

# 关于华金鸿腾 2 号集合资产管理计划合同变更的公告

尊敬的投资者：

由我司作为管理人，兴业银行股份有限公司作为托管人的华金鸿腾 2 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2018 年 12 月 26 日成立。现管理人与托管人一致同意，拟对《华金鸿腾 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资管合同”）进行变更（统称为“合同变更”），具体内容如下：

变更前	变更后
<b>二、释义</b>	
<p><b>封闭期：</b>指集合计划成立日后的一个或多个封闭区间，封闭期内不办理参与和退出业务，管理人设置临时开放期的情况除外。</p> <p><b>管理人业绩报酬（如有）：</b>管理人在本集合计划的每个封闭期期末和集合计划的终止日，管理人按照一定的原则对相关的集合计划份额提取的业绩报酬。</p>	<p><b>封闭期：</b>指集合计划成立日后的一个或多个封闭区间，封闭期内不办理参与和退出业务。</p> <p><b>管理人业绩报酬（如有）：</b>管理人在本集合计划的份额退出日和集合计划的终止日，管理人按照一定的原则对相关的集合计划份额提取的业绩报酬。</p>
<b>四、集合资产管理计划的基本情况</b>	
<p><b>（六）封闭期、开放期及流动性安排：</b></p> <p>1、<b>封闭期</b> 本集合计划成立之日起原则上每满 6 个月开放一次，封闭期内不办理参与、退出业务。</p> <p>2、<b>开放期</b> 本集合计划每个封闭期结束之后的第一个工作日进入开放期，开放期的具体时间的由管理人在每一开放期前在管理人网站予以公告，委托人可在开放期申请参与或退出本计划。</p> <p>3、<b>特别开放期</b> 指合同变更需要，为不同意合同变更的委</p>	<p><b>（六）封闭期、开放期及流动性安排：</b></p> <p>1、<b>封闭期</b> 本集合计划在存续期内除开放期之外的每个交易日都是封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。</p> <p>2、<b>开放期</b> 本集合计划自成立之日每个月开放一次，委托人可在开放期内办理参与或退出业务，具体开放安排以管理人公告为准。每一笔赎回份额需满足锁定期满 6 个月（含）的条件后方可在开放日申请退出。</p> <p>3、<b>锁定期</b> 本集合计划锁定期为每一笔份额确认后的 6 个</p>

<p>托人退出而设置的开放期，具体见管理人公告。</p> <p>4、流动性安排 管理人将在集合计划开放退出期内保留7个工作日可变现的资产，不低于该计划资产净值的10%。</p>	<p>月（含）。自份额确认之日起每满6个月之对应日为锁定期到期日，如遇节假日则顺延至下一交易日。</p> <p>4、特别开放期 指合同变更需要，为不同意合同变更的委托人退出而设置的开放期，具体见管理人公告。</p> <p>5、流动性安排 管理人将在集合计划开放退出期内保留7个工作日可变现的资产，不低于该计划资产净值的10%； 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在本集合计划开放退出期不得超过本集合计划净资产的20%。</p>
<p>五、集合计划的参与和退出</p>	
<p>(二) 集合计划的退出</p> <p>1、退出的办理时间 本集合计划每个封闭期结束之后的第一个工作日进入开放期，开放期的具体时间由管理人在每一开放期前在管理人网站予以公告，委托人可在开放期申请退出本计划。 在基于合同变更设置的特别开放期内，不同意合同变更的委托人可在特别开放期退出，具体见管理人公告；”</p> <p>4、退出费及退出金额的计算</p> <p>(1) 退出费用：0</p> <p>(2) 退出金额的计算方法 本集合计划退出时以申请退出日的计划单位净值作为计价基准，按扣除退出费后的实际金额支付。退出金额的计算公式如下： 退出总额=退出当日计划单位净值×退出份额 退出净额=退出总额—退出费 上述计算结果均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损益。退出费由委托人承担，不列入集合计划资产。</p>	<p>(二) 集合计划的退出</p> <p>1、退出的办理时间 本集合计划每个月开放一次，具体开放安排以管理人公告为准。开放期内统一办理委托人有效的退出申请。每一笔赎回份额需满足锁定期满6个月（含）的条件后方可在开放期申请退出。 在基于合同变更设置的特别开放期内，不同意合同变更的委托人可在特别开放期退出，具体见管理人公告。</p> <p>4、退出费及退出金额的计算</p> <p>(1) 退出费用：0</p> <p>(2) 退出金额的计算方法 本集合计划退出时以申请退出日的计划单位净值作为计价基准，按扣除退出费和业绩报酬后的实际金额支付。退出金额的计算公式如下： 退出总额=退出当日计划单位净值×退出份额 退出净额=退出总额—退出费—业绩报酬 上述计算结果均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损益。退出费由委托人承担，不列入集合计划资产。</p>
<p>十二、集合计划的估值</p>	
<p>(七) 估值方法</p> <p>1、债券估值方法</p> <p>(1) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p>	<p>(七) 估值方法</p> <p>1、债券估值方法</p> <p>(1) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p>



