管理，分别记账，进行投资；
- (8) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；

(9) 召集资产管理计划份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外；

(10) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合相关要求以及合同的约定；

(11) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；

(12) 对《管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

(13) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

(14) 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；

(15) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(16) 编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告；

(17) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(18) 组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(20) 对于托管人违反法律、行政法规规定或者资产管理合同，对资产管理计划财产以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；

(21) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产以及其他当事人利益的活动；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；

(22) 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；

(23) 建立并保存投资者名单；

(24) 保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(25) 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；

(26) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；

(27)按照有关合同和规定行使资产管理计划财产投资权利而应承担的义务,包括但不限于选择经纪商及投资标的等;

(28)按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定,及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项;

(29)在本集合计划到期或其他原因解散时,与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜;

(30)因管理人违反本合同导致集合计划财产损失或损害委托人合法权益时,应承担赔偿责任;

(31)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。

(32)遵守《个人信息保护法》的要求,遵守保密义务,采取必要的措施保障投资者个人信息的安全,并采取合理措施告知投资者其执行的个人信息保护政策;

(33)管理人向其他个人信息处理者提供其处理的个人信息的,应当向个人告知接收方的名称或者姓名、联系方式、处理目的、处理方式和个人信息的种类,并取得个人的单独同意。受托个人信息处理者为国家机关或者法律、法规授权的具有管理公共事务职能的组织,且法律、行政法规规定应当保密或者不需要告知的情形的,管理人可以不向个人告知且无需经投资者单独同意;

(34)按照我国有关反洗钱法律、行政法规,履行客户身份识别反洗钱义务,识别、核实资产委托人的身份及资产管理计划的受益所有人,并按监管规定保存相关身份信息、资料;在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分,对高风险的客户采取适当的风控措施;在法律允许范围内,配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作,并提供必要客户信息、资料等;履行可疑交易报告义务,并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规,要求资产委托人积极配合完成(包括本合同签订前和履行过程中的)反洗钱调查等必要程序。

(35)采取了适当的措施,确保资产管理计划的委托人、受益所有人等不得为我国公安部等有权部门发布的恐怖活动组织及恐怖活动人员名单,不得为联合国及其他国家(地区)发布且得到我国承认的反洗钱和反恐怖融资名单,或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单。

(36)资产管理计划的投资行为不得违反我国、联合国及其他国家(地区)发布且得到我国承认的有关经济制裁或反洗钱法律法规,或用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途。

(37)法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。

(三) 托管人

1、托管人简况

名称：中信银行股份有限公司郑州分行

住所：郑州市郑东新区商务内环路1号

负责人或授权代表：方萍

联系人：尹志东

通信地址：郑州市郑东新区商务内环路1号

联系电话：0371-55589219

2、托管人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

(1) 按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；

(3) 按照托管协议的约定监督管理人集合计划的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反托管协议之附件《交易监控合规表》对投资范围及投资比例约定的，如指令未生效，有权予以制止。如指令已生效，则按指令划款后，有权要求管理人纠正；

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 托管协议与本合同、说明书约定不一致的，托管人的托管职责以托管协议的约定为准；

(6) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他权利。

3、托管人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 安全保管资产管理计划财产；

(2) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；

(4) 按照资产管理合同的约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(5) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；

(6) 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；

(7) 投资于《管理办法》第三十八条第(五)项规定资产时, 准确、合理界定安全保管资产管理计划财产, 监督管理人投资运作等职责;

(8) 监督管理人的投资运作, 发现管理人的投资或者清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的, 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;

(9) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项;

(10) 对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具意见;

(11) 编制托管年度报告, 报送中国证监会相关派出机构;

(12) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的, 由托管人召集份额持有人大会, 份额持有人大会设立日常机构的除外;

(13) 公平对待所托管的不同财产, 不得从事任何有损资产管理计划财产以及其他当事人利益的活动;

(14) 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;

(15) 保存资产管理计划的会计账册, 妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料, 保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年;

(16) 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;

(17) 定期核对资产管理业务资产情况;

(18) 建立与管理人的对账机制, 复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值和资产管理计划参与、退出价格;

(19) 在集合计划终止时, 与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜;

(20) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时, 及时报告管理人;

(21) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时, 应承担赔偿责任;

(22) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。"

变更为:

"本集合计划设定为均等份额。除本合同另有约定外, 每份份额享有同等权益, 承担同等风险。

(一) 委托人

1、委托人简况

【个人填写】

姓名：

证件类型：

证件号码：

住所：

通信地址：

邮政编码：

联系电话：

移动电话：

电子信箱：

其他：

【机构填写】

机构名称：

法定代表人：

住所：

通信地址：

邮政编码：

代理人姓名：

身份证号码：

联系电话：

其他：

委托人的详细情况在电子签名合同数据中列示。

2、委托人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，委托人的权利包括但不限于：

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 通过管理人网站查询等方式查询有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；
- (3) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (4) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；

(5) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；

(6) 监督管理人、托管人履行投资管理和托管义务的情况；

(7) 因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；

(8) 投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，投资者可向管理人提出关于撤回同意处理个人信息授权的书面申请。投资者撤回同意，不影响撤回前基于个人同意已进行的个人信息处理活动的效力；

(9) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和本合同约定的其他权利。

3、委托人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，委托人的义务包括但不限于：

(1) 委托人应认真阅读并遵守本合同及《说明书》，承诺受托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；

(2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；

(3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应当向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；

(4) 按照规定向管理人或者资产管理计划销售机构提供信息资料以及身份证明文件，配合管理人或者其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

(5) 认真阅读并签署风险揭示书；

(6) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

(7) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；

(8) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

(9) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；

(10) 不得利用资产管理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；

(11) 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；

(12) 不得违规或违反本合同约定转让其所拥有的计划份额；

(13) 本集合计划如采用电子签名合同，委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料。委托人应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

(14) 除非在本合同规定的开放退出期或终止日，不得要求提前终止信托法律关系；

(15) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

(二) 管理人

1、管理人简况

机构名称：首创证券股份有限公司

法定代表人：张涛

住所及通信地址：北京市朝阳区安定路5号院13号楼A座11-21层

邮政编码：100029

联系人：董志成

联系电话：010-81152042

2、管理人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于：

(1) 按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定及时、足额获得管理人管理费用和业绩报酬（如有）；

(3) 按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；

(4) 自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认可的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；

(5) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

(6) 按照本合同及《说明书》的约定，暂停办理集合计划份额的参与、退出事宜；

(7) 根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；

(8) 集合计划资产受到损害时，以管理人名义向有关责任人追究法律责任；

(9) 法律、行政法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定和本合同约定的其他权利。

3、管理人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于：

(1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；

(2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；

(3) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向合格投资者非公开募集资金；

(4) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

(5) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；

(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；

(7) 建立健全内部管理制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同资产管理计划的受托财产分别管理，分别记账，进行投资；

(8) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；

(9) 召集资产管理计划份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外；

(10) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合相关要求以及合同的约定；

(11) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；

(12) 对《管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

(13) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

(14) 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；

(15) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(16) 编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告；

(17) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(18) 组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(19) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(20) 对于托管人违反法律、行政法规规定或者资产管理合同，对资产管理计划财产以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；

(21) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产以及其他当事人利益的活动；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；

(22) 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；

(23) 建立并保存投资者名单；

(24) 保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(25) 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；

(26) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；

(27) 按照有关合同和规定行使资产管理计划财产投资权利而应承担的义务，包括但不限于选择经纪商及投资标的等；

(28) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项；

(29) 在本集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；

(30) 因管理人违反本合同导致集合计划财产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(31) 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。

(32) 遵守《个人信息保护法》的要求，遵守保密义务，采取必要的措施保障投资者个人信息的安全，并采取合理措施告知投资者其执行的个人信息保护政策；

(33) 管理人向其他个人信息处理者提供其处理的个人信息的，应当向个人告知接收方的名称或者姓名、联系方式、处理目的、处理方式和个人信息的种类，并取得个人的单独同意。受托个人信息处理者为国家机关或者法律、法规授权的

具有管理公共事务职能的组织，且法律、行政法规规定应当保密或者不需要告知的情形的，管理人可以不向个人告知且无需经投资者单独同意；

(34) 按照我国有关反洗钱法律、行政法规，履行客户尽职调查反洗钱义务，识别、核实资产委托人的身份及资产管理计划的受益所有人，并按监管规定保存相关身份信息、资料；在客户尽职调查的基础上对客户进行洗钱风险等级划分，对高风险的客户采取适当的风控措施；在法律允许范围内，配合资产托管人开展客户尽职调查特别是受益所有人的识别工作，并提供必要客户信息、资料等；履行可疑交易报告义务，并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规，要求资产委托人积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序。

(35) 采取了适当的措施，确保资产管理计划的委托人、受益所有人等不得为我国公安部等有权部门发布的恐怖活动组织及恐怖活动人员名单，不得为联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的反洗钱和反恐怖融资名单，或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单。

(36) 资产管理计划的投资行为不得违反我国、联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的有关经济制裁或反洗钱法律法规，或用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途。

(37) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。

（三）托管人

1、托管人简况

名称：中信银行股份有限公司郑州分行

住所：郑州市郑东新区商务内环路1号

负责人或授权代表：罗东伟

联系人：尹志东

通信地址：郑州市郑东新区商务内环路1号

联系电话：0371-55589219

2、托管人的权利

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，托管人的权利包括但不限于：

(1) 按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；

(2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；

(3) 按照托管协议的约定监督管理人集合计划的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反托管协议之附件《交易监控合规表》对投资范围及投资比例

约定的，如指令未生效，有权予以制止。如指令已生效，则按指令划款后，有权要求管理人纠正；

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 托管协议与本合同、说明书约定不一致的，托管人的托管职责以托管协议的约定为准；

(6) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他权利。

3、托管人的义务

根据《基金法》《管理办法》《运作规定》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：

(1) 安全保管资产管理计划财产；

(2) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；

(4) 按照资产管理合同的约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

(5) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；

(6) 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；

(7) 投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产，监督管理人投资运作等职责；

(8) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或者清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的，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；

(9) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；

(10) 对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具意见；

(11) 编制托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构；

(12) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的，由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；

(13) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产以及其他当事人利益的活动；

(14) 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；

(15) 保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(16) 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；

(17) 定期核对资产管理业务资产情况；

(18) 建立与管理人的对账机制，复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值和资产管理计划参与、退出价格；

(19) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

(20) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告管理人；

(21) 因违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(22) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。”

二、资产管理合同“五、资产管理计划的基本情况”中：

原：

“（一）资产管理计划名称

首创证券创玺 11 号集合资产管理计划

（二）资产管理计划类型

私募固定收益类集合资产管理计划

（三）资产管理计划运作方式

开放式

（四）资产管理计划目标规模

本集合计划推广期及存续期规模上限为 50 亿元，单个客户首次参与金额不低于 30.00 万元（具体以管理人公告为准）。本集合计划委托人数量为 2 人以上（含）200 人以下（含）。

管理人有权根据实际情况调整推广期的目标规模，并由管理人在管理人指定网站公告。

（五）资产管理计划投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

1、投资目标

本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资，在有效控制投资风险的基础上，力争获取稳健的投资回报。

2、主要投资方向

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等标准化债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。

(1) 固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、二级资本债、次级债、永续债、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和其他金融监督管理部门主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、优先级资产支持票据等投资品种、超过7天的债券逆回购、债券型公募基金。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级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（若无主体评级则取债项评级，若无债项评级则取主体评级）。短期融资券、超短期融资券发行人主体评级不得低于AA，短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于A-1。资产支持证券债项评级不得低于AA。

(2) 现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在1年内（含1年）的国债、到期日在1年内（含1年）的央行票据、到期日在1年内（含1年）的政府债券、不超过7天（含7天）的债券逆回购。

(3) 本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。

3、投资比例

(1) 固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的80%-100%。

(2) 债券逆回购资金余额不超过上一日计划资产净值的100%。

(3) 债券正回购资金余额不超过上一日计划资产净值的100%。

(4) 本集合计划的总资产不得超过该产品净资产的200%。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。

(5) 本集合计划参与债券发行申购时，本集合计划所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，本集合计划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。

(6) 本集合计划投资于单一债券的投资金额不得超过债券存续规模的25%，且投资于单一债券的金额（以市值计）不得超过本集合计划资产净值的25%；本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的25%，也不得超过该资产的25%。除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外，本集合计划管理人管理的全部集合资管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。

本集合计划投资于其他资产管理产品的，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。

本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。

4、产品风险等级

本集合计划的风险等级为 R2, 适合风险承受能力等级匹配且法律法规及监管规定允许投资的个人投资者、机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买资产管理计划的其他投资者。

若销售机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

(六) 资产管理计划的存续期限

本集合计划管理期限为 10 年固定期限。

(七) 资产管理计划份额面值

本集合计划份额的初始募集面值为人民币 1.00 元。

(八) 资产管理计划最低初始募集规模

本集合计划的最低初始募集规模为人民币 1000.00 万元，管理人可以公告提高最低初始募集规模。

(九) 资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构，列明服务机构的名称和在证券投资基金业协会登记的业务登记编码（如有）

本集合资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构均为管理人。

(十) 资产管理计划的销售

1、销售机构

指管理人及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理销售本集合资产管理计划的机构。

2、销售方式

销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大历史业绩和商业贿赂等不正当手段销售集合计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券投资基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详尽了解

本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得通过广播、电视、报刊及其他公共媒体销售本集合计划。

(十一) 资产管理计划的费用

1、认购费/参与费

本集合计划参与费/认购费为 0.00%。

2、托管费

本集合计划托管费为 0.010%/年。

3、管理费

本集合计划管理费为 0.300%/年。

4、退出费

本集合计划除违约退出外，退出费为 0.00%。

5、业绩报酬

本集合计划设置区间式业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准区间为 $[b, a]$ ，其中 $a > b$ 。管理人对年化收益率超过业绩报酬计提基准的收益部分进行分阶计提，当业绩报酬计提基准 $b \leq R <$ 业绩报酬计提基准 a 时，管理人收取超过 b 以上部分收益的 5%作为业绩报酬；当 $R \geq$ 业绩报酬计提基准 a 时，管理人收取超过 a 以上部分收益的 60%作为业绩报酬。

6、其他费用

包括但不限于证券交易费用、审计费、本集合计划成立后的证券账户开户费、信息披露费用、会计师费、律师费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用。

"

变更为：

" (一) 资产管理计划名称

首创证券创玺 11 号集合资产管理计划

(二) 资产管理计划类型

私募固定收益类集合资产管理计划

(三) 资产管理计划运作方式

开放式

(四) 资产管理计划目标规模

本集合计划推广期及存续期规模上限为 50 亿元，单个客户首次参与金额不低于 30.00 万元（具体以管理人公告为准）。本集合计划委托人数量为 2 人以上（含）200 人以下（含）。

