

关于东方红-新睿 2 号二期集合资产管理计划 变更条款相关事项的公告

因相关法律法规变更，根据《证券公司客户资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券公司客户资产管理业务规范》（以下简称《业务规范》），我司拟对东方红-新睿 2 号二期集合资产管理计划的相关条款进行变更，说明书、托管协议、风险揭示书等相关内容一并调整。《东方红-新睿 2 号二期集合资产管理合同》条款具体修改和流程如下：

东方红-新睿 2 号二期集合资产管理合同修改对照明细表

序号	位置	原条款	现条款			
1	二、释义	推广机构：指东方证券股份有限公司和中国工商银行股份有限公司，以及其他具有集合计划代理推广资格、依据有关《代理推广协议》办理集合计划认购、申购、退出、分红等集合计划业务的代理机构。	推广机构：指东方证券股份有限公司、中国工商银行股份有限公司、上海东方证券资产管理有限公司，以及其他具有集合计划代理推广资格、依据有关《代理推广协议》办理集合计划认购、申购、退出、分红等集合计划业务的代理机构。			
2	四(十)本集合计划的推广	1、推广机构：本集合计划推广机构为东方证券及工商银行。管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的推广机构代理销售本集合计划。	1、推广机构：本集合计划推广机构为东方证券、工商银行、东证资管。管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的推广机构代理销售本集合计划。			
3	四(十一)本集合计	5、业绩报酬： <table border="1" style="display: inline-table; vertical-align: middle;"> <tr> <td>年化收益</td> <td>计提</td> <td>业绩报酬(H)计算方法</td> </tr> </table>	年化收益	计提	业绩报酬(H)计算方法	5、业绩报酬：详见本合同第十二部分
年化收益	计提	业绩报酬(H)计算方法				

	划的各项费用	率(R)	比例	
		$R \leq 5\%$	0	$H = 0$
		$5\% < R \leq 8\%$	20%	$H = (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360}$
		$R > 8\%$	25%	$H = [E + (R - 8\%) \times 25\%] \times C \times F \times \frac{D}{360}$
4	十二 (三) 管理人的业绩报酬	<p>1、管理人收取业绩报酬的原则</p> <p>(1) 按委托人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p>(2) 符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红日、委托人退出日和集合计划终止日计提业绩报酬。</p> <p>(3) 集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。在委托人退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。</p>		<p>1、管理人收取业绩报酬的原则</p> <p>(1) 按委托人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p>(2) 符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红日、委托人退出日和集合计划终止日计提业绩报酬。</p> <p>(3) 集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。在委托人退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。</p> <p>(4) 委托人在集合计划分红日退出的，退出份额按照退出时应计提的业绩报酬金额计提业绩报酬。</p>
5	十二 (三) 管理人的业绩报酬	<p>2、业绩报酬的计提方法</p> <p>业绩报酬计提日为本集合计划分红日、委托人退出日或本集合计划终止日。以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与当日）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率R，作为计提业绩报酬的基准。</p>		<p>2、业绩报酬的计提方法</p> <p>业绩报酬计提日为本集合计划分红日、委托人退出日或本集合计划终止日。每份集合计划份额的业绩报酬以该笔份额参与日（推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与当日）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率R，作为计提业绩报酬的基准。</p> $R = \frac{A - B}{C} \times \frac{360}{D} \times 100\%$ <p>A为业绩报酬计提日的累计单位净值；</p>

$$R = \frac{A - B}{C} \times \frac{360}{D} \times 100\%$$

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；

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法
$R \leq 5\%$	0	$H = 0$
$5\% < R \leq 8\%$	20%	$H = (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360}$
$R > 8\%$	25%	$H = [E + (R - 8\%) \times 25\%] \times C \times F \times \frac{D}{360}$

注：F为提取业绩报酬的份额。

$$E = (8\% - 5\%) \times 20\% = 0.6\%$$

B为该笔份额参与日的累计单位净值；

C为该笔份额参与日的单位净值；

D为该笔份额参与日与本次业绩报酬计提日间隔天数；

(1) 分红日提取业绩报酬

分红日提取业绩报酬的，按该笔集合计划份额的年化收益率计算，可提取的业绩报酬如下：

年化收益率 (R)	计提比例	H1计算方法
$R \leq 5\%$	0	$H1 = 0$
$5\% < R \leq 8\%$	20%	$H1 = \max(0, (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$
$R > 8\%$	25%	$H1 = \max(0, [E + (R - 8\%) \times 25\%] \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$