<p>(2) 在证券交易所市场交易的债券,按中证指数有限公司提供的债券估值数据进行估值。</p> <p>(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。</p> <p>(4) 对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券,采用估值技术确定的公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。</p> <p>(5) 在对银行间市场的固定收益品种估值时,应主要依据中央国债登记结算公司公布的收益率曲线及估值价格。</p> <p>(6) 对在银行间市场上市交易的资产支持证券,应主要依据中央国债登记结算公司公布的收益率曲线及估值价格估值。对未在银行间市场上市交易且中债登公司未提供价格的,按成本估值。对在交易所上市的资产支持证券品种,鉴于其交易不活跃,各产品的未来现金流也较难确认的,按成本估值。</p> <p>3、货币市场基金的估值方法 货币市场基金按照该基金公布的每万份收益逐日计提收益。</p> <p>5、证券正回购的估值方法 证券正回购以成本列示,按约定利率逐日确认利息收入。</p>	<p>(2) 在证券交易所市场交易的债券,应主要按中证指数有限公司提供的债券估值数据进行估值,私募债按成本估值。</p> <p>(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。</p> <p>(4) 在银行间市场交易的债券应主要依据中央国债登记结算公司公布的收益率曲线及估值价格,非公开定向债务融资工具按成本估值。</p> <p>(5) 对在银行间市场上市交易的资产支持证券,应主要依据中央国债登记结算公司公布的收益率曲线及估值价格估值。对未在银行间市场上市交易且中债登公司未提供价格的,按成本估值。对在交易所上市的资产支持证券品种,鉴于其交易不活跃,各产品的未来现金流也较难确认的,按成本估值。</p> <p>3、货币市场基金的估值方法 货币市场基金按照该基金公布的前一交易日每万份收益逐日计提收益。</p> <p>5、证券正回购的估值方法 证券正回购以成本列示,按约定利率逐日确认利息支出。</p>
<p>十三、集合计划的费用、业绩报酬和税收</p>	
<p>(三) 管理人的业绩报酬</p> <p>1、业绩报酬计提原则: 管理人在本集合计划的每个封闭期末和集合计划的终止日计提业绩报酬。管理人对期间份额年化收益率超过当期业绩报酬计提基准的部分的 50%计提为管理人的业绩报酬。业绩报酬从份额中扣减。</p> <p>本集合计划于推广期或开放期前公告下一封闭期的业绩报酬计提基准。</p> <p>2、业绩报酬计提的方法: 若集合计划每个封闭期期初至集合计划该封闭期期末或集合计划的终止日的期间份额年化收益率超过管理人公告</p>	<p>(三) 管理人的业绩报酬</p> <p>1、业绩报酬计提原则: 管理人在集合计划的份额退出日和集合计划的终止日计提业绩报酬。管理人对期间份额年化收益率超过当期业绩报酬计提基准的部分的 50%计提为管理人的业绩报酬。业绩报酬从份额中扣减。</p> <p>本集合的业绩基准根据市场变化进行调整,具体以管理人公告为准。</p> <p>2、业绩报酬计提的方法: (1) 集合计划份额年化收益率 <math>R_i</math> 的计算公式;</p> $R_i = \frac{A_i - B_i}{B_i} \times \frac{365}{T_i} \times 100\%$