管理人有权根据实际情况调整推广期的目标规模，并由管理人在管理人指定网站公告。

(五) 资产管理计划投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

1、投资目标

本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资，在有效控制投资风险的基础上，力争获取稳健的投资回报。

2、主要投资方向

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等标准化债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。

(1) 固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、二级资本债、次级债、永续债、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和其他金融监督管理部门主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、优先级资产支持票据等投资品种、超过7天的债券逆回购、债券型公募基金。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级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（若无主体评级则取债项评级，若无债项评级则取主体评级）。短期融资券、超短期融资券发行人主体评级不得低于AA，短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于A-1。资产支持证券债项评级不得低于AA。

(2) 现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在1年内（含1年）的国债、到期日在1年内（含1年）的央行票据、到期日在1年内（含1年）的政府债券、不超过7天（含7天）的债券逆回购。

(3) 本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。

3、投资比例

(1) 固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的80%-100%。

(2) 债券逆回购资金余额不超过上一日计划资产净值的100%。

(3) 债券正回购资金余额不超过上一日计划资产净值的100%。

(4) 本集合计划的总资产不得超过该产品净资产的200%。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。

(5) 本集合计划参与债券发行申购时，本集合计划所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，本集合计划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。

(6) 本集合计划投资于单一债券的投资金额不得超过债券存续规模的 25%，且投资于单一债券的金额（以市值计）不得超过本集合计划资产净值的 25%；本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的 25%，也不得超过该资产的 25%。除以收购公司为目的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外，本集合计划管理人管理的全部集合资管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。

本集合计划投资于其他资产管理产品的，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。

本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求。本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。

4、产品风险等级

本集合计划的风险等级为 R2，适合风险承受能力等级匹配且法律法规及监管规定允许投资的个人投资者、机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买资产管理计划的其他投资者。

若销售机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

(六) 资产管理计划的存续期限

本集合计划管理期限为 10 年固定期限。

(七) 资产管理计划份额面值

本集合计划份额的初始募集面值为人民币 1.00 元。

(八) 资产管理计划最低初始募集规模

本集合计划的最低初始募集规模为人民币 1000.00 万元，管理人可以公告提高最低初始募集规模。

(九) 资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构，列明服务机构的名称和在证券投资基金业协会登记的业务登记编码（如有）

本集合资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构均为管理人。

(十) 资产管理计划的销售

1、销售机构

指管理人及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理销售本集合资产管理计划的机构。

2、销售方式

销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大历史业绩和商业贿赂等不正当手段销售集合计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券投资基金业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得通过广播、电视、报刊及其他公共媒体销售本集合计划。

（十一）资产管理计划的费用

1、认购费/参与费

本集合计划参与费/认购费为 0.00%。

2、托管费

本集合计划托管费为 0.010%/年。

3、管理费

本集合计划管理费为 0.400%/年。

4、退出费

本集合计划除违约退出外，退出费为 0.00%。

5、业绩报酬

本集合计划设置区间式业绩报酬计提基准，业绩报酬计提基准区间为 $[b, a]$ ，其中 $a > b$ 。管理人对年化收益率超过业绩报酬计提基准的收益部分进行分阶计提，当业绩报酬计提基准 $b \leq R <$ 业绩报酬计提基准 a 时，管理人收取超过 b 以上部分收益的 5%作为业绩报酬；当 $R \geq$ 业绩报酬计提基准 a 时，管理人收取超过 a 以上部分收益的 60%作为业绩报酬。

6、其他费用

包括但不限于证券交易费用、审计费、本集合计划成立后的证券账户开户费、信息披露费用、会计师费、律师费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用。"

三、资产管理合同"八、资产管理计划的参与、退出与转让"中：

原：

"（一）参与和退出场所

本集合计划运作期间的销售机构包括计划管理人和/或计划管理人委托的销售机构。

本集合计划投资者应当按照销售机构提供的方式办理本集合计划份额的申购和赎回。管理人可根据情况变更或增减计划销售机构，并予以通知。

（二）参与和退出的开放日及时间

投资者可在本集合计划开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本集合计划，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。

本集合计划每 12 个月开放一次，若开放日遇法定节假日、休息日等则自动顺延至下一交易日。具体的开放安排以管理人公告为准。

（三）临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

本合同可以在合同变更等符合监管规定的条件下设置临时开放期。临时开放期的触发条件、程序及披露的相关安排详见“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”。

（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认

1、投资者参与本集合计划时，按照参与申请所对应开放日的集合计划份额净值为基准计算集合计划份额。集合计划份额持有人退出本集合计划时，按照退出申请所对应开放日的集合计划份额净值计算退出金额。

2、“未知价”原则，即本集合计划的参与价格、退出价格以开放日收市后计算的集合计划份额净值为基准进行计算。

3、本集合计划参与采用金额申请的方式，退出采用份额申请的方式。

4、本集合计划份额持有人退出集合计划时，管理人按先进先出的原则，按投资者认购、申购本集合计划份额的先后次序进行顺序赎回。

5、参与和退出的程序及确认

（1）参与的程序及确认

①投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

②投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请；

③投资者签署本合同后，方可申请参与本集合计划。参与申请经管理人确认后有效，构成本合同的有效组成部分；

④投资者参与申请确认后，其参与申请不得撤销；

⑤投资者于 T 日提交参与申请后，管理人按照“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对参与总人数实行限量控制。投资者可于 T+2 日后在办理参与的网点查询参与确认情况。

（2）退出的程序及确认

①退出申请的提出

投资者必须根据集合计划销售机构规定的手续，向本集合计划销售机构提出退出的申请。

②退出申请的确认和款项划付

投资者可在 T+2 日（包括该日）之后到销售机构取得 T 日退出申请成交确认单。

③退出款项划付

投资者的退出申请确认后，退出款项将在 T+5 日内从托管账户划出，T+8 个交易日内到账。

本集合计划向投资者支付的受托资金及收益应当返回其参与本集合计划时使用的结算账户或者同名账户。

（五）参与和退出的金额限制

1、参与的金额限制

投资者在存续期开放日购买本集合计划份额的，应符合合格投资者标准，首次参与金额应不低于 30.00 万元人民币（不含参与费）。

2、退出的金额限制

本集合计划份额持有人持有的集合计划资产净值高于 30.00 万元时，可以选择部分退出集合计划份额，退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30.00 万元。本集合计划份额持有人申请退出集合计划份额时，其持有的集合计划资产净值低于 30.00 万元的，必须选择一次性退出全部集合计划份额，没有一次性全部退出持有份额的，管理人将对该集合计划份额持有人所持份额做全部退出处理。

（六）参与和退出的费用

1、参与费用

本集合计划无参与费。

2、退出费用

本集合计划除违约退出外，无退出费。

（七）参与份额与退出金额的计算方式

1、参与份额计算

参与份额=参与金额÷参与日计划单位净值

委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

2、退出金额计算

退出金额=T 日计划单位净值（扣除业绩报酬及分红后）×退出份额

退出金额的计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。

（八）参与资金的利息处理方式

委托人的参与资金在初始募集期产生的利息按照银行同期活期存款利率计算，并将折算为计划份额归委托人所有，其中利息以注册登记机构的记录为准。

（九）报送投资者更新情况

管理人应定期将本集合计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

（十）单个委托人大额退出、巨额退出和连续巨额退出

1、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

（1）单个委托人大额退出的认定

对单个委托人单日退出份额超过上一交易日计划总份额数的 10% 时，即视为单个委托人大额退出。如果大额退出情况触发巨额退出条件，按照巨额退出进行认定和处理。

（2）单个委托人大额退出的申请和处理方式

委托人必须提前 5 个交易日通过销售机构向管理人预约申请；大额退出未预约申请的，管理人有权拒绝其退出申请。

2、巨额退出的认定和处理方式

（1）巨额退出的认定

单个开放日，委托人当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一交易日计划总份额数的 20% 时，即为巨额退出。

（2）巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出：

全额退出：当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额 10% 的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，委托人可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个交易日内办理，并以该交易日的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间 20 个交易日，转入下一个交易日的退出申请不享有优先权。

（3）告知客户的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个交易日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

3、连续巨额退出的认定和处理方式

(1) 连续巨额退出的认定

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

(2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按说明书及本合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个交易日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个交易日，并在管理人指定网站上进行公告。

(十一) 延期支付及延期退出的情形和处理方式

1、因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

2、发生本合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额退出。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有集合计划份额持有人利益的情形时，管理人可暂停接受集合计划份额持有人的赎回申请。

6、当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受本集合计划赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应在当日报中国证监会备案，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形，按本合同的相关条款处理。集合计划份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

(十二) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式

1、暂停参与的情形

如出现如下情形，管理人可以拒绝或暂停委托人的参与申请：

(1) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致本集合计划无法正常运作；

(2) 管理人认为本集合计划出现或可能出现超额募集情况；

(3) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致无法计算当日的集合计划资产净值；

(4) 本集合计划管理人、托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；

(5) 管理人认为继续参与会加大本集合计划投资难度或有损于现有委托人利益；

(6) 销售机构对委托人资金来源表示疑虑，委托人不能提供充分证明的；

(7) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。

发生上述(1)到(5)项情形时，管理人应当通过管理人网站向委托人公告。

2、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理委托人的退出申请：

(1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

(2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；

(3) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有委托人利益时；

(4) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他原因，导致本集合计划的现金出现困难时，管理人可以拒绝或暂停接受本集合计划的退出申请；

(5) 法律、行政法规和中国证监会、基金业协会认定的其他情形。

(十三) 集合计划份额的转让

集合计划存续期间，经管理人同意后投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。

转让后，持有资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过 200 人。受让方首次参与集合计划，应满足合格投资者的条件。转让完成之日，受让人即自动成为本合同当事人，享有合同项下相关权利义务。

(十四) 集合计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定及费用标准办理。

(十五) 集合计划份额的冻结

集合计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。

（十六）自有资金参与集合计划

证券期货经营机构及其子公司可选择以自有资金参与本集合计划，自有资金参与本集合计划的方式可以为认购、申购、强制调增。

1、自有资金参与及退出的条件

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低于6个月。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与或退出前，管理人应当提前5个工作日采用包括但不限于函件、公告等形式告知全体投资者和托管人，并取得其同意后方可参与或退出。投资者如不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出，可以在管理人发布的函件、公告等文件中告知的开放期提出退出申请并退出本集合计划。如公告期届满，投资者未退出本集合计划的，则默认其同意自有资金相关变动。托管人如不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出，可以按管理人发布的函件、公告等文件中告知的方式向管理人提出异议。如公告期届满，托管机构未提出异议，则默认其同意自有资金相关变动。证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出份额或比例以管理人公告为准。

投资者和托管人签署本合同即表明同意证券期货经营机构及其子公司在本集合计划成立时可以以自有资金参与本集合计划。

2、自有资金参与的金额和比例

管理人以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的20%，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不超过本集合计划总份额的50%。为应对本集合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本合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出本集合计划可不受“1、自有资金参与及退出的条件”和“2、自有资金参与的金额和比例”规定的限制，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。

3、客观因素导致自有资金超限的处理原则及措施

因本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限的，证券期货经营机构及其子公司应当在5个工作日内退出。

4、自有资金参与计划信息披露要求

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，应该提前5个工作日通过管理人网站公告并征求托管人及投资者意见（因集合资产管理计划规模变动导致自有资金被动超限的除外）。

5、自有资金责任承担方式

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与，享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。

6、证券期货经营机构及其子公司自有资金的收益分配

收益分配以管理人的公告为准。

上述证券期货经营机构，指管理人及其关联方、关联方的关联方中从事证券期货业务的证券公司、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，若监管部门有其他要求的，以监管部门最新要求为准。

（十七）违约退出的情形及处理

1、违约退出的认定与适用情形

投资者如在本集合计划存续期间的非退出开放日退出计划，为投资者违约，属于违约退出。违约退出条款主要适用于投资者身患重疾、突发意外等急需使用资金的情形。

2、违约退出的处理

（1）违约退出的程序。

投资者违约退出的，需向管理人提供书面违约退出申请文件及其他相关材料。管理人审核同意后，由本计划注册登记机构直接办理或由销售机构代为办理违约退出申请。投资者违约退出的具体程序以及办理违约退出业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同和说明书的前提下，以各销售机构的具体规定为准。投资者违约退出的具体份额以注册登记机构的确认结果为准。

（2）违约退出的价格。

违约退出的价格为管理人审核同意后、注册登记机构或销售机构正式受理违约退出申请当日的计划份额净值。

（3）业绩报酬的计提。

投资者违约退出时，管理人依据本合同的约定计提业绩报酬。

（4）违约退出费用的计算。

投资者违约退出的，应支付净退出金额（扣除管理费、托管费等费用和应计提的业绩报酬后的实际退出金额）的1%作为违约退出费用，违约退出费用全额归入集合计划财产，于违约退出时一次性支付。

违约退出费用的具体计算公式如下：

违约退出费用=（违约退出的份额×违约退出的价格-应计提的业绩报酬）×违约退出费率

违约退出时，投资者实际取得的退出金额的计算公式如下：

实际取得的退出金额=违约退出的份额×违约退出的价格-应计提的业绩报酬-违约退出费用

上述涉及违约退出金额的计算结果均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。

3、违约退出的原则

- (1) 不得违反法律、行政法规和中国证券监督管理委员会的相关规定；
- (2) 不得违反本合同中的相关约定；
- (3) 不得损害其他份额持有人的利益，不得损害剩余的集合计划的资产权益；
- (4) 违约退出业务必须经资产管理计划的持有人申请，经管理人内部审核通过后方可予以办理。管理人经审核后认为违约退出业务可能存在违反法律法规、监管政策以及本合同约定的，有权拒绝办理。

4、本合同关于违约退出条款的约定不代表投资者一定可以在非退出开放日退出本计划，在违约退出违背法律法规、监管政策和本合同约定、损害其他份额持有人的利益、损害剩余集合计划的资产权益以及其他管理人认为不适宜办理违约退出的情形下，管理人均有权拒绝办理投资者的违约退出申请。”

变更为：

”（一）参与和退出场所

本集合计划运作期间的销售机构包括计划管理人和/或计划管理人委托的销售机构。

本集合计划投资者应当按照销售机构提供的方式办理本集合计划份额的申购和赎回。管理人可根据情况变更或增减计划销售机构，并予以通知。

（二）参与和退出的开放日及时间

投资者可在本集合计划开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本集合计划，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。

本集合计划每12个月开放一次，若开放日遇法定节假日、休息日等则自动顺延至下一交易日。具体的开放安排以管理人公告为准。

（三）临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

本合同可以在合同变更等符合监管规定的条件下设置临时开放期。临时开放期的触发条件、程序及披露的相关安排详见“资产管理合同的变更、终止与财产清算”章节。

（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认

1、投资者参与本集合计划时，按照参与申请所对应开放日的集合计划份额净值为基准计算集合计划份额。集合计划份额持有人退出本集合计划时，按照退出申请所对应开放日的集合计划份额净值计算退出金额。

