

关于大通星海一号集合资产管理计划 合同变更的公告

尊敬的投资者：

大通星海一号集合资产管理计划（以下简称“星海一号”或“本集合计划”），于2009年6月30日成立，募集规模4.39亿元，截至2014年5月26日规模为1.48亿元。现管理人大通证券股份有限公司（以下简称“管理人”）拟对星海一号合同、说明书及风险揭示书进行变更。根据国家相关法律法规的要求以及星海一号合同和说明书的有关规定，为充分尊重投资者选择权，保护投资者权益，现就合同变更事项公告如下：

1、主要变更条款

- （1）本集合计划将不设固定存续期限。
- （2）投资者参与全部采用电子合同签署方式完成。
- （3）业绩报酬改为分段计提模式，实际提取比例下降。
- （4）具体变更条款见附件。

2、管理人已就合同变更事项征得托管人中国光大银行股份有限公司的同意，并取得托管人的书面回复意见（《关于同意大通星海一号集合资产管理计划合同变更的函》）。

3、投资者的参与和退出

（1）星海一号持有人若同意合同变更内容，则自公告次日起至2014年6月30日交易时间结束的时间段内，须通过原参与网点签署本集合计划的电子合同（原参与网点为大通证券营业部的持有人可通过大通证券网上交易软件自助签署）。

（2）星海一号持有人若对合同变更内容有异议，可以在管理人临时设置的开放期（6月4日、5日、6日三个工作日）按照原合同约定申请退出本集合计划。

（3）截止2014年6月30日交易时间结束仍未签署本集合计划电子合同的持有人，管理人将在2014年6月30日日终自动赎回其持有的本集合计划份额。

（4）选择新参与和追加参与星海一号的投资者，自公告次日起可以通过管理人网上交易软件或本集合计划的推广网点签署本集合计划电子合同，并于管理人临时设置的开放期内以自助下单的方式申请参与本集合计划。

4、合同变更将在公告满5个工作日后生效。

感谢您的支持与配合！

大通证券股份有限公司

二〇一四年五月二十七日

附件一：合同变更前后合同条款变更对照表

所在章节及页码	变更前	变更后
P3 二、合同当事人	<p>(二) 管理人</p> <p>名称：大通证券股份有限公司</p> <p>注册地址：辽宁省大连市中山区人民路 24 号</p> <p>办公地址：辽宁省大连市中山区延安路 1 号保嘉大厦 15-16 层</p> <p>法定代表人：于宏民</p> <p>成立时间：2001 年 7 月 18 日</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：拾贰亿元人民币</p> <p>联系电话：0411-39673308</p> <p>联系人：唐明宇</p>	<p>(二) 管理人</p> <p>名称：大通证券股份有限公司</p> <p>注册地址：大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层</p> <p>办公地址：大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层</p> <p>法定代表人：李红光</p> <p>成立时间：2001 年 7 月 18 日</p> <p>组织形式：股份有限公司</p> <p>注册资本：贰拾贰亿元人民币</p> <p>联系电话：0411-39673241</p> <p>联系人：马欣</p>
P4 三、集合计划基本情况	<p>2 资产配置比例</p> <p>本计划权益类资产配置比例为 0-60%，其中，权证的资产配置比例不超过 3%；固定收益类和现金类资产配置比例为 40%-100%，其中现金类资产不低于 5%；在开放期，现金类资产配置比例不少于 10%。</p> <p>本计划成立初期，固定收益类和现金类资产配置的比例合计不低于 75%，此后根据计划单位净值状况及市场态势对投资范围内的各类资产配置比例进行动态调整，但必须符合本计划资产组合比例的规定。为有效降低计划资产净值波动风险，本计划权益类资产配置比例不超过 60%，在计划结束前三个月内，如果本计划不再展期，权益类资产配置比例不超过 20%，如需展期，相应投资监控比例调整由管理人另行书面通知托管人。</p>	<p>2 资产配置比例（大类资产合计市值占资产总值）</p> <p>本计划权益类资产配置比例为 0-60%，其中，权证的资产配置比例不超过 3%；固定收益类和现金类资产配置比例为 40%-100%，其中现金类资产不低于 5%；在开放期，现金类资产配置比例不少于 10%。</p> <p>本计划成立后三个月内，固定收益类和现金类资产配置的比例合计不低于 75%，此后根据计划单位净值状况及市场态势对投资范围内的各类资产配置比例进行动态调整，但必须符合本计划资产组合比例的规定。为有效降低计划资产净值波动风险，本计划权益类资产配置比例不超过 60%。</p>
P4-5 三、集合计划基本情况	<p>3 投资比例限制和禁止投资</p> <p>(1) 集合资产管理计划资产中的证券，不得用于回购，证监会另有规定除外。</p> <p>(2) 证券公司将其所管理的客户资产投资于一家公司发行的证券，按证券面值计算，不得超过该证券发行总量的百分之十。托管人仅对托管在本行的证券公司管理的客户资产进行监督。</p> <p>(3) 一个集合资产管理计划投资于一家公司发行的证券不得超过该计划资产净值的百分之十。</p> <p>(4) 证券公司办理集合资产管理业务，单个集合资产管理计划投资于本公司、资产托管机构及与本公司、资产托管机构有重要关联方关系的公司发行的证券的资金，不得超过该集合资产管理计划资产净值的百分之三，并事后通知托管机构。</p> <p>(5) 集合计划申购新股，可以不设申购上限，但是申报的金额不得超过集合计划的净值总额，申报的数量不得超过拟发</p>	<p>3 投资比例限制和禁止投资</p> <p>(1) 单只集合计划参与证券回购融入资金金额不得超过该计划资产净值的 40%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(2) 证券公司将其所管理的集合计划资产投资于一家公司发行的证券，按证券面值计算，不得超过该证券发行总量的百分之十。托管人仅对托管在本行的证券公司管理的客户资产进行监督。</p> <p>(3) 一个集合资产管理计划投资于一家公司发行的证券不得超过该计划资产净值的百分之十。</p> <p>(4) 证券公司办理集合资产管理业务，单个集合资产管理计划投资于本公司、资产托管机构及与本公司、资产托管机构有重要关联方关系的公司发行的证券的资金，不得超过该集合资产管理计划资产净值的百分之三，并事后通知托管机构。</p>