$$\text{注：} E = (8\% - 5\%) \times 20\% = 0.6\%$$

管理人在分红日提取的业绩报酬不应超过该笔份额本次分红金额的20%，故业绩报酬上限如下：

$$H2 = Div \times F \times 20\%$$

注：Div为本次分红日每份分红金额

F为该笔提取业绩报酬的份额。

因此，管理人提取业绩报酬的实际金额为：

			<p>业绩报酬 $H = \min(H1, H2)$</p> <p>(2) 委托人退出日或集合计划终止日提取业绩报酬 退出日或集合计划终止日提取业绩报酬的, 该笔集合计划份额提取的业绩报酬如下:</p> <table border="1" data-bbox="1024 479 1929 937"> <thead> <tr> <th>年收益率 (R)</th> <th>计提比例</th> <th>业绩报酬 (H) 计算方法</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R \leq 5\%$</td> <td>0</td> <td>$H = 0$</td> </tr> <tr> <td>$5\% < R \leq 8\%$</td> <td>20%</td> <td>$H = \max(0, (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$</td> </tr> <tr> <td>$R > 8\%$</td> <td>25%</td> <td>$H = \max(0, [E + (R - 8\%) \times 25\%] \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$</td> </tr> </tbody> </table> <p>注: $E = (8\% - 5\%) \times 20\% = 0.6\%$</p>	年收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法	$R \leq 5\%$	0	$H = 0$	$5\% < R \leq 8\%$	20%	$H = \max(0, (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$	$R > 8\%$	25%	$H = \max(0, [E + (R - 8\%) \times 25\%] \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$
年收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H) 计算方法													
$R \leq 5\%$	0	$H = 0$													
$5\% < R \leq 8\%$	20%	$H = \max(0, (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$													
$R > 8\%$	25%	$H = \max(0, [E + (R - 8\%) \times 25\%] \times C \times F \times \frac{D}{360} - \text{该笔份额存续期间已计提的业绩报酬总额})$													
6	十三 (三) 收益分配原则	4、在符合上述原则的前提下, 本集合计划成立满六个月后, 每年12月31日之前至少分配1次	无												

7	十七 (三) 1、定期 报告	<p>(5) 对账单。</p> <p>管理人应按照有关法律法规的规定编制对账单,对计划的差异性、风险,委托人持有计划份额的数量及净值,最近一期的参与、退出明细,以及收益分配等情况作出说明,并于本计划成立日、每季度末以及分红日起的 15 个工作日内向委托人寄送。对账单的寄送形式为邮寄或电子邮件,委托人可以选择寄送方式,默认的寄送方式为电子邮件。</p>	<p>(5) 对账单。</p> <p>管理人应按照有关法律法规的规定编制对账单,对委托人持有计划份额的数量及净值,参与、退出明细,以及收益分配等情况作出说明,在每个季度结束后向委托人提供。对账单的提供形式为邮寄或电子形式,委托人可以选择提供方式,默认的提供方式为电子形式(管理人将根据实际情况选择使用电子邮件、手机信息、管理人网站服务等方式)。</p>
8	二十四 (五) 本集合 计划特 有风险	<p>3、本集合计划存续期间,当计划的委托人少于 2 人,或者连续 20 个工作日计划的资产净值低于 1 亿元人民币时,集合计划将终止。委托人可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险。</p>	<p>3、本集合计划存续期间,当计划的委托人少于 2 人,或者连续 20 个工作日计划的资产净值低于 1 亿元人民币时,集合计划将终止。若委托人某笔退出导致其在某推广机构持有的集合计划份额少于 1000 份,则余额部分必须一起退出。委托人可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险。</p>
9	二十四 (五) 本集合 计划特 有风险	<p>4、本集合计划合同变更时,管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。另外,管理人需在公告后两个工作日内向委托人邮寄合同变更征询意见函。委托人不同意变更的,应在征询意见函发出后的最近一个开放期内提出退出申请,未提出退出申请的,视同委托人已经同意合同变更;若委托人未对合同变更事项表态,也未在在征询意见函发出后的最近一个开放期内提出退出申请的,视同委托人已经同意合同变更。合同变更于该开放期结束后的第一个工作日开始生效。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,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计划,可能会被视为同意合同变更,从而存在风险。</p>	<p>4、本集合计划合同变更时,管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。另外,管理人须在公告后两个工作日内向委托人邮寄合同变更征询意见函。委托人不同意变更的,委托人应在征询意见函发出后十五个工作日内提出退出申请,未提出退出申请的,视同委托人已经同意合同变更,合同变更于公告日起二十个工作日后生效。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,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计划,可能会被视为同意合同变更,从而存在风险。</p>

根据《东方红-新睿2号二期集合资产管理合同》的约定，我司将在公告后两个工作日内向投资者邮寄合同变更征询意见函。投资者不同意变更的，应在征询意见函发出后十五个工作日内（即2014年4月16日至2014年5月8日）提出退出申请，未提出退出申请的，视同投资者已经同意合同变更，合同变更于公告日起二十个工作日后（即2014年5月14日）生效。

感谢广大投资者一直以来给予的关注和支持！如有任何疑问，请致电021-95503。

上海东方证券资产管理有限公司

2014年4月11日