2、“未知价”原则，即本集合计划的参与价格、退出价格以开放日收市后计算的集合计划份额净值为基准进行计算。

3、本集合计划参与采用金额申请的方式，退出采用份额申请的方式。

4、本集合计划份额持有人退出集合计划时，管理人按先进先出的原则，按投资者认购、申购本集合计划份额的先后次序进行顺序赎回。

5、参与和退出的程序及确认

(1) 参与的程序及确认

①投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在规定的交易时间段内办理；

②投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请；

③投资者签署本合同后，方可申请参与本集合计划。参与申请经管理人确认后有效，构成本合同的有效组成部分；

④投资者参与申请确认后，其参与申请不得撤销；

⑤投资者于T日提交参与申请后，管理人按照“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对参与总人数实行限量控制。投资者可于T+2日后在办理参与的网点查询参与确认情况。

(2) 退出的程序及确认

①退出申请的提出

投资者必须根据集合计划销售机构规定的手续，向本集合计划销售机构提出退出的申请。

②退出申请的确认和款项划付

投资者可在T+2日（包括该日）之后到销售机构取得T日退出申请成交确认单。

③退出款项划付

投资者的退出申请确认后，退出款项将在T+5日内从托管账户划出，T+8个交易日到账。

本集合计划向投资者支付的受托资金及收益应当返回其参与本集合计划时使用的结算账户或者同名账户。

(五) 参与和退出的金额限制

1、参与的金額限制

投资者在存续期开放日购买本集合计划份额的，应符合合格投资者标准，首次参与金额应不低于30.00万元人民币（不含参与费）。

2、退出的金額限制

本集合计划份额持有人持有的集合计划资产净值高于30.00万元时，可以选择部分退出集合计划份额，退出后持有的集合计划资产净值不得低于30.00万元。本集合计划份额持有人申请退出集合计划份额时，其持有的集合计划资产净值低

于 30.00 万元的，必须选择一次性退出全部集合计划份额，没有一次性全部退出持有份额的，管理人将对该集合计划份额持有人所持份额做全部退出处理。

（六）参与和退出的费用

1、参与费用

本集合计划无参与费。

2、退出费用

本集合计划除违约退出外，无退出费。

（七）参与份额与退出金额的计算方式

1、参与份额计算

参与份额=参与金额÷参与日计划单位净值

委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

2、退出金额计算

退出金额=T 日计划单位净值（扣除业绩报酬及分红后）×退出份额

退出金额的计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。

（八）参与资金的利息处理方式

委托人的参与资金在初始募集期产生的利息按照银行同期活期存款利率计算，并将折算为计划份额归委托人所有，其中利息以注册登记机构的记录为准。

（九）报送投资者更新情况

管理人应定期将本集合计划投资者变更情况报送证券投资基金业协会。

（十）单个委托人大额退出、巨额退出和连续巨额退出

1、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

（1）单个委托人大额退出的认定

对单个委托人单日退出份额超过上一交易日计划总份额数的 10%时，即视为单个委托人大额退出。如果大额退出情况触发巨额退出条件，按照巨额退出进行认定和处理。

（2）单个委托人大额退出的申请和处理方式

委托人必须提前 5 个交易日通过销售机构向管理人预约申请；大额退出未预约申请的，管理人有权拒绝其退出申请。

2、巨额退出的认定和处理方式

（1）巨额退出的认定

单个开放日，委托人当日累计净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之后的余额）超过上一交易日计划总份额数的 20%时，即为巨额退出。

（2）巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出：

全额退出：当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额 10%的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；未能受理的退出部分，委托人可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个交易日内办理，并以该交易日的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间 20 个交易日，转入下一个交易日的退出申请不享有优先权。

（3）告知客户的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告，并说明有关处理方法。

3、连续巨额退出的认定和处理方式

（1）连续巨额退出的认定

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。

（2）连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按说明书及本合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个交易日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个交易日，并在管理人指定网站上进行公告。

（十一）延期支付及延期退出的情形和处理方式

1、因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。

2、发生本合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项。

3、证券交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日集合计划资产净值。

4、连续两个或两个以上开放日发生巨额退出。

5、发生继续接受赎回申请将损害现有集合计划份额持有人利益的情形时，管理人可暂停接受集合计划份额持有人的赎回申请。

6、当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与托管人协商确认后,管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受本集合计划赎回申请。

7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时,管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付。若出现上述第 4 项所述情形,按本合同的相关条款处理。集合计划份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。

(十二) 拒绝或暂停参与、暂停退出的情形及处理方式

1、暂停参与的情形

如出现如下情形,管理人可以拒绝或暂停委托人的参与申请:

- (1) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致本集合计划无法正常工作;
- (2) 管理人认为本集合计划出现或可能出现超额募集情况;
- (3) 证券交易所在交易时间非正常停市,导致无法计算当日的集合计划资产净值;
- (4) 本集合计划管理人、托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分;
- (5) 管理人认为继续参与会加大本集合计划投资难度或有损于现有委托人利益;
- (6) 销售机构对委托人资金来源表示疑虑,委托人不能提供充分证明的;
- (7) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。

发生上述(1)到(5)项情形时,管理人应当通过管理人网站向委托人公告。

2、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时,管理人可以拒绝或暂停受理委托人的退出申请:

- (1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常工作;
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市,导致当日集合计划资产净值无法计算;
- (3) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有委托人利益时;
- (4) 因市场剧烈波动等原因而出现连续巨额退出,或者其他原因,导致本集合计划的现金出现困难时,管理人可以拒绝或暂停接受本集合计划的退出申请;

(5) 法律、行政法规和中国证监会、基金业协会认定的其他情形。

(十三) 集合计划份额的转让

集合计划存续期间，经管理人同意后投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。

转让后，持有资产管理计划份额的合格投资者合计不得超过 200 人。受让方首次参与集合计划，应满足合格投资者的条件。转让完成之日，受让人即自动成为本合同当事人，享有合同项下相关权利义务。

(十四) 集合计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定及费用标准办理。

(十五) 集合计划份额的冻结

集合计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。

(十六) 自有资金参与集合计划

证券期货经营机构及其子公司可选择以自有资金参与本集合计划，自有资金参与本集合计划的方式可以为认购、申购、强制调增。

1、自有资金参与及退出的条件

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低于 6 个月。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与或退出前，管理人应当提前 5 个工作日采用包括但不限于函件、公告等形式告知全体投资者和托管人，并取得其同意后方可参与或退出。投资者如不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出，可以在管理人发布的函件、公告等文件中告知的开放期提出退出申请并退出本集合计划。如公告期届满，投资者未退出本集合计划的，则默认其同意自有资金相关变动。托管人如不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出，可以按管理人发布的函件、公告等文件中告知的方式向管理人提出异议。如公告期届满，托管机构未提出异议，则默认其同意自有资金相关变动。证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出份额或比例以管理人公告为准。

投资者和托管人签署本合同即表明同意证券期货经营机构及其子公司在本集合计划成立时可以以自有资金参与本集合计划。

2、自有资金参与的金额和比例

管理人以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 20%，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不超过本集合

计划总份额的50%。为应对本集合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本合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出本集合计划可不受“1、自有资金参与及退出的条件”和“2、自有资金参与的金额和比例”规定的限制，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。

3、客观因素导致自有资金超限的处理原则及措施

因本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限的，证券期货经营机构及其子公司应当在5个工作日内退出。

4、自有资金参与计划信息披露要求

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，应该提前5个工作日通过管理人网站公告并征求托管人及投资者意见（因集合资产管理计划规模变动导致自有资金被动超限的除外）。

5、自有资金责任承担方式

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与，享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。

6、证券期货经营机构及其子公司自有资金的收益分配

收益分配以管理人的公告为准。

上述证券期货经营机构，指管理人及其关联方、关联方的关联方中从事证券期货业务的证券公司、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，若监管部门有其他要求的，以监管部门最新要求为准。

（十七）违约退出的情形及处理

1、违约退出的认定与适用情形

投资者如在本集合计划存续期间的非退出开放日退出计划，为投资者违约，属于违约退出。违约退出条款主要适用于投资者身患重疾、突发意外等急需使用资金的情形。

2、违约退出的处理

（1）违约退出的程序。

投资者违约退出的，需向管理人提供书面违约退出申请文件及其他相关材料。管理人审核同意后，由本计划注册登记机构直接办理或由销售机构代为办理违约退出申请。投资者违约退出的具体程序以及办理违约退出业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同和说明书的前提下，以各销售机构的具体规定为准。投资者违约退出的具体份额以注册登记机构的确认结果为准。

（2）违约退出的价格。

违约退出的价格为管理人审核同意后、注册登记机构或销售机构正式受理违约退出申请当日的计划份额净值。

(3) 业绩报酬的计提。

投资者违约退出时，管理人依据本合同的约定计提业绩报酬。

(4) 违约退出费用的计算。

投资者违约退出的，应支付净退出金额(扣除管理费、托管费等费用和应计提的业绩报酬后的实际退出金额)的1%作为违约退出费用，违约退出费用全额归入集合计划财产，于违约退出时一次性支付。

违约退出费用的具体计算公式如下：

违约退出费用=(违约退出的份额×违约退出的价格-应计提的业绩报酬)×违约退出费率

违约退出时，投资者实际取得的退出金额的计算公式如下：

实际取得的退出金额=违约退出的份额×违约退出的价格-应计提的业绩报酬-违约退出费用

上述涉及违约退出金额的计算结果均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。

3、违约退出的原则

- (1) 不得违反法律、行政法规和中国证券监督管理委员会的相关规定；
- (2) 不得违反本合同中的相关约定；
- (3) 不得损害其他份额持有人的利益，不得损害剩余的集合计划的资产权益；
- (4) 违约退出业务必须经资产管理计划的持有人申请，经管理人内部审核通过后方可予以办理。管理人经审核后认为违约退出业务可能存在违反法律法规、监管政策以及本合同约定的，有权拒绝办理。

4、本合同关于违约退出条款的约定不代表投资者一定可以在非退出开放日退出本计划，在违约退出违背法律法规、监管政策和本合同约定、损害其他份额持有人的利益、损害剩余集合计划的资产权益以及其他管理人认为不适宜办理违约退出的情形下，管理人均有权拒绝办理投资者的违约退出申请。”

四、资产管理合同“十五、投资经理的指定与变更”中：

原：

”（一）投资经理的指定

本集合计划投资理由管理人负责指定。本集合计划投资经理为赵伟朋和熊清妍，简介如下：

赵伟朋，首创证券资产管理事业部固定收益投资部投资经理，毕业于中国人民大学，西方经济学硕士，2020年加入首创证券资产管理事业部，历任资产管理部债券交易员、投资经理助理，现任资产管理事业部固定收益投资部投资经理。

致力于研究分析市场的整体走势和风险控制手段,擅长通过合理配置资产组合获得收益。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。

熊清妍,资产管理事业部固定收益投资部投资经理,华中科技大学资产评估硕士。擅长通过利差分析来把握固定收益投资机会,具有丰富的固定收益产品投资交易经验。历任首创证券资产管理事业部固定收益部交易员、投资经理助理,负责资管产品的资产配置、流动性管理,现任资产管理事业部固定收益投资部投资经理。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。

(二) 投资经理的变更

委托人同意,管理人有权根据本集合计划投资运作需求及内部审批流程变更投资经理。投资经理发生以下情形时,管理人应及时变更:

- (1) 投资经理离职的;
- (2) 投资经理被取消投资经理资格的;
- (3) 投资经理因违反法律法规及其他监管规定无法履职的;
- (4) 其他可能导致投资经理无法正常行使投资经理职责的。

管理人应在上述情形发生之日起5个工作日内按照内部管理程序完成投资经理变更并及时公告。”

变更为:

”(一) 投资经理的指定

本集合计划投资经理由管理人负责指定。本集合计划投资经理为赵伟朋和沈梦雨,简介如下:

赵伟朋,首创证券资产管理事业部固定收益投资部投资经理,毕业于中国人民大学,西方经济学硕士,2020年加入首创证券资产管理事业部,历任资产管理部债券交易员、投资经理助理,现任资产管理事业部固定收益投资部投资经理。致力于研究分析市场的整体走势和风险控制手段,擅长通过合理配置资产组合获得收益。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。

沈梦雨,资产管理事业部固定收益投资部投资经理,澳大利亚新南威尔士大学金融学硕士。偏向于通过数据分析调整投资组合来寻找固定收益投资机会,具有丰富的固定收益产品投资交易经验。历任首创证券资产管理事业部固定收益部交易员、投资经理助理,负责资管产品的资产配置、流动性管理,现任资产管理事业部固定收益投资部投资经理。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。

(二) 投资经理的变更

委托人同意，管理人有权根据本集合计划投资运作需求及内部审批流程变更投资经理。投资经理发生以下情形时，管理人应及时变更：

- (1) 投资经理离职的；
- (2) 投资经理被取消投资经理资格的；
- (3) 投资经理因违反法律法规及其他监管规定无法履职的；
- (4) 其他可能导致投资经理无法正常行使投资经理职责的。

管理人应在上述情形发生之日起5个工作日内按照内部管理程序完成投资经理变更并及时公告。”

五、资产管理合同"十六、资产管理计划的财产"中：

原：

"（一）资产管理计划财产的保管与处分

1、本集合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责任，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。

2、本集合计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人和托管人不得将本集合计划财产归入其固有财产。因为管理人投资产生的存放或存管在托管人以外机构的受托财产，由相应的保管机构承担保管职责，管理人应审慎选择保管机构。

3、管理人、托管人因本集合计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入本集合计划财产。

4、管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，本集合计划财产不属于其清算财产。

5、管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对本集合计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

6、本集合计划财产产生的债权不得与不属于本集合计划财产本身的债务相互抵销。非因本集合计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对本集合计划财产强制执行。上述债权人对本集合计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知本集合计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

（二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

1、管理人或托管人按照规定开立集合计划财产的托管资金账户、证券账户等投资所需账户。证券账户、资金账户的名称应当符合基金业协会的有关规定。开立的上述集合计划财产账户与管理人、托管人、销售机构和份额登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。

2、托管人以本集合计划的名义在商业银行开立托管资金账户。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付集合计划收益，

均需通过本集合计划的托管资金账户进行。本托管资金账户仅限于本集合计划使用，仅限于满足开展本集合计划业务的需要。

3、证券账户以及本集合计划投资运作有关的其他账户由管理人与托管人协商后办理。管理人和托管人不得随意假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户。如本集合计划投资运作有关的其他账户是由管理人负责开立的，管理人应保证该账户专款专用，并聘请资金监管机构对该账户的资金划付进行监管。相应的投资回款及收益，也由管理人负责及时原路划回托管资金账户，已聘请资金监管机构的，管理人应配合资金监管机构完成投资回款的划付。管理人开立此类账户后需及时通知托管人。