	<p>行股票公司本次发行股票的总量。</p> <p>(6) 证券公司应当在集合资产管理计划开始投资运作之日起六个月内使集合资产管理计划的投资组合比例符合集合资产管理合同的约定。因证券市场波动、投资对象合并、集合资产管理计划规模变动等外部因素致使集合资产管理计划的组合投资比例不符合集合资产管理合同约定的，证券公司应当在十个工作日内进行调整。</p>	<p>(5) 集合计划申购新股，可以不设申购上限，但是申报的金额不得超过集合计划的现金总额，申报的数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。</p> <p>(6) 证券公司应当在集合资产管理计划开始投资运作之日起六个月内使集合资产管理计划的投资组合比例符合集合资产管理合同的约定。因证券市场波动、投资对象合并、集合资产管理计划规模变动等外部因素致使集合资产管理计划的组合投资比例不符合集合资产管理合同约定的，证券公司应当在十个工作日内进行调整。</p>
P5 三、集合计划基本情况	<p>(四) 集合计划存续期限</p> <p>本集合计划存续期为集合计划宣告成立之日起 5 年，期满后经中国证监会批准可展期。</p>	<p>(四) 集合计划存续期限</p> <p>本集合计划无固定存续期限。</p>
P7 三、集合计划基本情况	<p>(十) 管理人自有资金参与 本集合计划管理人以计划成立规模的 5%投入自有资金，且不超过 7000 万元，总份额不超过 7000 万份。在集合计划存续期内，管理人以自有资金参与的集合计划份额不得提前退出。</p> <p>管理人自有资金参与的份额享有与其他委托人份额相同的分红和收益权。</p> <p>管理人自有资金参与的份额不承担对其他委托人的任何补偿义务。</p> <p>管理人自有资金参与的份额不享有“委托人权益保护安排”的权利。</p>	<p>(十) 管理人自有资金参与</p> <p>本集合计划管理人以计划成立规模的 5%投入自有资金，且不超过 7000 万元，总份额不超过 7000 万份。管理人自有资金参与的份额享有与其他委托人份额相同的分红和收益权。</p> <p>管理人自有资金参与的份额不承担对其他委托人的任何补偿义务。</p>
P7 三、集合计划基本情况	<p>(十一) 委托人权益保护安排-委托人推广期内购入份额的特别优惠条款</p> <p>本计划提取管理人业绩报酬作为风险补偿金，存入风险补偿金账户，在计划存续期内专户管理，用于对下列情况的委托人本金与收益进行有限补偿。如果委托人自计划成立时参与，持有计划份额满两年，本金出现损失，计划管理人以当时的风险补偿金的 50%对委托人的本金进行补偿，直至委托人的本金得到补偿或者该期的补偿金的 50%补偿完毕。如果委托人持有计划份额满 5 年，累计收益率未达到 6%，管理人以风险补偿金对委托人的收益进行补偿，直至委托人的收益得到补偿或风险补偿金补偿完毕。</p>	删除该部分

P10 四、设立推广期集合计划的参与	<p>3. 签署合同</p> <p>委托人于提出参与申请当日在推广网点签署《集合资产管理合同签章页》。</p> <p>该合同签章页、成交确认单与本合同一起作为委托人参与集合计划的完整合同。</p> <p>《集合资产管理合同》从管理人确认委托人参与申请有效，且委托人参与资金到账后生效。</p> <p>《集合资产管理合同签章页》一式三份，管理人、托管人及委托人各持有一份，每份具有同等的法律效力。</p>	<p>3. 签署合同</p> <p>本集合计划采用电子签名合同的方式签署，委托人通过电子信息网络以电子形式签署电子合同签名约定书、合同、风险揭示书等相关材料。电子合同在管理人、托管人、委托人三方完成签署，且委托人按合同约定将参与资金划入指定账户并经注册登记机构确认有效后生效。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，管理人和其他推广机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。</p>
P11 五、管理人以自有资金参与本计划时的特别约定	<p>五、管理人以自有资金参与本计划时的特别约定</p> <p>（一）参与金额</p> <p>管理人承诺在本计划推广期间，以计划成立规模的 5%投入自有资金，且不超过 7000 万元。</p> <p>（二）收益分配和责任分担方式</p> <p>管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与计划份额相对应损失的责任，但管理人自有资金参与份额不享有“委托人权益保护安排”的权利。</p> <p>（三）管理人承诺</p> <p>管理人保证参与资金在集合计划存续期内不得退出。</p>	<p>五、管理人以自有资金参与本计划时的特别约定</p> <p>（一）参与金额</p> <p>1. 在本计划推广期间，以计划成立规模的 5%投入自有资金，且不超过 7000 万元。</p> <p>2. 存续期间，管理人自有资金参与本计划份额不超过本计划总份额的 20%。</p> <p>3. 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份额连续 5 个工作日被动超过计划总份额的 20%时，管理人将在 5 个工作日内通过管理人网站公告自有资金参与集合计划被动超限情况以及退出安排，并按照安排进行调整。</p> <p>（二）收益分配和责任分担方式</p> <p>管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与计划份额相对应损失的责任。</p>
P11 六、集合计划资产的托管	<p>六、集合计划资产的托管</p> <p>本集合计划资产由中国光大银行股份有限公司托管，管理人已经与托管银行签订了托管协议。签订的托管协议已经明确了计划托管人和计划管理人之间在计划资产保管、委托人名册登记与保管、计划资产管理和运作、委托人参与或退出计划、计划资产清算及相互监督等相关事宜中的权利、义务及责任，以确保计划资产的安全，保护委托人的合法权益。</p>	<p>六、集合计划资产的托管</p> <p>本集合计划资产由中国光大银行股份有限公司托管，管理人已经与托管银行签订了托管协议。签订的托管协议已经明确了计划托管人和计划管理人之间在计划资产保管、委托人名册登记与保管、计划资产管理和运作、委托人参与或退出计划、计划资产清算及相互监督等相关事宜中的权利、义务及责任，以确保计划资产的安全，保护委托人的合法权益。托管人的托管职责以托管协议的约定为准，如管理合同、说明书与托管协议冲突，相关约定以托管协议为准。</p>