的当期业绩报酬计提基准，则管理人对份额年化收益率超过该业绩报酬计提基准的部分的 50%计提为管理人业绩报酬。

(1) 期间份额年化收益率计算公式：

$$R_i = \frac{A_i - B_i}{B_i} \times \frac{365}{T_i} \times 100\%$$

R<sub>i</sub> 为集合计划每个封闭期期初至集合计划该封闭期末或集合计划终止日的期间份额年化收益率；

A<sub>i</sub> 为每个封闭期末或集合计划的终止日本集合计划的累计单位净值；

B<sub>i</sub> 为该封闭期期初的累计单位净值；

T<sub>i</sub> 该封闭期实际天数；

R<sub>i</sub> 的计算在百分号内保留两位小数。

(2) 期间业绩报酬计提计算公式：

$$Y_i = F_i \times C_i \times (R_i - K_i) \times \frac{T_i}{365} \times 50\%$$

F<sub>i</sub> 为计提业绩报酬当天的份额余额；

C<sub>i</sub> 为封闭期期初的单位净值；

K<sub>i</sub> 为当期的业绩报酬计提基准；

Y<sub>i</sub> 的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

① 若封闭期期间的份额年化收益率大于管理人公告的当期业绩报酬计提基准，则管理人对份额年化收益率超过该业绩报酬计提基准的部分 50%计提为管理人的业绩报酬。

② 若封闭期期间的份额年化收益率小于或等于管理人公告的当期业绩报酬计提基准，则管理人不计提业绩报酬。

因涉及注册登记数据，托管人对业绩报酬不进行复核，由管理人计算，托管人仅根据划款指令进行支付。

A<sub>i</sub> 为业绩报酬计提日集合计划的份额累计单位净值；

B<sub>i</sub> 为集合计划份额参与时的累计单位净值；

T<sub>i</sub> 为集合计划份额的期间经历天数；

R<sub>i</sub> 的计算在百分号内保留两位小数。

(2) 集合计划业绩报酬 Y<sub>i</sub> 计提计算公式：

$$Y_i = F_i \times C_i \times (R_i - K_i) \times \frac{T_i}{365} \times 50\%$$

F<sub>i</sub> 为集合计划的份额；

C<sub>i</sub> 为参与时集合计划份额的单位净值；

K<sub>i</sub> 为当期的业绩报酬计提基准；

Y<sub>i</sub> 的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

因涉及注册登记数据，托管人对业绩报酬不进行复核，由管理人计算，托管人仅根据划款指令进行支付。

根据合同第二十六章合同的补充、修改与变更中的约定：由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致，并通过在管理人网站公告的形式向委托人征求意见。委托人不同意变更的，应在管理人设置的特别开放期退出本集合计划的申请；委托人未在 5 个交易日内回复意见的，视为委托人同意。具体合同变更流程将按照变更前的合同进行。特别开放期安排将会在管理人官网另行公告。

就华金鸿腾 2 号集合资产管理计划本次变更，管理人与托管人已达成书面一致。本公告于 2019 年 3 月 15 日在管理人网站公告的形式向委托人征求意见。在公告满 5 个交易日后，变更后的华金鸿腾 2 号集合资产管理计划资产管理合同将于 2019 年 3 月 22 日生效。

特此公告！