托管人按照规定开立本集合计划财产的托管账户及其他投资所需账户，管理人应给予必要的配合。”

变更为：

”（一）资产管理计划财产的保管与处分

1、本集合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责任，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。

2、本集合计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人和托管人不得将本集合计划财产归入其固有财产。因为管理人投资产生的存放或存管在托管人以外机构的受托财产，由相应的保管机构承担保管职责，管理人应审慎选择保管机构。

3、管理人、托管人因本集合计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入本集合计划财产。

4、管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，本集合计划财产不属于其清算财产。

5、管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对本集合计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

6、本集合计划财产产生的债权不得与不属于本集合计划财产本身的债务相互抵销。非因本集合计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对本集合计划财产强制执行。上述债权人对本集合计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知本集合计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

（二）资产管理计划财产相关账户的开立和管理

1、管理人或托管人按照规定开立集合计划财产的托管资金账户、证券账户等投资所需账户。证券账户、资金账户的名称应当符合基金业协会的有关规定。开立的上述集合计划财产账户与管理人、托管人、销售机构和份额登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。

2、托管人以本集合计划的名义在商业银行开立托管资金账户。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付集合计划收益，

均需通过本集合计划的托管资金账户进行。本托管资金账户仅限于本集合计划使用，仅限于满足开展本集合计划业务的需要。

3、证券账户以及本集合计划投资运作有关的其他账户由管理人与托管人协商后办理。管理人和托管人不得随意假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户。如本集合计划投资运作有关的其他账户是由管理人负责开立的，管理人应保证该账户专款专用，并聘请资金监管机构对该账户的资金划付进行监管。相应的投资回款及收益，也由管理人负责及时原路划回托管资金账户，已聘请资金监管机构的，管理人应配合资金监管机构完成投资回款的划付。管理人开立此类账户后需及时通知托管人。

托管人按照规定开立本集合计划财产的托管账户及其他投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

4、资产管理人投资期货之前，应与资产托管人、期货公司三方共同就期货开户、清算、估值、交收、费用等事宜另行签署《期货投资托管操作三方备忘录》。”

六、资产管理合同“十七、投资指令的发送、确认和执行”中：

原：

”（一）交易清算授权

1、计划管理人应当事先向计划托管人发出书面授权通知，向计划托管人提供指令的预留印鉴样本和签字样本，并在授权通知上载明计划管理人有权发送指令的人员名单及联系方式。计划管理人应指定至少两名以上的有权发送指令人员。

2、计划管理人向计划托管人发出的授权通知应加盖公章。计划托管人在收到授权通知后以约定方式确认。授权通知在托管人确认的当日生效（如果授权通知载明的生效日期与该日期不一致时，以时间在后的日期为生效日期）。

3、计划管理人和计划托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向有权发送指令人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

（二）投资指令的内容

1、指令包括计划管理人在运作计划资产时，向计划托管人发出的书面划款指令，包括付款指令（含退出、收益分配付款指令）及其他资金划拨指令等。

2、计划管理人发给计划托管人的指令应写明款项事由、支付时间、收款人开户银行、金额、收款人账户名称、账号等要素信息，加盖预留印鉴并由被授权人签章。

（三）投资指令的发送、确认和执行

1、指令的发送

（1）指令需有授权通知确定的预留印鉴和签章，并由有权发送指令人员在指令上签章后，代表计划管理人用电子邮件或传真的方式向托管人发送，传真为备份方式。管理人以上述方式发送指令后需及时与托管人进行电话或其他双方一

致认可的方式确认。因计划管理人未能及时与计划托管人进行指令确认，致使资金未能及时清算所造成的损失，由管理人承担责任。

(2) 计划托管人应指定专人接收计划管理人的指令，并预先通知计划管理人接收人名单和联系方式。

2、指令的确认

(1) 计划托管人收到计划管理人发送的指令后，应立即审慎验证指令的要素是否齐全，并将按照中国银行业协会于2019年3月18日公布并施行的《商业银行资产托管业务指引》中第二十条规定对指令所载签字和印鉴与授权通知进行相符性检查及权限范围核对。如发现问题，应及时通知管理人。经确认的指令，计划管理人不得否认其效力，但如果计划管理人已经撤销或更改对有权签署、发送指令人员的授权，并且通知计划托管人，经托管人确认，则对于此后该类相关人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，计划管理人不承担责任。

(2) 计划托管人可以要求计划管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保计划托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

(3) 计划托管人收到划款指令后，应根据本协议约定，审核计划管理人的划款指令。计划托管人对划款指令以及计划管理人提交的与划款指令相关的材料进行一致性审核。

计划托管人应对下列内容进行审核：

一是划款指令要素、印鉴和签名是否正确完整；

二是划款指令金额与指令附件投资协议等证明文件中约定的投资金额一致；

三是划款指令中的收款账户信息与指令附件投资协议等证明文件中约定的收款账户信息一致（若有）。若指令附件投资协议未约定收款账户信息的，划款指令中的收款户名应与本协议约定的投资方向一致。

(4) 计划管理人向计划托管人出具投资指令时，须提供相关投资证明材料。上述材料应加盖计划管理人印章。

计划管理人应保证以上所提供的划款指令及作为划款依据的文件资料的真实、有效、完整、准确、合法，没有任何重大遗漏或误导；计划托管人对划款指令及文件资料的真实性和有效性不作实质性判断。

3、指令的执行

(1) 计划托管人确认指令有效后，方可执行指令。

(2) 计划托管人在复核后应在规定期限内执行适当的指令，不得延误。指令执行完毕后，计划托管人应通知计划管理人。计划托管人发现计划管理人的指令违反法律法规规定或者集合资产管理合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并向证券公司住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

(3) 相关登记结算机构向计划托管人发送的结算通知视为计划管理人向计划托管人发出的有效指令，计划托管人应予以执行。

4、执行中相关问题的处理方法

(1) 计划管理人下达的指令必须要素齐全，词语准确，计划管理人下达的指令要素不全或语意模糊的，计划托管人有权附注相应的说明后立即将指令退还给计划管理人，要求其重新下达有效的指令。

(2) 计划托管人因故意或重大过失错误执行指令或未及时执行指令，致使本计划资产的利益受到损害，应负赔偿责任。除此之外，托管人对执行管理人的合法指令对计划造成的损失不承担赔偿责任。

(3) 计划管理人在发送指令时，应为计划托管人执行指令留出执行指令时所必需的时间。管理人发送有效指令（包括原指令被撤销、变更后再次发送的新指令）的截止时间为：交易所等场内投资发送指令的截止时间为当天的 15:30；场外、银行间市场及限时发送指令的截止时间为当天的 16:00。对于管理人于上述规定时间以后发送至托管人的指令，托管人应尽力配合，但如未能出款时托管人不承担责任。如管理人要求当天某一时点到账，则交易结算指令及其证明材料最迟需提前 2 个工作小时发送并与托管人进行电话确认。指令传输不及时，未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行，所造成的损失由计划管理人承担。

通过上交所固定收益证券综合电子平台达成的私募债券转让，中国证券登记结算公司上海分公司根据证券交易所发送的转让成交结果办理实时逐笔全额结算（RTGS）。RTGS 的最终交收时点为 T 日的 15:50，为保证 RTGS 交易成功，管理人应于交易 T 日的 15:00 之前，将买入私募债券的指令传至托管人。

通过深圳综合协议平台的公司债、私募债，结算方式为逐笔全额非担保交收，最终交收时点为 T 日 16:00，因此管理人应于 T 日 15:30 之前向托管人发送非担保交收债券的买入指令。指令及其证明材料传输不及时，未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行，所造成的损失由计划管理人承担。

(4) 对非金融衍生品，计划管理人应确保计划的银行存款账户有足够的资金余额，确保计划的证券账户有足够的证券余额；对金融衍生品，通过操作备忘录的形式另行协商。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指令，托管人可不予执行，由此造成的损失，由计划管理人负责赔偿。

(四) 更换投资指令被授权人的程序；

1、计划管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于有权发送指令人员的名单、联系方式的修改，指令上预留印鉴和签章样本的修改等），应当至少提前 1 个工作日通知计划托管人；修改授权通知的文件应为变更后的完整授权，且由计划管理人加盖公章。计划管理人对变更后的完整授权应当以电子邮件的形式发送给计划托管人，同时电话通知计划托管人。计划托管人收到变更后的完整授权通知后向计划管理人修改授权通知后的有权发送指令人员电话确认。计划管理人对授权通知的内容的修改自计划托管人电话确认后生效，计划管理人应在此后三个工作日内将对授权通知修改的文件原件送交计划托管人。新的授权通知生

效之后,原件送达之前,计划托管人按照新的授权通知传真件内容执行有关业务,如果新的授权通知原件与传真件内容不同,以计划托管人收到的传真件为准。

2、计划托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式,应至少提前1个工作日以电话或其他双方一致认可的方式发送计划管理人。计划托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式自计划管理人电话确认后生效。

(五) 投资指令的保管

投资指令由管理人保存20年以上。”

变更为:

”(一) 交易清算授权

1、计划管理人应当事先向计划托管人发出书面授权通知,向计划托管人提供指令的预留印鉴样本和签字样本,并在授权通知上载明计划管理人有权发送指令的人员名单及联系方式。计划管理人应指定至少两名以上的有权发送指令人员。

2、计划管理人向计划托管人发出的授权通知应加盖公章。计划托管人在收到授权通知后以约定方式确认。授权通知在托管人确认的当日生效(如果授权通知载明的生效日期与该日期不一致时,以时间在后的日期为生效日期)。

3、计划管理人和计划托管人对授权通知及其更改负有保密义务,其内容不得向有权发送指令人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

(二) 投资指令的内容

1、指令包括计划管理人在运作计划资产时,向计划托管人发出的书面划款指令,包括付款指令(含退出、收益分配付款指令)及其他资金划拨指令等。

2、计划管理人发给计划托管人的指令应写明款项事由、支付时间、收款人开户银行、金额、收款人账户名称、账号等要素信息,加盖预留印鉴并由被授权人签章。

(三) 投资指令的发送、确认和执行

1、指令的发送

(1) 指令需有授权通知确定的预留印鉴和签章,并由有权发送指令人员在指令上签章后,代表计划管理人用电子邮件或传真的方式向托管人发送,传真为备份方式。管理人以上述方式发送指令后需及时与托管人进行电话或其他双方一致认可的方式确认。因计划管理人未能及时与计划托管人进行指令确认,致使资金未能及时清算所造成的损失,由管理人承担责任。

(2) 计划托管人应指定专人接收计划管理人的指令,并预先通知计划管理人接收人名单和联系方式。

2、指令的确认

(1) 计划托管人在接收指令时,应对指令是否由有权发送指令人员发送、指令的要素是否齐全、指令印鉴与签字是否与预留的授权文件内容相符进行一致

性验证，如发现问题，应及时通知管理人。经确认的指令，计划管理人不得否认其效力，但如果计划管理人已经撤销或更改对有权签署、发送指令人员的授权，并且通知计划托管人，经托管人确认，则对于此后该类相关人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，计划管理人不承担责任。

(2) 计划托管人可以要求计划管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保计划托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

(3) 计划托管人收到划款指令后，应根据本协议约定，审核计划管理人的划款指令。计划托管人对划款指令以及计划管理人提交的与划款指令相关的所有材料进行一致性审核。

计划托管人应对下列内容进行审核：

一是划款指令要素、印鉴和签名是否正确完整；

二是划款指令金额与指令附件投资协议等证明文件中约定的投资金额一致；

三是划款指令中的收款账户信息与指令附件投资协议等证明文件中约定的收款账户信息一致（若有）。若指令附件投资协议未约定收款账户信息的，划款指令中的收款户名应与本协议约定的投资方向一致。

(4) 计划管理人向计划托管人出具投资指令时，须提供相关投资证明材料。上述材料应加盖计划管理人印章。

计划管理人应保证以上所提供的划款指令及作为划款依据的文件资料的真实、有效、完整、准确、合法，没有任何重大遗漏或误导；计划托管人对划款指令及文件资料的真实性和有效性不作实质性判断。

3、指令的执行

(1) 计划托管人确认指令有效后，方可执行指令。

(2) 计划托管人在复核后应在规定期限内执行适当的指令，不得延误。指令执行完毕后，计划托管人应通知计划管理人。计划托管人发现计划管理人的指令违反法律法规规定或者集合资产管理合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并向证券公司住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

(3) 相关登记结算机构向计划托管人发送的结算通知视为计划管理人向计划托管人发出的有效指令，计划托管人应予以执行。

4、执行中相关问题的处理方法

(1) 计划管理人下达的指令必须要素齐全，词语准确，计划管理人下达的指令要素不全或语意模糊的，计划托管人有权附注相应的说明后立即将指令退还给计划管理人，要求其重新下达有效的指令。

(2) 计划托管人因故意或重大过失错误执行指令或未及时执行指令，致使本计划资产的利益受到损害，应负赔偿责任。除此之外，托管人对执行管理人的合法指令对计划造成的损失不承担赔偿责任。

(3) 计划管理人在发送指令时, 应为计划托管人执行指令留出执行指令时所必需的时间。管理人发送有效指令(包括原指令被撤销、变更后再次发送的新指令)的截止时间为: 交易所等场内投资发送指令的截止时间为当天的 15:30; 场外、银行间市场及限时发送指令的截止时间为当天的 16:00。对于管理人于上述规定时间以后发送至托管人的指令, 托管人应尽力配合, 但如未能出款时托管人不承担责任。如管理人要求当天某一时点到账, 则交易结算指令及其证明材料最迟需提前 2 个工作小时发送并与托管人进行电话确认。指令传输不及时, 未能留出足够的执行时间, 致使指令未能及时执行, 所造成的损失由计划管理人承担。

通过上交所固定收益证券综合电子平台达成的私募债券转让, 中国证券登记结算公司上海分公司根据证券交易所发送的转让成交结果办理实时逐笔全额结算(RTGS)。RTGS 的最终交收时点为 T 日的 15:50, 为保证 RTGS 交易成功, 管理人应于交易 T 日的 15:00 之前, 将买入私募债券的指令传至托管人。

通过深圳综合协议平台的公司债、私募债, 结算方式为逐笔全额非担保交收, 最终交收时点为 T 日 16:00, 因此管理人应于 T 日 15:30 之前向托管人发送非担保交收债券的买入指令。指令及其证明材料传输不及时, 未能留出足够的执行时间, 致使指令未能及时执行, 所造成的损失由计划管理人承担。

(4) 对非金融衍生品, 计划管理人应确保计划的银行存款账户有足够的资金余额, 确保计划的证券账户有足够的证券余额; 对金融衍生品, 通过操作备忘录的形式另行协商。对超头寸的指令, 以及超过证券账户证券余额的指令, 托管人可不予执行, 由此造成的损失, 由计划管理人负责赔偿。