P13 八、集合计划费用	<p>（三）业绩报酬在每个季度开放期，管理人按累计年化收益率提取业绩报酬。当累计年化收益率超过 6%时，管理人提取超过部分的 20%作为业绩报酬。如果累计年化收益率不足 6%，管理人不得提取业绩报酬，并将不足部分累计。下一个开放期，如果累计年化收益率超过 6%，对于超过部分必须先用于弥补累计不足部分，之后计划管理人才可以提取剩余部分的 20%作为业绩报酬，如果累计年化收益率依旧不超过 6%，则不得提取业绩报酬，并将不足部分继续累计。</p>	<p>（三）业绩报酬</p> <p>在每个季度开放期，管理人按累计年化收益率提取业绩报酬。如果累计年化收益率不足 6%，管理人不得提取业绩报酬，并将不足部分累计。当累计年化收益率超过 6%不足 10%时，管理人提取超过 6%以上部分的 15%作为业绩报酬。如果累计年化收益率超过 10%，管理人提取 6%至 10%收益部分的 15%和超出 10%以上部分的 20%作为业绩报酬。</p>
P14 十、委托人权益保护安排	<p>十、委托人权益保护安排</p> <p>本计划成立后，提取 100%管理人业绩报酬作为风险补偿金，用于补偿满足持有条件的集合计划份额。</p> <p>风险补偿金归管理人所有，存入管理人在托管机构开设的专门的风险补偿金账户。该账户资金由管理人负责管理，仅用于投资现金类资产。</p> <p>本计划提取管理人业绩报酬作为风险补偿金，存入风险补偿金账户，在计划存续期内专户管理，用于对下列情况的委托人本金与收益进行有限补偿。如果委托人自计划成立时参与，持有计划份额满两年，本金出现损失，计划管理人以当时的风险补偿金的 50%对委托人的本金进行补偿，直至委人的本金得到补偿或者该期的风险补偿金的 50%补偿完毕。如果委托人持有计划份额满 5 年，累计收益率未达到 6%，管理人以风险补偿金对委托人的收益进行补偿，直至委托人的收益得到补偿或风险补偿金补偿完毕。</p>	<p>删除该部分，其后各部分排序自动向前调整。</p>
P17 十二、托管人的权利与义务	<p>（二）托管人的义务</p> <p>1. 依法为每个集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户；</p> <p>2. 安全保管集合计划资产、办理资金收付事项；非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；</p> <p>3. 监督集合计划的经营运作情况，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的有关规定或者合同</p> <p>约定的，应当予以制止，并及时报告管理人注册地中国证监会派出机构；</p> <p>4. 复核管理人计算的集合计划的资产净值；</p> <p>5. 按规定出具集合计划托管报告；</p> <p>6. 因管理人过错造成集合计划资产损失的，代委托人向管理人追偿；</p> <p>7. 法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《托管协议》约定的其他义务。</p>	<p>（二）托管人的义务</p> <p>1. 依法为每个集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户；</p> <p>2. 安全保管集合计划资产、办理资金收付事项；非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；</p> <p>3. 监督集合计划的经营运作情况，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的有关规定或者《托管协议》约定的，应当予以制止，并报告管理人注册地中国证监会派出机构；</p> <p>4. 复核管理人计算的集合计划的资产净值；</p> <p>5. 按规定出具集合计划托管报告；</p> <p>6. 因管理人过错造成集合计划资产损失的，代委托人向管理人追偿；</p> <p>7. 法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《托管协议》约定的其他义务。</p>

P18 十四、集合计划合同的变更	<p>开放期内当法律法规或有关政策发生变化时，委托人特此授权管理人经与托管人协商后，可以对本合同及集合计划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，管理人应将更新或修改内容报中国证监会备案。更新或修改的内容在管理人网站和推广机构网点公告后第六个工作日生效。</p>	<p>本计划存续期内当法律法规或有关政策发生变化时，委托人特此授权管理人经与托管人协商后，可以对本合同及集合计划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，管理人应将更新或修改内容报中国证券业协会备案，同时抄送证券公司住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构。更新或修改的内容在管理人网站和推广机构网点公告后第六个工作日生效。</p>
P20 十五、集合计划存续期间，委托人参与和退出	<p>(3) 签署签章页</p> <p>初次参与本集合计划的投资者应于参与当日在推广网点签署《集合资产管理合同签章页》。具体程序同“推广期参与”。</p> <p>已经持有本集合计划份额的委托人可不再签署《集合资产管理合同签章页》。其新参与的份额享受原来签署的《集合资产管理合同签章页》的所有法律效力。</p>	<p>(3) 合同签署</p> <p>本集合计划采用电子签名合同的方式签署，委托人通过电子信息网络以电子形式签署电子合同签名约定书、合同、风险揭示书等相关材料。电子合同在管理人、托管人、委托人三方完成签署，且委托人按合同约定将参与资金划入指定账户并经注册登记机构确认有效后生效。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，管理人和其他推广机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。</p>
P21 十六、集合计划存续期间，委托人参与和退出	<p>1. 退出办理的时间和场所</p> <p>本集合计划的开放日内委托人可申请退出，退出申请时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。</p> <p>本计划的退出将通过管理人的营业网点及推广代理机构的代理推广网点进行。</p>	<p>1. 退出办理的时间和场所</p> <p>本集合计划的开放日内委托人可申请退出，退出申请时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。本计划的退出将通过管理人的营业网点及推广代理机构的代理推广网点进行或通过管理人与推广机构认可的其它退出方式提出退出。</p>
P22 十五、集合计划存续期间，委托人参与和退出	<p>4. 退出的数额限制</p> <p>每次退出的最低份额为 1,000 份，委托人可将其部分或全部集合计划份额退出。部分退出时，退出份额必须是 1,000 份的整数倍。当委托人在某一销售机构处持有的份额小于 1,000 份时，该部分份额将被强制退出。</p>	<p>4. 退出的数额限制</p> <p>每次退出的最低份额为 1,000 份，委托人可将其部分或全部集合计划份额退出。当委托人在某一销售机构处持有的份额小于 1,000 份时，该部分份额将被强制退出。</p>

P24 十六、集合计划的展期

- (一) 集合计划展期的条件
1. 本集合计划存续期为 5 年，存续期满后经中国证监会批准可以展期。
 2. 本集合计划如经中国证监会事先核准并满足下列条件后即可展期：
 - (1) 本集合计划运作情况良好，未发生重大违法违规情况；
 - (2) 本集合计划期满后的第一个工作日满足集合计划成立条件；
 - (3) 中国证监会规定的其他条件。
- (二) 集合计划展期的方式、程序和期限
1. 展期方式和程序
- 在符合展期条件的基础上，管理人将根据以下方式 and 程序安排展期：
- (1) 集合计划存续期届满且符合展期条件拟展期时，管理人应当至少在届满前三个月向中国证监会提出展期申请。在管理人向中国证监会提出展期申请期间，委托人可按照集合资产管理合同的约定退出。
 - (2) 集合计划展期申请经中国证监会核准后，集合计划可以展期。管理人在收到中国证监会核准文件后五个工作日内在管理人网站公告，并将按照集合资产管理合同的约定通知客户。在集合计划届满前集合计划参与退出业务正常开展。若委托人不同意展期，委托人有权在存续期届满日前（含届满日）到推广机构办理退出手续；若委托人同意展期，应在存续期届满日前（不含届满日）到推广机构重新签署集合资产管理合同。截至存续期届满日，委托人未给出明确答复的，视为不同意展期，推广机构将按合同规定在存续期届满日，为委托人办理退出手续。
 - (3) 经证监会核准展期，集合计划存续期届满，集合计划符合成立条件和展期条件，管理人进行集合计划展期公告。集合计划展期后 5 日内，管理人需将展期情况报管理人注册地中国证监会派出机构备案。
 - (4) 若集合计划的展期申请未获得中国证监会核准，或者不符合集合计划成立条件或展期条件，集合计划展期失败，集合计划进入清算终止程序。
2. 展期期限：
- 本计划展期期限原则上与本计划的存续期相同。