(四) 更换投资指令被授权人的程序;

1、计划管理人若对授权通知的内容进行修改(包括但不限于有权发送指令人员的名单、联系方式的修改, 指令上预留印鉴和签章样本的修改等), 应当至少提前 1 个工作日通知计划托管人; 修改授权通知的文件应为变更后的完整授权, 且由计划管理人加盖公章。计划管理人对变更后的完整授权应当以电子邮件的形式发送给计划托管人, 同时电话通知计划托管人。计划托管人收到变更后的完整授权通知后向计划管理人修改授权通知后的有权发送指令人员电话确认。计划管理人对授权通知的内容的修改自计划托管人电话确认后生效, 计划管理人应在此后三个工作日内将对授权通知修改的文件原件送交计划托管人。新的授权通知生效之后, 原件送达之前, 计划托管人按照新的授权通知传真件内容执行有关业务, 如果新的授权通知原件与传真件内容不同, 以计划托管人收到的传真件为准。

2、计划托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式, 应至少提前 1 个工作日以电话或其他双方一致认可的方式发送计划管理人。计划托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式自计划管理人电话确认后生效。

(五) 投资指令的保管

投资指令由管理人保存 20 年以上。”

七、资产管理合同“十八、越权交易的界定”中:

原:

”（一）越权交易的界定

本合同约定的越权交易是指管理人违反本合同的约定而进行的投资交易行为，包括：

- （1）违反本合同约定的投资范围和投资比例限制等进行的投资交易行为；
- （2）法律法规禁止的超买、超卖行为。

管理人应在本合同规定的投资范围和投资限制权限内运用集合计划财产进行投资管理，不得违反本合同关于投资范围和投资限制的约定，超越权限从事投资。

（二）越权交易的处理程序

1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为

托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反托管协议附件《交易监控合规表》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会派出机构。

托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反托管协议附件《交易监控合规表》约定的，应立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会派出机构。

管理人应在接到托管人通知后向托管人主动披露越权交易。托管人有权督促管理人在限期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会派出机构。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

管理人在受托财产投资过程中出现超买或超卖现象，由管理人负责解决，由此给受托财产及托管人托管的其他财产造成的损失及相关交易费用由管理人承担，托管人不承担任何责任。如果因管理人原因发生交易所场内超买行为，必须于发生超买行为日的下一个工作日上午 10:00 之前完成融资，保证完成清算交收。

3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本集合计划资产所有。

（三）托管人对管理人投资运作的监督

1、集合计划托管人对管理人的越权交易行使监督权，具体投资监督事项见托管协议附件《交易监控合规表》。

托管人对管理人进行本集合计划越权交易的监督和检查自本集合计划建账估值之日起开始。

2、投资范围或投资限制变更，管理人应以书面形式通知集合计划托管人，并应与托管人重新协商调整投资监督事项。

3、托管人越权交易监督的真实性、准确性、及时性和完整性受限于管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。

4、对于管理人的任何投资行为、投资策略、投资决定或由于本集合计划产品设计缺陷或越权交易造成的任何损失，由过错方承担责任。

（四）越权交易的例外

以下不属于越权交易情形：

非因管理人主观原因导致本集合计划投资比例不符合本合同约定。”

变更为：

”（一）越权交易的界定

本合同约定的越权交易是指管理人违反本合同的约定而进行的投资交易行为，包括：

- （1）违反本合同约定的投资范围和投资比例限制等进行的投资交易行为；
- （2）法律法规禁止的超买、超卖行为。

管理人应在本合同规定的投资范围和投资限制权限内运用集合计划财产进行投资管理，不得违反本合同关于投资范围和投资限制的约定，超越权限从事投资。

（二）越权交易的处理程序

1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为

托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反托管协议附件《交易监控合规表》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会派出机构。

托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反托管协议附件《交易监控合规表》约定的，应立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会派出机构。

管理人应在接到托管人通知后向托管人主动披露越权交易。托管人有权督促管理人在限期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会派出机构。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

管理人在受托财产投资过程中出现超买或超卖现象，由管理人负责解决，由此给受托财产及托管人托管的其他财产造成的损失及相关交易费用由管理人承担，托管人不承担任何责任。如果因管理人原因发生交易所场内超买行为，必须于发生超买行为日的下一个工作日上午10:00之前完成融资，保证完成清算交收。

3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本集合计划资产所有。

（三）托管人对管理人投资运作的监督

1、集合计划托管人对管理人的越权交易行使监督权，具体投资监督事项见托管协议附件《交易监控合规表》。

托管人对管理人进行本集合计划越权交易的监督和检查自本集合计划建账估值之日起开始。

2、投资范围或投资限制变更，管理人应以书面形式通知集合计划托管人，并应与托管人重新协商调整投资监督事项。

3、托管人越权交易监督的真实性、准确性、及时性和完整性受限于管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。

4、对于管理人的任何投资行为、投资策略、投资决定或由于本集合计划产品设计缺陷或越权交易造成的任何损失，由过错方承担责任。

（四）越权交易的例外

以下不属于越权交易情形：

非因管理人主观原因导致本集合计划投资比例不符合本合同约定。”

八、资产管理合同"二十、资产管理计划的费用与税收"中：

原：

"（一）费用种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、管理人业绩报酬；
- 4、证券交易费用；
- 5、证券账户开户费；
- 6、本集合计划成立后的信息披露费用；
- 7、本集合计划成立后的会计师费和律师费；
- 8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

如本集合计划涉及上述费率调整，管理人将以合同变更的方式征询委托人及托管人的意见。

（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

1、管理人管理费计提和支付

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费率为0.300%/年，管理人可通过公告形式下调管理费率。计算方法如下：

$$H=E \times 0.300\% \div 365$$

H 为每日应计提的管理费；

E 为前一自然日集合计划资产净值。

管理费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次，经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

管理费收入账户：

户 名：首创证券股份有限公司

账 号：11001018500056001700

开户银行：建设银行北京安慧支行

大额支付号：105100004034

2、托管人托管费计提和支付

本集合计划的托管费按前一自然日集合计划的资产净值计提，托管费率为 0.010%/年，计算方法如下：

$$H=E \times 0.010\% \div 365$$

H 为每日应支付的托管费；

E 为前一自然日集合计划资产净值。

托管费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令将上一季度计提的托管费从集合计划资产中一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

托管费收入账户：

户名：待处理托管业务收益款项

账号：7392010127322000101

开户银行：中信银行股份有限公司郑州分行

3、业绩报酬的计提和支付

(1) 管理人核算业绩报酬的原则：

在本集合计划存续过程中，在符合业绩报酬计提条件时，管理人可以在集合计划收益分配日（以管理人公告为准）、投资者退出日和集合计划终止日计提业绩报酬。以上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日）至本次业绩报酬计提日的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的依据，按照分段设置业绩报酬计提基准的方式提取业绩报酬，具体提取方式如下：

$$R=(A-B)/C \times 365/D$$

其中，A 为业绩报酬计提日的累计单位净值； B 为上一个业绩报酬计提日的

累计单位净值； C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的天数。若管理人于某个业绩报酬计提日未实际计提业绩报酬（即业绩报酬为 0），则该日仍然作为管理人下一次业绩报酬计提起始日。

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬计提方法
$R \geq$ 业绩报酬计提基准 a	60%	$H = [R - \text{业绩报酬计提基准 a}] \times 60\% \times C \times F \times D / 365$
业绩报酬计提基准 b $\leq R <$ 业绩报酬计提基准 a	5%	$H = [R - \text{业绩报酬计提基准 b}] \times 5\% \times C \times F \times D / 365$
$R <$ 业绩报酬计提基准 b	0	H=0

注：F 为提取业绩报酬的份额。

本合同中约定的业绩报酬计提基准区间为 [b, a]，其中 $a > b$ 。

注册登记数据由管理人计算，托管人无须复核，按照管理人指令执行。

管理人收取业绩报酬按委托人参与份额计算期间年化收益率并计提业绩报酬。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。管理人将在每个运作周期开始前公布该运作周期的业绩报酬计提基准。

上述管理人业绩报酬计入管理费。

(2) 业绩报酬支付时间

每个自然季度起 10 个工作日内或产品终止时，管理人有权全额提取当期计提的业绩报酬，具体以管理人安排和计算为准。支付时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时，支付日期顺延。

业绩报酬的计算和复核由管理人完成，托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。

本集合计划的业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的标准，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺

4、 证券交易费用

本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，作为交易成本直接扣除。

5、 审计费用

本集合计划的年度审计费用，按管理人与会计师事务所确定的金额，审计费用按年度一次性计提。

6、 其他费用

本集合计划成立后的信息披露费用、会计师费、律师费和银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由管理人本着保护委托人利益的原则，

按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。

（三）不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与本集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。

（四）税收

根据财政部、国家税务总局发布的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）以及《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90号）等文件的相关规定：自2018年1月1日起，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。前述税费由本集合计划受托财产承担，管理人将按相关法规和税务机关的规定计算和缴纳。委托人知悉因本集合计划所适用的税收征管法律法规及执行要求可能会因国家相关税收政策变化或管理人主管税务机关指导意见调整而发生改变。”

变更为：

”（一）费用种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、管理人业绩报酬；
- 4、证券交易费用；
- 5、证券账户开户费；
- 6、本集合计划成立后的信息披露费用；
- 7、本集合计划成立后的会计师费和律师费；
- 8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

如本集合计划涉及上述费率调整，管理人将以合同变更的方式征询委托人及托管人的意见。

（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

1、管理人管理费计提和支付

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费率为0.400%/年，管理人可通过公告形式下调管理费率。计算方法如下：

$$H=E \times 0.400\% \div 365$$

H 为每日应计提的管理费；

E 为前一自然日集合计划资产净值。

管理费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次，经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

管理费收入账户：

户 名：首创证券股份有限公司

账 号：11001018500056001700

开户银行：建设银行北京安慧支行

大额支付号：105100004034

2、托管人托管费计提和支付

本集合计划的托管费按前一自然日集合计划的资产净值计提，托管费率为 0.010%/年，计算方法如下：

$$H=E \times 0.010\% \div 365$$

H 为每日应支付的托管费；

E 为前一自然日集合计划资产净值。

托管费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令将上一季度计提的托管费从集合计划资产中一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

托管费收入账户：

户名：待处理托管业务收益款项

账号：7392010127322000101

开户银行：中信银行股份有限公司郑州分行

3、业绩报酬的计提和支付

(1) 管理人核算业绩报酬的原则：

在本集合计划存续过程中，在符合业绩报酬计提条件时，管理人可以在集合计划收益分配日（以管理人公告为准）、投资者退出日和集合计划终止日计提业绩报酬。以上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日）至本次业绩报酬计提日的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的依据，按照分段设置业绩报酬计提基准的方式提取业绩报酬，具体提取方式如下：

$$R = \frac{A-B}{C} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

其中，A 为业绩报酬计提日的累计单位净值； B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值； C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的天数。若管理人于某个业绩报酬计提日未实际计提业绩报酬（即业绩报酬为 0），则该日仍然作为管理人下一次业绩报酬计提起始日。

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬计提方法
$R \geq$ 业绩报酬计提基准 a	60%	$H = [R - \text{业绩报酬计提基准 a}] \times 60\% \times C \times F \times D/365$
业绩报酬计提基准 b $\leq R <$ 业绩报酬计提基准 a	5%	$H = [R - \text{业绩报酬计提基准 b}] \times 5\% \times C \times F \times D/365$
$R <$ 业绩报酬计提基准 b	0	H=0

注：F 为提取业绩报酬的份额。

本合同中约定的业绩报酬计提基准区间为 [b, a]，其中 $a > b$ 。

注册登记数据由管理人计算，托管人无须复核，按照管理人指令执行。

管理人收取业绩报酬按委托人参与份额计算期间年化收益率并计提业绩报酬。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。管理人将在每个运作周期开始前公布该运作周期的业绩报酬计提基准。

上述管理人业绩报酬计入管理费。

(2) 业绩报酬支付时间

每个自然季度起 10 个工作日内或产品终止时，管理人有权全额提取当期计提的业绩报酬，具体以管理人安排和计算为准。支付时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时，支付日期顺延。

业绩报酬的计算和复核由管理人完成，托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。

本集合计划的业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的标准，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。

4、证券交易费用

本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，作为交易成本直接扣除。

5、审计费用

本集合计划的年度审计费用，按管理人与会计师事务所确定的金额，审计费用按年度一次性计提。

6、其他费用

本集合计划成立后的信息披露费用、会计师费、律师费和银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。

（三）不列入集合计划费用的项目

集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与本集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。

（四）税收

根据财政部、国家税务总局发布的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）以及《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90号）等文件的相关规定：自2018年1月1日起，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。前述税费由本集合计划受托财产承担，管理人将按相关法规和税务机关的规定计算和缴纳。委托人知悉因本集合计划所适用的税收征管法律法规及执行要求可能会因国家相关税收政策变化或管理人主管税务机关指导意见调整而发生改变。”

九、资产管理合同“二十二、信息披露与报告”中：

原：

“本集合计划的信息披露应符合《指导意见》《管理办法》《运作规定》及相关自律规则的规定。如中国证监会、中国基金业协会更新了相关信息披露规则或制定了其他相关规则，则从其规则执行。

（一）定期报告

定期报告包括本集合计划单位净值、本集合计划的资产管理季度（年度）报告和托管人履职报告、年度审计报告。

1、资产管理计划单位净值披露

披露时间：至少每周披露一次经托管人复核的集合计划的单位净值。

披露方式：管理人及销售机构指定网站。

2、资产管理计划季度报告

管理人在每季度向委托人提供一次准确、完整的季度报告，报告包括但不限于以下内容：

（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；
- (7) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (8) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (9) 中国证监会及自律组织规定的其他事项。

资产管理计划季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，上述报告应于每季度截止日后 30 日内通过管理人指定网站通告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的季度报告。

3、资产管理计划年度报告

管理人在每年度向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，年度报告包括但不限于以下内容：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告（如适用）；
- (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、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (10) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划年度报告由管理人编制，托管人复核，由管理人公告，每年度结束之日起四个月内通过管理人网站披露年度报告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的年度报告。

4、托管人履职报告

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，确定托管人履职报告内容并用印后向管理人反馈，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。

管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 10 日内向管理人反馈复核意见。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。

因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

5、年度审计报告

管理人进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本集合计划出具单项审计意见。管理人在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告通过管理人指定网站向委托人提供。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人可不提供审计报告。

管理人应当将审计结果按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。

（二）临时报告

本集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人指定网站、销售机构网站、或其他途径和方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

1、本集合计划运作过程中，投资经理发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

2、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

3、发生巨额退出并延期支付；

4、本集合计划终止和清算；

5、本集合计划存续期满并展期；

6、管理人以自有资金参与和退出；

7、本合同的补充、修改与变更；

8、与本集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

9、负责本集合计划的销售机构发生变更；

10、本集合计划投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券或关联方在承销期内承销的证券；

11、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；

12、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

13、本集合计划分红；

14、资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；

15、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；

16、其他发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件。

（三）其他信息披露事项

如发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起5日内向投资者披露。

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资产管理计划，应向投资者充分披露。”

变更为：

“本集合计划的信息披露应符合《指导意见》《管理办法》《运作规定》及相关自律规则的规定。如中国证监会、中国基金业协会更新了相关信息披露规则或制定了其他相关规则，则从其规则执行。

（一）定期报告

定期报告包括本集合计划单位净值、本集合计划的资产管理季度（年度）报告和托管人履职报告、年度审计报告。

1、资产管理计划单位净值披露

披露时间：至少每周披露一次经托管人复核的集合计划的单位净值。

披露方式：管理人及销售机构指定网站。

2、资产管理计划季度报告

管理人在每季度向委托人提供一次准确、完整的季度报告，报告包括但不限于以下内容：

（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；

- (7) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (8) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (9) 中国证监会及自律组织规定的其他事项。

资产管理计划季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，上述报告应于每季度截止日后 30 日内通过管理人指定网站通告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的季度报告。

3、资产管理计划年度报告

管理人在每年度向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，年度报告包括但不限于以下内容：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告（如适用）；
- (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、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (10) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划年度报告由管理人编制，托管人复核，由管理人公告，每年度结束之日起四个月内通过管理人网站披露年度报告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的年度报告。

4、托管人履职报告

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，确定托管人履职报告内容并用印后向管理人反馈，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。

管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 10 日内向管理人反馈复核意见。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。

因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

5、年度审计报告

管理人进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本集合计划出具单项审计意见。管理人在每年度结束之日起4个月内将审计报告通过管理人指定网站向委托人提供。

管理人应当将审计结果按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。

(二) 临时报告

本集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人指定网站、销售机构网站、或其他途径和方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

- 1、本集合计划运作过程中，投资经理发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；
- 2、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；
- 3、发生巨额退出并延期支付；
- 4、本集合计划终止和清算；
- 5、本集合计划存续期满并展期；
- 6、管理人以自有资金参与和退出；
- 7、本合同的补充、修改与变更；
- 8、与本集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- 9、负责本集合计划的销售机构发生变更；
- 10、本集合计划投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券或关联方在承销期内承销的证券；
- 11、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；
- 12、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- 13、本集合计划分红；
- 14、资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；
- 15、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；

16、其他发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件。

（三）其他信息披露事项

如发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起5日内向投资者披露。

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资产管理计划，应向投资者充分披露。”

十、资产管理合同“二十三、风险揭示”中：

原：

“本集合计划面临包括但不限于以下风险：

（一）特殊风险揭示

1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本集合计划资产管理合同在不违反相关法律法规、不违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》和证券投资基金业协会的合同指引及其他有关规定的情况下，根据本集合计划的具体交易安排及实际情况，在投资者利益最大化的原则下，对合同指引规定的内容做了部分更加具体细化的约定，对合同指引规定以外的内容做了部分约定，且对合同指引部分不完全适用于本资管计划的规定做了必要调整（或有），但相关内容的调整（如有）均以不损害投资者利益为基础。投资者应仔细阅读本合同的各项条款，因此产生的或有风险特提示投资者注意。

2、委托人可能无法参与的风险

由于本集合计划设定了初始募集期及存续期的规模上限，管理人将根据合同的约定对本集合计划的规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

3、资产管理计划委托募集所涉风险

本集合计划可能委托除管理人之外的外部销售机构销售，虽然管理人通过签署相关协议与销售机构进行权利义务的划分，但仍可能存在因外部销售机构自身的违法违规行为、违反合同约定的操作、技术系统故障或操作差错等原因而损害投资者权益的风险，请投资者知晓。

4、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

集合计划成立后，管理人将按照相关法律法规的要求向证券投资基金业协会申请办理计划备案手续，但不能保证一定能办理成功。如本集合计划最终未能在证券投资基金业协会完成备案手续或被不予备案的，本集合计划将按照本合同约定终止清算，由此将影响投资者参与本集合计划的投资目的。

5、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人或委托人疏于及时查看销售机构发布的公告，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本集合计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

6、本集合计划公布收益分配方案后，可能存在本集合计划净值浮动等原因导致收益分配日可供实际分配的资金少于收益分配方案公布的分配金额，届时管理人有权对实际分红金额进行适当调整，则委托人存在实际收到的分红金额与收益分配方案不完全相同的风险。

7、本集合计划有一定的封闭期，封闭期内委托人无法退出集合计划；且本集合计划不在交易所上市，委托人无法通过交易所市场公开交易。

8、使用电子签名合同的风险（如有）

如本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。

9、份额转让时可能面临的风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，在条件允许的情况下，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。在办理转让业务时可能出现的风险至少包括：

（1）操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些原因出现故障，从而影响转让业务办理。

（2）折溢价风险

在份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

10、债券正回购投资风险

组合在进行正回购操作时，可能由于回购利率大于债券投资收益以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行正回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对组合造成损失的可能性也就越大。

11、关联交易的风险

（1）对于重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，逐笔征求意见或公告确认的方式征询投资者，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(2) 对于一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的划分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐笔征询并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(二) 一般风险揭示

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本集合计划财产，但不保证本集合计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本集合计划属于 R2 投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2 及以上的合格投资者。

若销售机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

2、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。市场风险主要包括：

(1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

(2) 经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

(3) 利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

(4) 证券发行公司经营风险

证券发行公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

(5) 购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

（6）再投资风险

再投资风险是债券持有者在持有期得到的利息收入、到期时得到的本息、出售时得到的资本收益等，用它们来再投资所能实现的报酬可能会低于当初购买该债券的收益率的的风险。

3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产以及投资者承担。

4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或者大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

5、信用风险

因债务人、交易对手或持仓金融头寸的发行人未能按时履约或者信用资质恶化，给资产管理计划带来损失的风险。

6、税收风险

资产管理计划所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

7、其他风险

（1）管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；

（2）管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，可能导致受托资产的损失，从而带来风险；

（3）参与失败风险。委托人参与本集合计划，必须足额交款，销售机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到参与申请。如果委托人资金在规定时间内未全额到账，无论到账金额高于、等于或低于本集合计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回委托人账户；

（4）设立失败风险。初始募集期结束时，本集合计划受市场环境等影响，募集规模可能未达到法律、法规规定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险；

管理人的责任承担方式：

①以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

②在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

(5) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

- ①本集合计划终止时，资产无法变现的情形；
- ②相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；
- ③交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；
- ④无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

(6) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；

(7) 操作风险

操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险；

(8) 技术风险

技术风险是指在集合资产管理各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自证券公司、注册登记机构、证券交易所、托管机构等；

(9) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

(10) 投资者风险承受能力与本集合计划风险等级不匹配的风险

委托人应按照管理人或者销售机构的要求，真实、准确、完整的提供信息、资料，包括但不限于委托人身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险承受能力、诚信记录和投资偏好等信息，若委托人提供的信息、资料存在虚假、不完整、不准确情形或者上述信息发生变化定期更新不及时，可能导致委托人风险承受能力等级与本集合计划不匹配，最终委托人可能遭受超出其承受能力或被强制退出的风险。

(11) 反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》《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》《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息，委托人无权知悉，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

(12) 非居民金融账户涉税信息报送安排相关风险

根据《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送相关信息，管理人、销售机构无义

务告知委托人报送安排及报送内容，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

(13) 基于本产品固有风险及管理人的业务或者财产状况的不确定性，存在可能直接导致本金亏损及超过原始本金损失的风险。

(14) 因管理人的业务或者财产状况具有不确定性，存在影响委托人的判断并进而给委托人带来收益甚至本金亏损等风险。

(15) 投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，但投资者撤回同意，存在可能导致管理人无法为投资者提供相关产品或服务的风

(16) 投资者已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险。

(17) 集合计划的持仓债券存在信用等级波动而使得委托人参与集合计划时集合计划所持仓债券信用评级不符合合同约定信用等级的风险，管理人将按本合同约定及时调整持仓债券，但存在因市场状况或其他原因无法及时调整完毕造成集合计划资产损失的风险。

8、特别提示

本集合计划依法设立，投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件，并确保理解相关条款和业务规则，包括但不限于：

(1) 提前终止条款

存续期内，持续五个工作日投资者少于二人，导致本集合计划提前终止。

(2) 强制退出条款

集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于30.00万元。若某笔退出导致该委托人持有的集合计划资产净值低于30.00万元，则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

(3) 电子签名信息保护

如委托人签署电子签名合同进行交易的，应积极采取安全措施，加强账户、密码的保护。

(4) 巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生委托人大量甚至巨额退出集合计划的情形，若出现合同约定的巨额退出，将可能导致集合计划面临流动性风险，增加集合计划所持有证券的变现成本，造成计划资产损失。对于委托人而言，在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。"

变更为：

"本集合计划面临包括但不限于以下风险：

(一) 特殊风险揭示

1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本集合计划资产管理合同在不违反相关法律法规、不违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》和证券投资基金业协会的合同指引及其他有关规定的情况下，根据本集合计划的具体交易安排及实际情况，在投资者利益最大化的原则下，对合同指引规定的内容做了部分更加具体细化的约定，对合同指引规定以外的内容做了部分约定，且对合同指引部分不完全适用于本资管计划的规定做了必要调整（或有），但相关内容的调整（如有）均以不损害投资者利益为基础。投资者应仔细阅读本合同的各项条款，因此产生的或有风险特提示投资者注意。

2、委托人可能无法参与的风险

由于本集合计划设定了初始募集期及存续期的规模上限，管理人将根据合同的约定对本集合计划的规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

3、资产管理计划委托募集所涉风险

本集合计划可能委托除管理人之外的外部销售机构销售，虽然管理人通过签署相关协议与销售机构进行权利义务的划分，但仍可能存在因外部销售机构自身的违法违规行为、违反合同约定的操作、技术系统故障或操作差错等原因而损害投资者权益的风险，请投资者知晓。

4、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

集合计划成立后，管理人将按照相关法律法规的要求向证券投资基金业协会申请办理计划备案手续，但不能保证一定能办理成功。如本集合计划最终未能在证券投资基金业协会完成备案手续或被不予备案的，本集合计划将按照本合同约定终止清算，由此将影响投资者参与本集合计划的投资目的。

5、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人或委托人疏于及时查看销售机构发布的公告，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本集合计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

6、本集合计划公布收益分配方案后，可能存在本集合计划净值浮动等原因导致收益分配日可供实际分配的资金少于收益分配方案公布的分配金额，届时管理人有权对实际分红金额进行适当调整，则委托人存在实际收到的分红金额与收益分配方案不完全相同的风险。

7、本集合计划有一定的封闭期，封闭期内委托人无法退出集合计划；且本集合计划不在交易所上市，委托人无法通过交易所市场公开交易。

8、使用电子签名合同的风险（如有）

如本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。

9、份额转让时可能面临的风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，在条件允许的情况下，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。在办理转让业务时可能出现的风险至少包括：

(1) 操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些原因出现故障，从而影响转让业务办理。

(2) 折溢价风险

在份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

10、债券正回购投资风险

组合在进行正回购操作时，可能由于回购利率大于债券投资收益以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行正回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对组合造成损失的可能性也就越大。

11、关联交易的风险

(1) 对于重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，逐笔征求意见或公告确认的方式征询投资者，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(2) 对于一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的划分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐笔征询并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(二) 一般风险揭示

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本集合计划财产，但不保证本集合计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本集合计划属于 R2 投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2 及以上的合格投资者。

若销售机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

2、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。市场风险主要包括：

(1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

(2) 经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

(3) 利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

(4) 证券发行公司经营风险

证券发行公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

(5) 购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

(6) 再投资风险

再投资风险是债券持有者在持有期得到的利息收入、到期时得到的本息、出售时得到的资本收益等，用它们来再投资所能实现的报酬可能会低于当初购买该债券的收益率的风险。

3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产以及投资者承担。

4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或者大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

5、信用风险

因债务人、交易对手或持仓金融头寸的发行人未能按时履约或者信用资质恶化，给资产管理计划带来损失的风险。

6、税收风险

资产管理计划所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

7、其他风险

(1) 管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；

(2) 管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，可能导致受托资产的损失，从而带来风险；

(3) 参与失败风险。委托人参与本集合计划，必须足额交款，销售机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到参与申请。如果委托人资金在规定时间内未全额到账，无论到账金额高于、等于或低于本集合计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回委托人账户；

(4) 设立失败风险。初始募集期结束时，本集合计划受市场环境等影响，募集规模可能未达到法律、法规规定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险；

管理人的责任承担方式：

① 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

② 在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

(5) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

① 本集合计划终止时，资产无法变现的情形；

② 相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；

③ 交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；

④ 无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

(6) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；

(7) 操作风险

操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险；

(8) 技术风险

技术风险是指在集合资产管理各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自证券公司、注册登记机构、证券交易所、托管机构等；

(9) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

(10) 投资者风险承受能力与本集合计划风险等级不匹配的风险

委托人应按照管理人或者销售机构的要求，真实、准确、完整的提供信息、资料，包括但不限于委托人身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险承受能力、诚信记录和投资偏好等信息，若委托人提供的信息、资料存在虚假、不完整、不准确情形或者上述信息发生变化定期更新不及时，可能导致委托人风险承受能力等级与本集合计划不匹配，最终委托人可能遭受超出其承受能力或被强制退出的风险。

(11) 反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》《金融机构客户尽职调查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》《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息，委托人无权知悉，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

(12) 非居民金融账户涉税信息报送安排相关风险

根据《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送相关信息，管理人、销售机构无义务告知委托人报送安排及报送内容，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

(13) 基于本产品固有风险及管理人的业务或者财产状况的不确定性，存在可能直接导致本金亏损及超过原始本金损失的风险。

(14) 因管理人的业务或者财产状况具有不确定性，存在影响委托人的判断并进而给委托人带来收益甚至本金亏损等风险。

(15) 投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，但投资者撤回同意，存在可能导致管理人无法为投资者提供相关产品或服务的风

(16) 投资者已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险。

(17) 集合计划的持仓债券存在信用等级波动而使得委托人参与集合计划时集合计划所持仓债券信用评级不符合合同约定信用等级的风险，管理人将按本合

同约定及时调整持仓债券,但存在因市场状况或其他原因无法及时调整完毕造成集合计划资产损失的风险。

8、特别提示

本集合计划依法设立,投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件,并确保理解相关条款和业务规则,包括但不限于:

(1) 提前终止条款

存续期内,持续五个工作日投资者少于二人,导致本集合计划提前终止。

(2) 强制退出条款

集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于30.00万元。若某笔退出导致该委托人持有的集合计划资产净值低于30.00万元,则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