本集合计划无固定存续期限，无展期安排。

P24 十七、集合计划终止和清算	<p>(一) 集合计划应当终止的情形</p> <p>当出现以下情形时，本集合计划将终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 集合计划存续期届满且不再展期； 2. 集合计划管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格而导致集合资产管理计划终止； 3. 集合计划管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责而导致集合资产管理计划终止； 4. 不可抗力力的发生导致本集合计划不能存续； 5. 集合计划委托人数量少于 2 人； 6. 法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。 	<p>(一) 集合计划应当终止的情形</p> <p>当出现以下情形之一时，本集合计划将终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 集合计划管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格而导致集合资产管理计划终止； 2. 集合计划管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责而导致集合资产管理计划终止； 3. 不可抗力力的发生导致本集合计划不能存续； 4. 集合计划委托人数量少于 2 人； 5. 法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况；。 6. 管理人认为必要时可以终止本计划。 <p>当本集合计划因终止情形中第 6 条终止时，管理人应当在计划终止日前至少 15 个工作日内在管理人网站上公告并在公告后 2 个工作日内向中国证券业协会报备并抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p>
P24 十七、集合计划终止和清算	<p>(二) 集合计划清算的相关事宜</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 计划终止后 5 个工作日内向中国证监会及注册地中国证监会派出机构报告； 2. 清算小组统一接管计划资产； 3. 清算小组对计划资产进行清理和确认、评估和变现； 4. 将计划清算结果报告中国证监会； 5. 在报备中国证监会后 3 个工作日内披露清算报告； 6. 清算报告披露后 5 个工作日内对清算资产进行分配。 	<p>(二) 集合计划清算的相关事宜</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 计划终止后 5 个工作日内开始清算； 2. 清算小组统一接管计划资产； 3. 清算小组对计划资产进行清理和确认、评估和变现； 4. 清算结束后 15 日内，将清算结果报中国证券业协会备案，同时抄送住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构。 5. 清算报告披露后 5 个工作日内对清算资产进行分配。
P27 十九、合同的成立与生效	<p>(一) 合同成立、生效的条件</p> <p>经委托人、管理人和托管人三方签署本合同《签章页》，并且委托人实际交付资金经管理人确认后，本合同成立并生效。委托人、管理人和托管人三方签署本合同《签章页》即视为自愿接受本合同和集合计划说明书的约束。</p> <p>(二) 本合同附件《大通星海一号集合资产管理计划说明书》是合同的组成部分，与合同具有同等的法律效力。</p> <p>(三) 推广机构指定营业网点确认委托人参与和退出行为的凭证，是本合同不可分割的一部分。</p> <p>(四) 《集合资产管理合同签章页》一式三份，委托人持有一份，管理人持有一份，托管人持有一份，每份具有同等的法律效力。</p>	<p>(一) 合同成立、生效的条件</p> <p>本合同以电子签名方式签署，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。本合同成立后，委托人实际交付资金经管理人确认后生效。</p> <p>(二) 本合同附件《大通星海一号集合资产管理计划说明书》是合同的组成部分，与合同具有同等的法律效力。</p> <p>(三) 推广机构指定营业网点确认委托人参与和退出行为的凭证，是本合同不可分割的一部分。</p>
P28 二十一、风险揭示	<p>(六) 集合计划虽然设置风险补偿条款，但仅补偿自计划成立时参与、持有计划份额满两年及两年以上的客户，并且存在无法提取风险补偿金或风险补偿金不足补偿委托人的风险。</p>	<p>删除，其后各部分排序自动向前调整。</p>

P28 二十一、风险揭示	<p>(七) 担任集合资产管理计划管理人的证券公司,因停业、解散、撤销、破产,或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责,可能给委托人带来一定的风险。</p>	<p>(六) 担任集合资产管理计划管理人的证券公司、集合资产管理计划的资产托管机构,因停业、解散、撤销、破产,或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责,可能给委托人带来一定的风险。</p>
P29 二十一、风险揭示	<p>(八) 其他风险</p> <p>1. 技术风险:在集合资产管理计划的日常交易中,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管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等等。</p> <p>2. 操作风险:管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中,因操作失误或违反操作规程而引起的风险。</p> <p>3. 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,可能导致委托资产的损失,从而带来风险。</p>	<p>(八) 其他风险</p> <p>1. 技术风险:在集合资产管理计划的日常交易中,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管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等等。</p> <p>2. 操作风险:管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中,因操作失误或违反操作规程而引起的风险。</p> <p>3. 电子合同签约风险:本集合计划采用经中登等中国证监会认可的机构验证的电子合同签约方式,同所有网上交易一样存在操作的风险。</p> <p>4. 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,可能导致委托资产的损失,从而带来风险。</p>
P29 二十四、提请注意	<p>二十四、提请注意</p> <p>1. 管理人、托管人确认,已向委托人明确说明集合计划的风险,不保证委托人资产本金不受损失或者取得最低收益。</p> <p>2. 委托人确认,已充分理解本合同内容,自行承担投资风险和损失。</p> <p>3. 《集合资产管理合同签章页》应由委托人本人签署,当委托人为机构时,应由法定代表人或其授权代表签署。</p>	<p>二十三、提请注意</p> <p>1. 管理人、托管人确认,已向委托人明确说明集合计划的风险,不保证委托人资产本金不受损失或者取得最低收益。</p> <p>2. 委托人确认,已充分理解本合同内容,自行承担投资风险和损失。</p>
P29 二十五、管理人、托管人签章及时间		删除该部分

附件二：合同变更前后说明书条款变更对照表

所在章节及页码	变更前	变更后
P5 二、定义与释义	风险补偿金：指计划存续期内，管理人从其业绩报酬中计提的，用于计划对特定委托人进行补偿的资金	删除该部分
P6 三、集合计划介绍	<p>（3）管理人参与，与投资者共担风险</p> <p>本集合计划管理人承诺，以自有资金不超过 7000 万元参与集合计划，存续期内永不退出，该部分份额与其他投资人享受同等义务，但是不享受对其他委托人的“委托人权益保护安排”的权利。</p> <p>（4）委托人权益保护安排</p> <p>本计划提取管理人业绩报酬作为风险补偿金，该资金归管理人所有，用于对自计划成立时参与，持有计划份额满两年及两年以上的客户进行有限风险补偿。</p>	<p>（3）管理人参与，与投资者共担风险</p> <p>本集合计划管理人承诺，以自有资金不超过 7000 万元参与集合计划，该部分份额与其他投资人享受同等义务。</p>
P6 三、集合计划介绍	<p>2. 资产配置比例（类别资产市值占资产净值比例）</p> <p>本计划权益类资产配置比例为 0-60%，其中，权证的资产配置比例不超过 3%；固定收益类和现金类资产配置比例为 40%-100%，其中现金类资产不低于 5%；在开放期，现金类资产配置比例不少于 10%。</p> <p>本计划成立初期，固定收益类和现金类资产配置的比例合计不低于 75%，此后根据计划单位净值状况及市场态势对投资范围内的各类资产配置比例进行动态调整，但必须符合本计划资产组合比例的规定。为有效降低计划资产净值波动风险，本计划权益类资产配置比例不超过 60%，在计划结束前三个月内，如果本计划不再展期，权益类资产配置比例不超过 20%，如需展期，相应投资监控比例调整由投资管理人另行书面通知托管人。</p>	<p>2. 资产配置比例（大类资产合计市值占资产总值比例）</p> <p>本计划权益类资产配置比例为 0-60%，其中，权证的资产配置比例不超过 3%；固定收益类和现金类资产配置比例为 40%-100%，其中现金类资产不低于 5%；在开放期，现金类资产配置比例不少于 10%。</p> <p>本计划成立后三个月内，固定收益类和现金类资产配置的比例合计不低于 75%，此后根据计划单位净值状况及市场态势对投资范围内的各类资产配置比例进行动态调整，但必须符合本计划资产组合比例的规定。为有效降低计划资产净值波动风险，本计划权益类资产配置比例不超过 60%。</p>
P7 三、集合计划介绍	<p>（六）集合计划的存续期限：</p> <p>本集合计划存续期为集合计划宣告成立之日起 5 年，期满后经中国证监会批准可展期。</p> <p>在中国证监会核准展期申请后，管理人将通过管理人网站和推广机构网点向委托人发布展期提示性报告。</p>	<p>（六）集合计划的存续期限</p> <p>本集合计划无固定存续期限。</p>
P8 三、集合计划介绍	<p>（十一）管理人业绩报酬</p> <p>在每个季度开放期，管理人按累计年化收益率提取业绩报酬。当累计年化收益率超过 6%时，管理人提取超过部分的 20%作为业绩报酬。如果累计年化收益率不足 6%，管理人不得提取业绩报酬，并将不足部分累计。下一个开放期，如果累计年化收益率超过 6%，对于超过部分必须先用于弥补累计不足部分，之后计划管理人才可以提取剩余部分的 20%作为业绩报酬，如果累计年化收益率依旧不超过 6%，则不得提取业绩报酬，并将不足部分继续累计。</p>	<p>（十一）管理人业绩报酬</p> <p>在每个季度开放期，管理人按累计年化收益率提取业绩报酬。如果累计年化收益率不足 6%，管理人不得提取业绩报酬，并将不足部分累计。当累计年化收益率超过 6%不足 10%时，管理人提取超过 6%以上部分的 15%作为业绩报酬。如果累计年化收益率超过 10%，管理人提取 6%至 10%收益部分的 15%和超出 10%以上部分的 20%作为业绩报酬。</p>