(3) 电子签名信息保护

如委托人签署电子签名合同进行交易的,应积极采取安全措施,加强账户、密码的保护。

(4) 巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生委托人大量甚至巨额退出集合计划的情形,若出现合同约定的巨额退出,将可能导致集合计划面临流动性风险,增加集合计划所持有证券的变现成本,造成计划资产损失。对于委托人而言,在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。

"

十一、资产管理合同"二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算"中:

原:

"

(一) 合同的变更

1、全体投资者、管理人和托管人协商一致后,可以对本集合计划合同内容进行变更,本集合计划另有约定的除外。管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的,应在征询意见发出后的下一开放日或管理人设置的合同变更临时开放期内提出退出本资产管理计划的申请;委托人未在规定时间内回复意见的,视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更的,管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排:委托人不同意变更的,管理人保障其退出资产管理计划的权利;对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本资产管理计划的委托人,管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理。合同变更生效日以管理人公告为准。临时开放期内,本资产管理计划不接受任何参与申请。

委托人同意，无论其是否同意合同变更或提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

需要变更合同的情形包括但不限于以下情形：

(1) 管理人因被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等原因不能履行管理人职责，资产管理计划由其他管理人承接。

(2) 托管人因被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等原因不能履行托管人职责，资产管理计划由其他托管人承接。

2、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、基金业协会、证券业协会等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人指定网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本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指定网站公告时生效。委托人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。临时开放期内，本集合计划不接受任何参与申请。

3、本合同变更后，委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。管理人应当自资产管理合同变更之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案。

4、委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。

管理人特别提示，合同变更可能涉及委托人的各项权益调整（包括但不限于权利义务的重大变动，管理费、托管费、业绩报酬的提高或降低等），委托人应实时关注管理人网站（www.sczq.com.cn）公告；委托人同意，管理人通过网站公告的方式视为已合理征询委托人的意见，无论其是否同意合同变更或提出退出申请，管理人在与托管人达成一致意见并通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见后，按照上述程序变更本合同属于委托人认可的行为。

（二）资产管理计划的展期

1、展期的条件

(1) 在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反《集合资产管理合同》《说明书》的约定；

(2) 展期没有损害委托人利益的情形；

(3) 托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；

(4) 满足本集合计划成立条件；

(5) 中国证监会规定的其他条件。

2、展期的安排

(1) 通知展期的时间

在本集合计划到期前 7 个月。

(2) 通知展期的方式

管理人拟定展期方案，经托管人确定后，管理人将通过管理人网站、邮件或者短信等方式通知委托人。

(3) 委托人回复的方式

委托人应当在展期方案发出后的 5 个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确意见。

3、委托人不同意展期的处理办法

若委托人明确表示不同意展期，委托人有权在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续。若不同意展期的委托人未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续，管理人将对此类委托人进行强制退出。委托人回复意见不明确或不回复意见的，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。

4、展期的实现

如果同意本集合计划展期的委托人户数不少于 2 户，则存续期将依法展期；如果同意本集合计划展期的各委托人户数低于 2 户则集合计划到期终止，将按照本合同及相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。展期后，应符合本集合计划的成立条件。

(三) 有下列情形之一的，集合计划应当终止

- 1、本集合计划存续期届满且不展期；
- 2、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；
- 3、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；
- 4、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；
- 5、管理人认为必要时可终止本集合计划；
- 6、本集合计划存续期间，持续五个工作日投资者少于二人；
- 7、不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；
- 8、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- 9、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内应按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送，前述第 8 项约定的情形除外。

（四）资产管理计划的清算

自集合计划终止之日起5个工作日内开始组织清算资产管理计划资产，以及财产清算的有关事项：

1、成立资产管理计划清算小组

（1）本集合计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）本集合计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。管理人负责资产管理计划财产的清算、估价、变现和分配，托管人负责资产管理计划财产的保管，执行管理人分配指令划付资金。

清算过程中的有关重大事项应当及时公布。

2、资产管理计划清算程序

（1）资产管理计划终止日后5个工作日内启动清算程序，并由集合计划清算小组将终止事项向委托人披露；

- （2）集合计划清算小组统一接管集合计划资产；
- （3）集合计划清算小组对集合计划资产进行清理和确认；
- （4）集合计划清算小组对集合计划资产进行估价；
- （5）集合计划清算小组对集合计划资产进行变现；
- （6）集合计划清算小组出具集合计划清算报告；
- （7）集合计划清算小组披露集合计划清算报告；
- （8）清算报告披露后5个工作日内进行集合计划剩余资产的分配；
- （9）集合计划清算小组注销集合计划相关账户。

3、资产管理计划清算费用

集合计划清算小组在进行清算过程中发生的所有合理费用（如：清算审计费用等），清算费用由集合计划清算小组优先从集合计划财产中支付。

4、资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

依据本集合计划财产清算的分配方案，将清算后的全部剩余资产扣除清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按本集合计划份额持有人持有的份额比例进行分配。

5、资产管理计划延期清算处理方式

资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。

6、资产管理计划财产清算报告的告知安排

清算过程中的有关重大事项须及时公告；资产管理计划财产清算报告经会计师事务所审计并报中国证券投资基金业协会备案并公告。资产管理计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证券投资基金业协会备案后5个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告。

7、资产管理计划财产相关账户的注销

资产管理计划财产清算完毕后，托管人及管理人应按照交易所、银行的有关规定注销托管资金专门账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。

8、资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存20年以上。

9、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给委托人。监管政策允许的情况下，管理人也可以将未变现资产按照委托人持有份额的比例分配给委托人，具体事宜以管理人公告为准。”

变更为：

”（一）合同的变更

1、全体投资者、管理人和托管人协商一致后，可以对本集合计划合同内容进行变更，本集合计划另有约定的除外。管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的下一开放日或管理人设置的合同变更临时开放期内提出退出本资产管理计划的申请；委托人未在规定时间内回复意见的，视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：委托人不同意变更的，管理人保障其退出资产管理计划的权利；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本资产管理计划的委托人，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理。合同变更生效日以管理人公告为准。临时开放期内，本资产管理计划不接受任何参与申请。

委托人同意，无论其是否同意合同变更或提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。

需要变更合同的情形包括但不限于以下情形：

（1）管理人因被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等原因不能履行管理人职责，资产管理计划由其他管理人承接。

（2）托管人因被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等原因不能履行托管人职责，资产管理计划由其他托管人承接。

2、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、基金业协会、证券业协会等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人指定网站公

告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本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指定网站公告时生效。委托人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。临时开放期内，本集合计划不接受任何参与申请。

3、本合同变更后，委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。管理人应当自资产管理合同变更之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案。

4、委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。

管理人特别提示，合同变更可能涉及委托人的各项权益调整（包括但不限于权利义务的重大变动，管理费、托管费、业绩报酬的提高或降低等），委托人应实时关注管理人网站（www.sczq.com.cn）公告；委托人同意，管理人通过网站公告的方式视为已合理征询委托人的意见，无论其是否同意合同变更或提出退出申请；管理人在与托管人达成一致意见并通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见后，按照上述程序变更本合同属于委托人认可的行为。

（二）资产管理计划的展期

1、展期的条件

（1）在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反《集合资产管理合同》《说明书》的约定；

（2）展期没有损害委托人利益的情形；

（3）托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；

（4）满足本集合计划成立条件；

（5）中国证监会规定的其他条件。

2、展期的安排

（1）通知展期的时间

在本集合计划到期前7个月。

（2）通知展期的方式

管理人拟定展期方案，经托管人确定后，管理人将通过管理人网站、邮件或者短信等方式通知委托人。

（3）委托人回复的方式

委托人应当在展期方案发出后的5个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确意见。

3、委托人不同意展期的处理办法

若委托人明确表示不同意展期，委托人有权在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续。若不同意展期的委托人未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理退出手续，管理人将对此类委托人进行强制退出。委托人回复意见不明确或不回复意见的，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。

4、展期的实现

如果同意本集合计划展期的委托人户数不少于2户，则存续期将依法展期；如果同意本集合计划展期的各委托人户数低于2户则集合计划到期终止，将按照本合同及相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。展期后，应符合本集合计划的成立条件。

（三）有下列情形之一的，集合计划应当终止

- 1、本集合计划存续期届满且不展期；
- 2、经全体投资者、管理人和托管人协商一致决定终止的；
- 3、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；
- 4、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；
- 5、管理人认为必要时可终止本集合计划；
- 6、本集合计划存续期间，持续五个工作日投资者少于二人；
- 7、不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；
- 8、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- 9、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内应按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送，前述第8项约定的情形除外。

（四）资产管理计划的清算

自集合计划终止之日起5个工作日内开始组织清算资产管理计划资产，以及财产清算的有关事项：

1、成立资产管理计划清算小组

（1）本集合计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）本集合计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。管理人负责资产管理计划财产的清算、估价、变现和分配，托管人负责资产管理计划财产的保管，执行管理人分配指令划付资金。

清算过程中的有关重大事项应当及时公布。

2、资产管理计划清算程序

(1) 资产管理计划终止日后 5 个工作日内启动清算程序，并由集合计划清算小组将终止事项向委托人披露；

- (2) 集合计划清算小组统一接管集合计划资产；
- (3) 集合计划清算小组对集合计划资产进行清理和确认；
- (4) 集合计划清算小组对集合计划资产进行估价；
- (5) 集合计划清算小组对集合计划资产进行变现；
- (6) 集合计划清算小组出具集合计划清算报告；
- (7) 集合计划清算小组披露集合计划清算报告；
- (8) 集合计划清算小组进行集合计划剩余资产的分配；
- (9) 集合计划清算小组注销集合计划相关账户。

3、资产管理计划清算费用

集合计划清算小组在进行清算过程中发生的所有合理费用（如：清算审计费用等），清算费用由集合计划清算小组优先从集合计划财产中支付。

4、资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

依据本集合计划财产清算的分配方案，将清算后的全部剩余资产扣除清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按本集合计划份额持有人持有的份额比例进行分配。

5、资产管理计划延期清算处理方式

资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。

6、资产管理计划财产清算报告的告知安排

清算过程中的有关重大事项须及时公告。清算小组在本集合计划终止后编制资产管理计划财产清算报告，资产管理计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证券投资基金业协会备案后 5 个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告。除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的，上述报告不再另行审计。

7、资产管理计划财产相关账户的注销

资产管理计划财产清算完毕后，托管人及管理人应按照交易所、银行的有关规定注销托管资金专门账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。

8、资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

9、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给委托人。监管政策允许的情况下，管理人也可以将未变现资产按照委托人持有份额的比例分配给委托人，具体事宜以管理人公告为准。”

十二、资产管理合同“附件风险揭示书”中：

原：

“附件 1：风险揭示书

首创证券创玺 11 号

集合资产管理计划

风险揭示书

尊敬的客户：

投资有风险。当您/贵机构参与资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在作出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同等文件，充分认识资产管理计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。

本计划属于 R2 风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2 及以上的合格投资者。根据有关法律法规，首创证券股份有限公司及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

一、管理人声明与承诺

（一）管理人向投资者声明，中国证券投资基金业协会（以下简称“协会”）办理资产管理计划备案不作为对资产管理计划财产安全和投资者收益的保证，也不表明协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。

（二）管理人保证在投资者签署资产管理合同前已（或已委托销售机构）向投资者揭示了相关风险；已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和风险承受能力。

（三）管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用资产管理计划财产，不保证资产管理计划财产一定盈利，也不保证最低收益。

二、风险揭示

本集合计划面临包括但不限于以下风险：

（一）特殊风险揭示

1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本集合计划资产管理合同在不违反相关法律法规、不违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》和证券投资基金业协会的基金合同指引及其他有关规定的情况下，根据本集合计划的具体交易安排及实际情况，在投资者利益最大化的原则下，对合同指引规定的内容做了部分更加具体细化的约定，对合同指引规定以外的内容做了部分约定，且对合同指引部分不完全适用于本资管计划的规定做了必要调整（或有），但相关内容的调整（如有）均以不损害投资者利益为基础。投资者应仔细阅读本合同的各项条款，因此产生的或有风险特提示投资者注意。

2、委托人可能无法参与的风险

由于本集合计划设定了初始募集期及存续期的规模上限，管理人将根据合同的约定对本集合计划的规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

3、资产管理计划委托募集所涉风险

本集合计划可能委托除管理人之外的外部销售机构销售，虽然管理人通过签署相关协议与销售机构进行权利义务的划分，但仍可能存在因外部销售机构自身的违法违规行为、违反合同约定的操作、技术系统故障或操作差错等原因而损害投资者权益的风险，请投资者知晓。

4、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

集合计划成立后，管理人将按照相关法律法规的要求向证券投资基金业协会申请办理计划备案手续，但不能保证一定能办理成功。如本集合计划最终未能在证券投资基金业协会完成备案手续或被不予备案的，本集合计划将按照本合同约定终止清算，由此将影响投资者参与本集合计划的投资目的。

5、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人或委托人疏于及时查看销售机构发布的公告，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本集合计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

6、本集合计划公布收益分配方案后，可能存在本集合计划净值浮动等原因导致收益分配日可供实际分配的资金少于收益分配方案公布的分配金额，届时管理人有权对实际分红金额进行适当调整，则委托人存在实际收到的分红金额与收益分配方案不完全相同的风险。

7、本集合计划有一定的封闭期，封闭期内委托人无法退出集合计划；且本集合计划不在交易所上市，委托人无法通过交易所市场公开交易。

8、使用电子签名合同的风险（如有）

如本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。

9、份额转让时可能面临的风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，在条件允许的情况下，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。在办理转让业务时可能出现的风险至少包括：

(1) 操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些原因出现故障，从而影响转让业务办理。

(2) 折溢价风险

在份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

10、债券正回购投资风险

组合在进行正回购操作时，可能由于回购利率大于债券投资收益以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行正回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对组合造成损失的可能性也就越大。

11、关联交易的风险

(1) 对于重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，逐笔征求意见或公告确认的方式征询投资者，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(2) 对于一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的划分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐笔征询并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(二) 一般风险揭示

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本集合计划财产，但不保证本集合计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本集合计划属于 R2 投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2 及以上的合格投资者。

若销售机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

2、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。市场风险主要包括：

(1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

(2) 经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

(3) 利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

(4) 证券发行公司经营风险

证券发行公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

(5) 购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

(6) 再投资风险

再投资风险是债券持有者在持有期得到的利息收入、到期时得到的本息、出售时得到的资本收益等，用它们来再投资所能实现的报酬可能会低于当初购买该债券的收益率的风险。

3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产以及投资者承担。

4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或者大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

5、信用风险

因债务人、交易对手或持仓金融头寸的发行人未能按时履约或者信用资质恶化，给资产管理计划带来损失的风险。

6、税收风险

资产管理计划所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

7、其他风险

(1) 管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；

(2) 管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，可能导致受托资产的损失，从而带来风险；

(3) 参与失败风险。委托人参与本集合计划，必须足额交款，销售机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到参与申请。如果委托人资金在规定时间内未全额到账，无论到账金额高于、等于或低于本集合计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回委托人账户；

(4) 设立失败风险。初始募集期结束时，本集合计划受市场环境等影响，募集规模可能未达到法律、法规规定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险；

管理人的责任承担方式：

① 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

② 在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

(5) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

① 本集合计划终止时，资产无法变现的情形；

② 相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；

③ 交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；

④ 无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

(6) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；

(7) 操作风险

操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险；

(8) 技术风险

技术风险是指在集合资产管理各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自证券公司、注册登记机构、证券交易所、托管机构等；

(9) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

(10) 投资者风险承受能力与本集合计划风险等级不匹配的风险

委托人应按照管理人或者销售机构的要求，真实、准确、完整的提供信息、资料，包括但不限于委托人身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险承受能力、诚信记录和投资偏好等信息，若委托人提供的信息、资料存在虚假、不完整、不准确情形或者上述信息发生变化定期更新不及时，可能导致委托人风险承受能力等级与本集合计划不匹配，最终委托人可能遭受超出其承受能力或被强制退出的风险。

(11) 反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》《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》《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息，委托人无权知悉，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

(12) 非居民金融账户涉税信息报送安排相关风险

根据《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送相关信息，管理人、销售机构无义务告知委托人报送安排及报送内容，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

(13) 基于本产品固有风险及管理人的业务或者财产状况的不确定性，存在可能直接导致本金亏损及超过原始本金损失的风险。

(14) 因管理人的业务或者财产状况具有不确定性，存在影响委托人的判断并进而给委托人带来收益甚至本金亏损等风险。

(15) 投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，但投资者撤回同意，存在可能导致管理人无法为投资者提供相关产品或服务的风险。

(16) 投资者已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险。

(17) 集合计划的持仓债券存在信用等级波动而使得委托人参与集合计划时集合计划所持仓债券信用评级不符合合同约定信用等级的风险，管理人将按本合

同约定及时调整持仓债券,但存在因市场状况或其他原因无法及时调整完毕造成集合计划资产损失的风险。

8、特别提示

本集合计划依法设立,投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件,并确保理解相关条款和业务规则,包括但不限于:

(1) 提前终止条款

存续期内,持续五个工作日投资者少于二人,导致本集合计划提前终止。

(2) 强制退出条款

集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于30.00万元。若某笔退出导致该委托人持有的集合计划资产净值低于30.00万元,则管理人对该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

(3) 电子签名信息保护

如委托人签署电子签名合同进行交易的,应积极采取安全措施,加强账户、密码的保护。

(4) 巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生委托人大量甚至巨额退出集合计划的情形,若出现合同约定的巨额退出,将可能导致集合计划面临流动性风险,增加集合计划所持有证券的变现成本,造成计划资产损失。对于委托人而言,在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。

三、投资者声明与承诺

作为本计划的投资者,本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力,自愿自行承担投资该计划所面临的风险。本人/机构作出以下陈述和声明,并确认(自然人投资者在每段段尾“【 】”内签名,机构投资者在本页、尾页盖章,加盖骑缝章)其内容的真实和正确:

1. 本人/机构已仔细阅读资产管理业务相关法律文件和其他文件,充分理解相关权利、义务、本计划运作方式及风险收益特征,愿意承担由上述风险引致的全部后果。【 】

2. 本人/机构知晓,管理人、销售机构、托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产的收益状况作出任何承诺或担保。【 】

3. 本人/机构符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关合格投资者的要求,并已按照管理人或销售机构的要求提供相关证明文件。【 】

4. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同的所有内容,并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【 】

5. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“当事人及权利义务”章节的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【 】

6. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“资产管理计划的投资”章节的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【 】

7. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“资产管理计划的费用与税收”章节中的所有内容。【 】

8. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“争议的处理”章节中的所有内容。【 】

9. 本人/机构已经配合管理人或其销售机构提供了法律法规规定的信息资料及身份证明文件，以配合上述机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查以及反洗钱等监管规定的工作。

本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效。
【 】

10. 本人/机构知晓，中国证券投资基金业协会为资产管理计划办理备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。【 】

11. 本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构购买（参与）资产管理计划。【 】

12. 本人/机构承诺不以非法拆分转让为目的购买资产管理计划，不会突破合格投资者标准，将资产管理计划份额或其收益权进行非法拆分转让。【 】

13. 本人/机构知悉本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者财产损失的所有因素。【 】

本人承诺已仔细的、完整的阅读上述所有陈述与声明，并在此签字确认：

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

管理人（盖章）：

日期：

销售机构经办人（签字）[集合资产管理计划适用]：

日期："

变更为：

"附件 1：风险揭示书

首创证券创玺 11 号

集合资产管理计划

风险揭示书

尊敬的客户：

投资有风险。当您/贵机构参与资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在作出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同等文件，充分认识资产管理计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。

本计划属于 R2 风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2 及以上的合格投资者。根据有关法律法规，首创证券股份有限公司及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

一、管理人声明与承诺

（一）管理人向投资者声明，中国证券投资基金业协会（以下简称“协会”）办理资产管理计划备案不作为对资产管理计划财产安全和投资者收益的保证，也不表明协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。

（二）管理人保证在投资者签署资产管理合同前已（或已委托销售机构）向投资者揭示了相关风险；已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和风险承受能力。

（三）管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用资产管理计划财产，不保证资产管理计划财产一定盈利，也不保证最低收益。

二、风险揭示

本集合计划面临包括但不限于以下风险：

（一）特殊风险揭示

1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本集合计划资产管理合同在不违反相关法律法规、不违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》和证券投资基金业协会的合同指引及其他有关规定的情况下，根据本集合计划的具体交易安排及实际情况，在投资者利益最大化的原则下，对合同指引规定的内容做了部分更加具体细化的约定，对合同指引规定以外的内容做了部分约定，且对合同指引部分不完全适用于本资管计划的规定做了必要调整（或有），但相关内容的调整（如有）均以不损害投资者利益为基础。投资者应仔细阅读本合同的各项条款，因此产生的或有风险特提示投资者注意。

2、委托人可能无法参与的风险

由于本集合计划设定了初始募集期及存续期的规模上限，管理人将根据合同的约定对本集合计划的规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

3、资产管理计划委托募集所涉风险

本集合计划可能委托除管理人之外的外部销售机构销售，虽然管理人通过签署相关协议与销售机构进行权利义务的划分，但仍可能存在因外部销售机构自身的违法违规行、违反合同约定的操作、技术系统故障或操作差错等原因而损害投资者权益的风险，请投资者知晓。

4、资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

集合计划成立后，管理人将按照相关法律法规的要求向证券投资基金业协会申请办理计划备案手续，但不能保证一定能办理成功。如本集合计划最终未能在证券投资基金业协会完成备案手续或被不予备案的，本集合计划将按照本合同约定终止清算，由此将影响投资者参与本集合计划的投资目的。

5、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人或委托人疏于及时查看销售机构发布的公告，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本集合计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

6、本集合计划公布收益分配方案后，可能存在本集合计划净值浮动等原因导致收益分配日可供实际分配的资金少于收益分配方案公布的分配金额，届时管理人有权对实际分红金额进行适当调整，则委托人存在实际收到的分红金额与收益分配方案不完全相同的风险。

7、本集合计划有一定的封闭期，封闭期内委托人无法退出集合计划；且本集合计划不在交易所上市，委托人无法通过交易所市场公开交易。

8、使用电子签名合同的风险（如有）

如本集合计划资产管理合同采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。

9、份额转让时可能面临的风险

本合同依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，在条件允许的情况下，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。在办理转让业务时可能出现的风险至少包括：

（1）操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些原因出现故障，从而影响转让业务办理。

（2）折溢价风险

在份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

10、债券正回购投资风险

组合在进行正回购操作时，可能由于回购利率大于债券投资收益以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行正回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对组合造成损失的可能性也就越大。

11、关联交易的风险

(1) 对于重大关联交易的特别风险提示：虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，对该等交易安排进行事前内部审查，逐笔征求意见或公告确认的方式征询投资者，但仍可能存在因管理人关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(2) 对于一般关联交易的特别风险提示：虽然管理人设置了重大关联交易与一般关联交易的划分标准，并根据重要性原则采取分层管理，但仍可能因管理人针对一般关联交易在本合同采用事先统一授权同意模式、存在投资者未被逐笔征询并在发生一般关联交易时无法及时退出本计划而引起的风险，在此提示投资者特别注意。

(二) 一般风险揭示

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本集合计划财产，但不保证本集合计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本集合计划属于 R2 投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C2 及以上的合格投资者。

若销售机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售机构评定的风险等级为准。销售机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。

2、市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。市场风险主要包括：

(1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

(2) 经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

(3) 利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

(4) 证券发行公司经营风险

证券发行公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

(5) 购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

(6) 再投资风险

再投资风险是债券持有者在持有期得到的利息收入、到期时得到的本息、出售时得到的资本收益等，用它们来再投资所能实现的报酬可能会低于当初购买该债券的收益率的风险。

3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产以及投资者承担。

4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或者大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

5、信用风险

因债务人、交易对手或持仓金融头寸的发行人未能按时履约或者信用资质恶化，给资产管理计划带来损失的风险。

6、税收风险

资产管理计划所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

7、其他风险

(1) 管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；

(2) 管理人、托管人因丧失业务资格、停业、解散、撤销、破产，可能导致受托资产的损失，从而带来风险；

(3) 参与失败风险。委托人参与本集合计划，必须足额交款，销售机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到参与申请。如果委托人资金在规定时间内未全额到账，无论到账金额高于、等于或低于

本集合计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回委托人账户；

(4) 设立失败风险。初始募集期结束时，本集合计划受市场环境等影响，募集规模可能未达到法律、法规规定的最低设立条件，导致本集合计划不能成立的风险；

管理人的责任承担方式：

①以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

②在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

(5) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

①本集合计划终止时，资产无法变现的情形；

②相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；

③交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；

④无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

(6) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损；

(7) 操作风险

操作风险是指那些由于不合理的内部程序，人为造成的或者是系统性的，由外部事件引发损失的风险；

(8) 技术风险

技术风险是指在集合资产管理各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自证券公司、注册登记机构、证券交易所、托管机构等；

(9) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

(10) 投资者风险承受能力与本集合计划风险等级不匹配的风险

委托人应按照管理人或者销售机构的要求，真实、准确、完整的提供信息、资料，包括但不限于委托人身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险承受能力、诚信记录和投资偏好等信息，若委托人提供的信息、资料存在虚假、不完整、不准确情形或者上述信息发生变化定期更新不及时，可能导致委托人风险承受能力等级与本集合计划不匹配，最终委托人可能遭受超出其承受能力或被强制退出的风险。

(11) 反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》《金融机构客户尽职调查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》《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息，委托人无权知悉，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

(12) 非居民金融账户涉税信息报送安排相关风险

根据《非居民金融账户涉税信息尽职调查管理办法》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送相关信息，管理人、销售机构无义务告知委托人报送安排及报送内容，委托人签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

(13) 基于本产品固有风险及管理人的业务或者财产状况的不确定性，存在可能直接导致本金亏损及超过原始本金损失的风险。

(14) 因管理人的业务或者财产状况具有不确定性，存在影响委托人的判断并进而给委托人带来收益甚至本金亏损等风险。

(15) 投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，但投资者撤回同意，存在可能导致管理人无法为投资者提供相关产品或服务的风

(16) 投资者已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险。

(17) 集合计划的持仓债券存在信用等级波动而使得委托人参与集合计划时集合计划所持仓债券信用评级不符合合同约定信用等级的风险，管理人将按本合同约定及时调整持仓债券，但存在因市场状况或其他原因无法及时调整完毕造成集合计划资产损失的风险。

8、特别提示

本集合计划依法设立，投资者在申请参与本集合计划之前应认真阅读集合资产管理合同及说明书等集合计划文件，并确保理解相关条款和业务规则，包括但不限于：

(1) 提前终止条款

存续期内，持续五个工作日投资者少于二人，导致本集合计划提前终止。

(2) 强制退出条款

集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于30.00万元。若某笔退出导致该委托人持有的集合计划资产净值低于30.00万元，则管理人对

该余额部分作强制退出处理。强制退出会导致委托人的计划份额减少至零。

(3) 电子签名信息保护

如委托人签署电子签名合同进行交易的，应积极采取安全措施，加强账户、密码的保护。

(4) 巨额退出事件风险

在集合计划存续期间可能发生委托人大量甚至巨额退出集合计划的情形，若出现合同约定的巨额退出，将可能导致集合计划面临流动性风险，增加集合计划所持有证券的变现成本，造成计划资产损失。对于委托人而言，在发生巨额退出时可能面临所持有集合计划份额被部分顺延退出或暂停退出的风险。

三、投资者声明与承诺

作为本计划的投资者，本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，自愿自行承担投资该计划所面临的风险。本人/机构作出以下陈述和声明，并确认（自然人投资者在每段段尾“【 】”内签名，机构投资者在本页、尾页盖章，加盖骑缝章）其内容的真实和正确：

1. 本人/机构已仔细阅读资产管理业务相关法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本计划运作方式及风险收益特征，愿意承担由上述风险引致的全部后果。【 】

2. 本人/机构知晓，管理人、销售机构、托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产的收益状况作出任何承诺或担保。【 】

3. 本人/机构符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关合格投资者的要求，并已按照管理人或销售机构的要求提供相关证明文件。【 】

4. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【 】

5. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“当事人及权利义务”章节的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【 】

6. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“资产管理计划的投资”章节的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【 】

7. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“资产管理计划的费用与税收”章节中的所有内容。【 】

8. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“争议的处理”章节中的所有内容。【 】

9. 本人/机构已经配合管理人或其销售机构提供了法律法规规定的信息资料及身份证明文件，以配合上述机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查以及反洗钱等监管规定的工作。

本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效。

【 】

10. 本人/机构知晓，中国证券投资基金业协会为资产管理计划办理备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。【 】

11. 本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构购买（参与）资产管理计划。【 】

12. 本人/机构承诺不以非法拆分转让为目的购买资产管理计划，不会突破合格投资者标准，将资产管理计划份额或其收益权进行非法拆分转让。【 】

13. 本人/机构知悉本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者财产损失的所有因素。【 】

本人承诺已仔细的、完整的阅读上述所有陈述与声明，并在此签字确认：

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

管理人（盖章）：

日期：

销售机构经办人（签字）[集合资产管理计划适用]：

日期： "

若产品合同变更条款涉及到托管协议、风险揭示书和计划说明书，对应一并修改。

首创证券股份有限公司

2026年05月25日