P8 三、集合计划介绍	<p>(十二) 管理人自有资金参与</p> <p>1. 参与金额</p> <p>管理人承诺在本计划推广期间, 以计划成立规模的 5%投入自有资金, 且不超过 7000 万元。</p> <p>2. 收益分配和责任分担方式</p> <p>管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利, 也承担与计划份额相对应损失的责任, 但管理人自有资金参与份额不享有“委托人权益保护安排”的权利。</p> <p>3. 管理人承诺</p> <p>管理人保证参与资金在集合计划存续期内不得退出。</p>	<p>(十二) 管理人自有资金参与</p> <p>1. 参与金额</p> <p>(1) 在本计划推广期间, 以计划成立规模的 5%投入自有资金, 且不超过 7000 万元。</p> <p>(2) 存续期间, 管理人自有资金参与本计划份额不超过本计划总份额的 20%。</p> <p>(3) 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份额连续 5 个工作日被动超过计划总份额的 20% 时, 管理人将在 5 个工作日内通过管理人网站公告自有资金参与集合计划被动超限情况以及退出安排, 并按照安排进行调整。</p> <p>2. 收益分配和责任分担方式</p> <p>管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利, 也承担与计划份额相对应损失的责任。</p>
P9 四、集合计划当事人介绍	<p>(一) 管理人简介</p> <p>名称: 大通证券股份有限公司</p> <p>注册地址: 辽宁省大连市中山区人民路 24 号</p> <p>办公地址: 辽宁省大连市中山区延安路 1 号保嘉大厦 15-16 层</p> <p>法定代表人: 于宏民</p> <p>成立时间: 2001 年 7 月 18 日</p> <p>组织形式: 股份有限公司</p> <p>注册资本: 人民币壹拾贰亿元整</p> <p>联系电话: 0411-39673308</p> <p>联系人: 唐明宇</p>	<p>(二) 管理人</p> <p>名称: 大通证券股份有限公司</p> <p>注册地址: 大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层</p> <p>办公地址: 大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层</p> <p>法定代表人: 李红光</p> <p>成立时间: 2001 年 7 月 18 日</p> <p>组织形式: 股份有限公司</p> <p>注册资本: 人民币贰拾贰亿元</p> <p>联系电话: 0411-39673241</p> <p>联系人: 马欣</p>
P10 四、集合计划当事人介绍	<p>1. 大通证券股份有限公司</p> <p>注册地址: 辽宁省大连市中山区人民路 24 号</p> <p>办公地址: 辽宁省大连市中山区延安路 1 号保嘉大厦 15-16 层</p> <p>法定代表人: 于宏民</p> <p>传真电话: 0411-39673208</p> <p>联系电话: 0411-39673308</p> <p>公司网站: www.estock.com.cn</p> <p>联系人: 唐明宇</p>	<p>1. 大通证券股份有限公司</p> <p>注册地址: 大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层</p> <p>办公地址: 大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦 38、39 层</p> <p>法定代表人: 李红光</p> <p>传真电话: 0411-39673208</p> <p>联系电话: 0411-39673241</p> <p>公司网站: www.estock.com.cn</p> <p>联系人: 马欣</p>

P13 五、设立推广期间委托人参与集合计划	<p>3. 签署合同</p> <p>委托人于提出参与申请当日在推广网点签署《集合资产管理合同签章页》。</p> <p>该合同签章页、成交确认单与合同一起作为委托人参与集合计划的完整合同。</p> <p>《集合资产管理合同》从管理人确认委托人参与申请有效，且委托人参与资金到账后生效。</p> <p>《集合资产管理合同签章页》正本一式三份，管理人、托管人及委托人各持有一份，每份具有同等的法律效力。</p>	<p>3、签署合同</p> <p>本集合计划采用电子签名合同的方式签署，委托人通过电子信息网络以电子形式签署电子合同签名约定书、合同、风险揭示书等相关材料。电子合同在管理人、托管人、委托人三方完成签署，且委托人按合同约定将参与资金划入指定账户并经注册登记机构确认有效后生效。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，管理人和其他推广机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。</p>
P14 六、管理人以自有资金参与本计划时的特别约定	<p>(一) 参与金额</p> <p>管理人承诺在本计划推广期间，以计划成立规模的 5%投入自有资金，且不超过 7000 万元。</p> <p>(二) 收益分配和责任分担方式</p> <p>管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与计划份额相对应损失的责任，但管理人自有资金参与份额不享有“委托人权益保护安排”的权利。</p> <p>(三) 管理人承诺</p> <p>管理人保证参与资金在集合计划存续期内不得退出。</p>	<p>(一) 参与金额</p> <p>1. 在本计划推广期间，以计划成立规模的 5%投入自有资金，且不超过 7000 万元。</p> <p>2. 存续期间，管理人自有资金参与本计划份额不超过本计划总份额的 20%。</p> <p>3. 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份额连续 5 个工作日被动超过计划总份额的 20% 时，管理人将在 5 个工作日内通过管理人网站公告自有资金参与集合计划被动超限情况以及退出安排，并按照安排进行调整。</p> <p>(二) 收益分配和责任分担方式</p> <p>管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与计划份额相对应损失的责任。</p>
P14 七、委托人权益保护安排	<p>为鼓励委托人在推广期内参与本计划，本计划特为推广期内委托人参与的份额设立特别优惠条款，内容如下：</p> <p>(一) 本计划成立后，提取 100%管理人业绩报酬作为风险补偿金，用于补偿满足持有条件的集合计划份额。</p> <p>(二) 风险补偿金归管理人所有，存入管理人在托管机构开设的专门的风险补偿金账户。该账户资金由管理人负责管理，仅用于投资现金类资产。</p> <p>(三) 本计划提取管理人业绩报酬作为风险补偿金，存入风险补偿金账户，在计划存续期内专户管理，用于对下列情况的委托人本金与收益进行有限补偿。如果委托人自计划成立时参与，持有计划份额满两年，本金出现损失，计划管理人以当时的风险补偿金的 50%对委托人的本金进行补偿，直至委托人的本金得到补偿或者该期的风险补偿金的 50%补偿完毕。如果委托人持有计划份额满 5 年，累计收益率未达到 6%，管理人以风险补偿金对委托人的收益进行补偿，直至委托人的收益得到补偿或风险补偿金补偿完毕。</p> <p>(四) 管理人自有资金参与的份额不享有风险补偿的权利。</p>	<p>删除该部分</p>

P17 八、投资理念和投资策略	<p>(2) 资产配置比例</p> <p>本计划权益类资产配置比例为 0-60%，其中，权证的资产配置比例不超过 3%；固定收益类和现金类资产配置比例为 40%-100%，其中现金类资产不低于 5%；在开放期，现金类资产配置比例不少于 10%。本计划成立初期，固定收益类和现金类资产配置的比例合计不低于 75%，此后根据计划单位净值状况及市场态势对投资范围内的各类资产配置比例进行动态调整，但必须符合本计划资产组合比例的规定。为有效降低计划资产净值波动风险，本计划权益类资产配置比例不超过 60%，在计划结束前三个月内，如果本计划不再展期，权益类资产配置比例不超过 20%，如需展期，相应投资监控比例调整由投资管理人另行书面通知托管人。</p>	<p>(2) 资产配置比例</p> <p>本计划权益类资产配置比例为 0-60%，其中，权证的资产配置比例不超过 3%；固定收益类和现金类资产配置比例为 40%-100%，其中现金类资产不低于 5%；在开放期，现金类资产配置比例不少于 10%。本计划成立初期，固定收益类和现金类资产配置的比例合计不低于 75%，此后根据计划单位净值状况及市场态势对投资范围内的各类资产配置比例进行动态调整，但必须符合本计划资产组合比例的规定。为有效降低计划资产净值波动风险，本计划权益类资产配置比例不超过 60%。</p>
P27 九、投资决策与风险控制	<p>(三) 风险共担</p> <p>管理人承诺在本计划推广期间，以计划成立规模的 5%投入自有资金，且不超过 7000 万元； 在集合计划存续期内，管理人以自有资金参与的集合计划份额不得提前退出；</p> <p>管理人自有资金参与的份额享有与其他委托人份额相同的分红和收益权；</p> <p>管理人自有资金参与的份额不承担对其他委托人的任何补偿义务； 管理人自有资金参与的份额不享有“委托人权益保护安排”的权利。</p>	<p>(三) 风险共担</p> <p>管理人承诺在本计划推广期间，以计划成立规模的 5%投入自有资金，且不超过 7000 万元；</p> <p>管理人自有资金参与的份额享有与其他委托人份额相同的分红和收益权；</p> <p>管理人自有资金参与的份额不承担对其他委托人的任何补偿义务。</p>
P27 十、投资限制与禁止行为	<p>(一) 投资限制行为</p> <p>1. 将集合计划投资于一家公司发行的证券超过集合计划资产净值的 10%；因客观原因导致集合计划的投资组合、持股比例不符合集合资产管理合同约定或有关规定的，计划管理人应在十个工作日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定；</p> <p>2. 管理人管理的客户资产（含本集合计划资产）投资于一家公司发行的证券，按证券面值计算，超过该证券发行总量的 10%；因客观原因导致集合计划的投资组合、持股比例不符合集合资产管理合同约定或有关规定的，计划管理人应在十个工作日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定；</p> <p>3. 集合计划申购新股，申报的金额超过集合计划的净值总额，或申报的数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>4. 将集合计划投资于本公司担任保荐机构（主承销商）的股票或者其他证券，按成本价计算，超过集合资产管理计划净值的 7%；</p> <p>5. 将集合计划投资于本公司、资产托管机构及与本公司、资产托管机构有重要关联方关系的公司发行的证券的资</p>	<p>(一) 投资限制行为</p> <p>1. 将集合计划投资于一家公司发行的证券超过集合计划资产净值的 10%；因客观原因导致集合计划的投资组合、持股比例不符合集合资产管理合同约定或有关规定的，计划管理人应在十个工作日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定；</p> <p>2. 管理人管理的集合计划资产投资于一家公司发行的证券，按证券面值计算，超过该证券发行总量的 10%；因客观原因导致集合计划的投资组合、持股比例不符合集合资产管理合同约定或有关规定的，计划管理人应在十个工作日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定；</p> <p>3. 集合计划申购新股，申报的金额超过集合计划的现金总额，或申报的数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量</p> <p>4. 单只集合计划参与证券回购融入资金金额超过该计划资产净值的 40%，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>5. 将集合计划投资于本公司担任保荐机构（主承销商）的股票或者其他证券，按成本价计算，超过集合资产管理计划净值的 7%；</p> <p>6. 将集合计划投资于本公司、资产托管机构及与本公司、</p>

	<p>金，超过该集合资产管理计划资产净值的 3%；</p> <p>6. 证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。</p>	<p>资产托管机构有重要关联方关系的公司发行的证券的资金，超过该集合资产管理计划资产净值的 3%；</p> <p>7. 证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。</p>
P28 十、投资限制与禁止行为	<p>（二）投资禁止行为</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途； 2. 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资； 3. 将集合计划资产中的证券用于回购，证监会另有规定除外； 4. 向客户做出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； 5. 挪用集合计划资产； 6. 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营； 7. 使用集合计划资产进行不必要的交易； 8. 内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为； 9. 超过公司经营范围从事集合资产管理业务； 10. 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。 	<p>（二）投资禁止行为</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途； 2. 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资； 3. 向客户做出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. 挪用集合计划资产； 5. 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营； 6. 使用集合计划资产进行不必要的交易； 7. 内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为； 8. 超过公司经营范围从事集合资产管理业务； 9. 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。
P36 十三、费用支出与业绩报酬	<p>1. 管理人提取业绩报酬的原则</p> <p>在每个季度开放期，管理人按累计年化收益率提取业绩报酬。当累计年化收益率超过 6%时，管理人提取超过部分的 20%作为业绩报酬。如果累计年化收益率不足 6%，管理人不得提取业绩报酬，并将不足部分累计。下一个开放期，如果累计年化收益率超过 6%，对于超过部分必须先用于弥补累计不足部分，之后计划管理人才可以提取剩余部分的 20%作为业绩报酬，如果累计年化收益率依旧不超过 6%，则不得提取业绩报酬，并将不足部分继续累计。</p> <p>季度结算日是指自计划成立日起每个开放期的前一日。本计划成立后的 3 个月为封闭期，不接受客户的参与和退出申请，之后每季度的最后 5 个工作日为开放期，接受客户的参与和退出申请。因此本计划在 5 年的存续期内共有 19 个开放期。</p>	<p>1. 管理人提取业绩报酬的原则</p> <p>在每个季度开放期，管理人按累计年化收益率提取业绩报酬。如果累计年化收益率不足 6%，管理人不得提取业绩报酬，并将不足部分累计。当累计年化收益率超过 6%不足 10%时，管理人提取超过 6%以上部分的 15%作为业绩报酬。如果累计年化收益率超过 10%，管理人提取 6%至 10%收益部分的 15%和超出 10%以上部分的 20%作为业绩报酬。季度结算日是指自计划成立日起每个开放期的前一日。本计划成立后的 3 个月为封闭期，不接受客户的参与和退出申请，之后每季度的最后 5 个工作日为开放期，接受客户的参与和退出申请。业绩报酬每个季度结算日计提并支付。业绩报酬计提日为实际发生业绩报酬计提的季度结算日。</p>

<p>P36 十三、费用支出与业绩报酬</p>	<p>2. 业绩报酬的计算公式及说明</p> <p>业绩报酬的计提以折算的年化收益率为基准，计算方法如下：</p> $P_t = \left(\frac{NAV_t - MNAV_{t-1}}{NAV_{t-1}} - \frac{6\%}{4} \right) \times 20\% \times NAV_{t-1} \times N_t$ <p>其中：t 为第 t 个开放期，当 t=20, 则表示期满清算。 P_t 为第 t 个开放期提取的业绩报酬； NAV_t 为第 t 个开放期季度结算日提取业绩报酬和分红之前的集合计划单位累计净值； NAV_{t-1} 为第 t-1 个开放期季度结算日提取业绩报酬和分红之后的集合计划单位净值； N_t 为第 t 个开放期季度结算日的集合计划份额。</p>	<p>2. 业绩报酬计提办法</p> <p>业绩报酬计提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累计年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准。</p> <p>1) 当累计年化收益率 R 小于或等于 6% 时，管理人不提取业绩报酬；</p> <p>2) 当累计年化收益率 R 大于 6% 小于等于 10% 时，管理人提取超过 6% 以上部分的 15% 作为业绩酬；</p> <p>3) 当累计年化收益率 R 大于 10% 时，管理人提取 6% 至 10% 收益部分的 15% 和超出 10% 以上部分的 20% 作为业绩报酬。具体计算方法如下：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>累计年化收益率</th> <th>计提比例</th> <th>业绩报酬（S）计算方法</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>当 R ≤ 6% 时</td> <td>0</td> <td>S = 0</td> </tr> <tr> <td>当 6% < R ≤ 10% 时</td> <td>15%</td> <td>$S = (R - 6\%) \times 15\% \times C \times F \times \frac{D}{365}$</td> </tr> <tr> <td>当 R > 10% 时</td> <td>20%</td> <td>$S = [(10\% - 6\%) \times 15\% + (R - 10\%) \times 20\%] \times C \times F \times \frac{D}{365}$</td> </tr> </tbody> </table> <p>其中，R = [(A - B) / C] * 365 / D * 100%， 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与本次业绩报酬计提日间隔天数。 F 为提取业绩报酬的份额。</p>	累计年化收益率	计提比例	业绩报酬（S）计算方法	当 R ≤ 6% 时	0	S = 0	当 6% < R ≤ 10% 时	15%	$S = (R - 6\%) \times 15\% \times C \times F \times \frac{D}{365}$	当 R > 10% 时	20%	$S = [(10\% - 6\%) \times 15\% + (R - 10\%) \times 20\%] \times C \times F \times \frac{D}{365}$
累计年化收益率	计提比例	业绩报酬（S）计算方法												
当 R ≤ 6% 时	0	S = 0												
当 6% < R ≤ 10% 时	15%	$S = (R - 6\%) \times 15\% \times C \times F \times \frac{D}{365}$												
当 R > 10% 时	20%	$S = [(10\% - 6\%) \times 15\% + (R - 10\%) \times 20\%] \times C \times F \times \frac{D}{365}$												
<p>P36 十三、费用支出与业绩报酬</p>	<p>3. 提取办法</p> <p>业绩报酬每个季度结算日计提并支付。由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人收到划付指令五个工作日内从集合计划资产中一次性划付到管理人账户。</p> <p>如果集合计划提前终止，则以终止日的累计单位净值为准计算管理人当期应提的业绩报酬；集合计划到期清算时，则以最后一个季度结算日的累计单位净值为准计算管理人当期应提的业绩报酬。</p>	<p>3. 提取办法</p> <p>业绩报酬每个季度结算日计提并支付。由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人收到划付指令五个工作日内从集合计划资产中一次性划付到管理人账户。</p> <p>如果集合计划提前终止，则以终止日与上一个业绩报酬计提日间的累计年化收益率为准计算管理人当期应提的业绩报酬；集合计划到期清算时，则以最后一个季度结算日与上一个业绩报酬计提日间的累计年化收益率为准计算管理人当期应提的业绩报酬。</p>												
<p>P41 十五、集合计划存续期间，委托人的参与和退出</p>	<p>（3）签署合同</p> <p>初次参与本集合计划的投资者应于参与当日在推广网点签署《集合资产管理合同签章页》。具体程序同“推广期参与”。</p> <p>已经持有本集合计划份额的委托人可不再签署《集合资产管理合同签章页》。其新参与的份额享受原来签署的《集合资产管理合同签章页》的所有法律效力。</p>	<p>（3）签署合同</p> <p>本集合计划采用电子签名合同的方式签署，委托人通过电子信息网络以电子形式签署电子合同签名约定书、合同、风险揭示书等相关材料。电子合同在管理人、托管人、委托人三方完成签署，且委托人按合同约定将参与资金划入指定账户并经注册登记机构确认有效后生效。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，管理人和其他推广机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。</p>												

P41 十五、集合计划存续期间,委托人的参与和退出	<p>1. 退出办理的时间和场所</p> <p>本集合计划的开放日内委托人可申请退出,退出申请时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。本计划的退出将通过管理人的营业网点及推广代理机构的代理推广网点进行。</p>	<p>1. 退出办理的时间和场所</p> <p>本集合计划的开放日内委托人可申请退出,退出申请时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间。本计划的退出将通过管理人的营业网点及推广代理机构的代理推广网点进行或通过管理人与推广机构认可的其它退出方式提出退出。</p>
P42 十五、集合计划存续期间,委托人的参与和退出	<p>4. 退出的数额限制</p> <p>每次退出的最低份额为 1,000 份,委托人可将其部分或全部集合计划份额退出。部分退出时,退出份额必须是 1,000 份的整数倍。当委托人在某一销售机构处持有的份额小于 1,000 份时,该部分份额将被强制退出。</p>	<p>4. 退出的数额限制</p> <p>每次退出的最低份额为 1,000 份,委托人可将其部分或全部集合计划份额退出。当委托人在某一销售机构处持有的份额小于 1,000 份时,该部分份额将被强制退出。</p>
P45 十七、集合计划的展期	<p>(一) 集合计划展期的条件</p> <p>1. 本集合计划存续期为 5 年,存续期满后经中国证监会批准可以展期。</p> <p>2. 本集合计划如经中国证监会事先核准并满足下列条件后即可展期:</p> <p>(1) 本集合计划运作情况良好,未发生重大违法违规情况;</p> <p>(2) 本集合计划期满后的第一个工作日满足集合计划成立条件;</p> <p>(3) 中国证监会规定的其他条件。</p> <p>(二) 集合计划展期的方式、程序和期限</p> <p>1. 展期方式和程序</p> <p>在符合展期条件的基础上,管理人将根据以下方式 and 程序安排展期:</p> <p>(1) 集合计划存续期届满且符合展期条件拟展期时,管理人应当至少在届满前三个月向中国证监会提出展期申请。在管理人向中国证监会提出展期申请期间,委托人可按照集合资产管理合同的约定退出。</p> <p>(2) 集合计划展期申请经中国证监会核准后,集合计划可以展期。管理人在收到中国证监会核准文件后五个工作日内在管理人网站公告,并将按照集合资产管理合同的约定通知客户。在集合计划届满前集合计划参与退出业务正常开展。若委托人不同意展期,委托人有权在存续期届满日前(含届满日)到推广机构办理退出手续;若委托人同意展期,应在存续期届满日前(不含届满日)到推广机构重新签署集合资产管理合同。截至存续期届满日,委托人未给出明确答复的,视为不同意展期,推广机构将按合同规定在存续期届满日,为委托人办理退出手续。</p> <p>(3) 经证监会核准展期,集合计划存续期届满,集合计划符合成立条件和展期条件,管理人进行集合计划展期公告。集合计划展期后 5 日内,管理人需将展期情况报</p>	<p>本集合计划无固定存续期限,无展期安排。</p>

	<p>管理人注册地中国证监会派出机构备案。</p> <p>（4）若集合计划的展期申请未获得中国证监会核准，或者不符合集合计划成立条件或展期条件，集合计划展期失败，集合计划进入清算终止程序。</p> <p>2. 展期期限：</p> <p>本计划展期期限原则上与本计划的存续期相同。</p>	
P45 十八、集合计划的终止和清算	<p>（一）集合计划应当终止的情形</p> <p>当出现以下情形时，本集合计划将终止：</p> <p>1. 集合计划存续期届满且不再展期；</p> <p>2. 集合计划管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格而导致集合资产管理计划终止；</p> <p>3. 集合计划管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责而导致集合资产管理计划终止；</p> <p>4. 不可抗力发生导致本集合计划不能存续；</p> <p>5. 集合计划委托人数量少于 2 人；</p> <p>6. 法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。</p>	<p>（一）集合计划应当终止的情形</p> <p>当出现以下情形之一时，本集合计划将终止：</p> <p>1. 集合计划管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格而导致集合资产管理计划终止；</p> <p>2. 集合计划管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责而导致集合资产管理计划终止；</p> <p>3. 不可抗力发生导致本集合计划不能存续；</p> <p>4. 集合计划委托人数量少于 2 人；</p> <p>5. 法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况；。</p> <p>6. 管理人认为必要时可以终止本计划。</p> <p>当本集合计划因终止情形中第 6 条终止时，管理人应当在计划终止日前至少 15 个工作日在管理人网站上公告并在公告后 2 个工作日内向中国证券业协会报备并抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p>
P46 十八、集合计划的终止和清算	<p>（三）集合计划清算的相关事宜</p> <p>1. 集合计划终止后 5 个工作日内向中国证监会及注册地中国证监会派出机构报告；</p> <p>2. 清算小组统一接管集合计划资产；</p> <p>3. 清算小组对集合计划资产进行清理和确认、评估和变现；</p> <p>4. 在清算结束后 15 日内，将集合计划清算结果报备注册地中国证监会派出机构；</p> <p>5. 在报备注册地中国证监会派出机构后 3 个工作日内披</p>	<p>（三）集合计划清算的相关事宜</p> <p>1. 计划终止后 5 个工作日内开始清算</p> <p>2. 清算小组统一接管集合计划资产；</p> <p>3. 清算小组对集合计划资产进行清理和确认、评估和变现；</p> <p>4. 清算结束后 15 日内，将清算结果报中国证券业协会备案，同时抄送住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构。</p> <p>5. 清算报告披露后 5 个工作日内对清算资产进行分配。</p>

	<p>露清算报告；</p> <p>6. 清算报告披露后 5 个工作日内对清算资产进行分配。</p>	
P51 二十一、风险揭示及其相应风险防范措施	<p>6. 集合计划虽然设置风险补偿条款，但仅补偿自计划成立时参与、持有计划份额满两年及两年以上的客户，并且存在无法提取风险补偿金或风险补偿金不足补偿委托人的风险。</p>	<p>删除该部分，其后部分序号自动向前调整</p>
P51 二十一、风险揭示及其相应风险防范措施	<p>7. 担任集合资产管理计划管理人的证券公司，因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能给委托人带来一定的风险。</p>	<p>7. 担任集合资产管理计划管理人的证券公司、集合资产管理计划的资产托管机构，因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能给委托人带来一定的风险。</p>
二十一、风险揭示及其相应风险防范措施 P53	<p>8. 其他风险</p> <p>（1）技术风险：在集合资产管理计划的日常交易中，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管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等等。</p> <p>（2）操作风险：管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。</p> <p>（3）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，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。</p>	<p>7. 其他风险</p> <p>（1）技术风险：在集合资产管理计划的日常交易中，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管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等等。</p> <p>（2）操作风险：管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。</p> <p>（3）电子合同签约风险本集合计划采用经中登等中国证监会认可的机构验证的电子合同签约方式，同所有网上交易一样存在操作的风险。</p> <p>（4）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，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。</p>

附件三：合同变更前后风险揭示书条款变更对照表

页码	变更前	变更后
P3	七、担任集合资产管理计划管理人的证券公司，因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能给委托人带来一定的风险。	七、担任集合资产管理计划管理人的证券公司、 集合资产管理计划的资产托管机构 ，因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能给委托人带来一定的风险。
P3	<p>八、其他风险</p> <p>1. 技术风险：在集合资产管理计划的日常交易中，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管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等等。</p> <p>2. 操作风险：管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。</p> <p>3. 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，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。</p>	<p>八、其他风险</p> <p>1. 技术风险：在集合资产管理计划的日常交易中，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管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等等。</p> <p>2. 操作风险：管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险。</p> <p>3. 电子合同签约风险 本集合计划采用经中登等中国证监会认可的机构验证的电子合同签约方式，同所有网上交易一样存在操作的风险。</p> <p>4. 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，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。</p>