

华金鸿腾年年盈集合资产管理计划 合同变更的公告

尊敬的华金鸿腾年年盈集合资产管理计划投资者：

我公司作为华金鸿腾年年盈集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)的管理人，在与托管人协商后，对关于华金鸿腾年年盈集合资产管理计划资产管理合同(以下简称“合同”)内容做了修改，主要修改内容如下：

一、开放期

原合同表述为：“本集合计划自成立之日起封闭运作，首个封闭期不超过2个月，封闭期满后的首个开放日以管理人公告为准。此后本集合计划每个月开放一次，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。”

现调整为“本集合计划自成立之日起封闭运作，首个封闭期不超过2个月，封闭期满后的首个开放日以管理人公告为准。此后本集合计划每个月开放一次，每次开放三个交易日，其中每月15日为起始开放日(如遇节假日均顺延至下一交易日)，委托人可在开放期内办理参与或退出业务。”

二、业绩报酬计提基准

1、原合同表述为：

“1、业绩报酬计提原则：

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。

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。

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_i 为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终止日的期间份额年化收益率；

A_i 为每个封闭期期末或集合计划的终止日本集合计划的累计单位净值；

B_i 为该封闭期期初的累计单位净值；

T_i 该封闭期实际天数；

R_i 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_i 为计提业绩报酬当天的份额余额；



C_i 为封闭期期初的单位净值；

K_i 为当期的业绩报酬计提基准；

Y_i 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。

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。

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。”

现调整为：

“1、业绩报酬计提原则：

管理人在集合计划收益分配日、份额退出日和计划终止日计提业绩报酬。业绩报酬采取分段计提的方式。

本集合计划业绩报酬计提基准将另行公告，业绩报酬计提基准变更后，将于下一结算周期生效。

结算周期：(1) 集合计划成立日(含)至第 1 次业绩报酬计提基准变更日的前 1 日(含)的期间；(2) 集合计划第 1 个业绩报酬计提基准变更日(含)至第 2 次业绩报酬计提基准变更日的前 1 日(含)的期间，依此类推。

2、业绩报酬计提方法

管理人对委托人上一发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日(若上一发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日或份额参与日)至本次业绩报酬计提日所涵盖的结算周期分段计算业绩报酬(“分段业绩报酬”)。管理人对每个结算周期中份额年化收益超过当期业绩报酬计提基准部分的 60% 计提为管理人的业绩报酬。

(1) 委托人每个结算周期年化收益率 R 的计算公式：

$$R = \frac{A - P}{P'} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

R 为集合计划本次结算周期的期间份额年化收益率；

A 为集合计划本次结算周期期末的累计单位净值；

P 为集合计划成立日或份额参与日或上一结算周期期末的累计单位净值；

P' 为集合计划成立日或份额参与日或上一结算周期期末的单位净值

T 为集合计划成立日或份额参与日或上一结算周期期末至本次结算周期期末的实际天数；

R 的计算在百分号内保留两位小数。

(2) 委托人每个结算周期业绩报酬计提计算公式：

年化收益率	提取比例	业绩报酬公式
$R \leq B$	0	0
$R > B$	60%	$Y = Q \times P' \times (R - B) \times 60\% \times T / 365$

其中：

B 为业绩报酬计提基准；

Q 为集合计划的份额；

R 为 Q 的期间年化收益率；

Y 为业绩报酬；

P'为集合计划成立日或份额参与日或上一结算周期期末的单位净值

本次业绩报酬计提日的业绩报酬为本次业绩报酬计提期间内各结算周期的分段业绩报酬之和。”

三、业绩比较基准

原合同无相关表述。

现新增为：“本资管计划业绩比较基准为：过去三个月，由全国银行间同业拆借中心授权公布的一年期贷款市场报价利率（LPR），取算术平均值，加（0.3%至0.8%）。

其中，全国银行间同业拆借中心授权公布的贷款市场报价利率（LPR），由18家报价行于每月20日向全国银行间同业拆借中心提交报价，同业拆借中心去掉最高和最低报价后算术平均，向0.05%的整数倍就近取整计算得出，于当日9时30分公布。各报价行在公开市场操作利率的基础上加点报价，市场化、灵活性特征将更加明显。公开市场操作利率主要指1年期中期借贷便利（MLF）利率，反映了银行平均的边际资金成本，加点幅度则主要取决于各行自身资金成本、市场供求、风险溢价等因素。报价行不仅包括了10家全国性银行，也包括城市商业银行、农村商业银行、外资银行和民营银行各2家，共18家。报价行都是在同类型银行中贷款市场影响力较大、贷款定价能力较强、服务小微企业效果较好银行，能够有效增强LPR的代表性。

本产品主要投资标的为高等级、中短期期限的信用债，管理人认为这类信用债的票面利率与人民银行公布的贷款市场报价利率（LPR）有较大的相关性，故将本产品的业绩比较基准确定为过去三个月LPR利率（1年期）的算术平均值，加（0.3%至0.8%）。

本资管计划业绩比较基准“过去三个月，由全国银行间同业拆借中心授权公布的一年期贷款市场报价利率（LPR），取算术平均值，加（0.3%至0.8%）”，目前能够忠实地反映本资管计划的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本资管计划的业绩基准时，本资管计划可以变更业绩比较基准，但应与投资者、托管人协商一致，在履行适当程序后报监管机构或行业协会备案。

管理人特别声明：业绩比较基准不是预期收益和保证收益率。投资者承认，资产管理合同所约定的业绩比较基准不构成管理人、托管人对委托财产收益状况的任何承诺或担保。在某些情况下，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。”

四、投资集中度

原合同表述为：“2、集合计划投资于单只债券不超过集合计划净值的20%；”

现调整为：“2、集合计划投资于单只债券不超过集合计划净值的25%；”

删除原合同第十七章、投资限制及禁止行为中的约定：“本集合计划的建仓期不受上



述第 2 项的限制。”

五、管理费支付方式

原合同表述为：“管理人的管理费每日计算，逐日计提，按自然季支付，每自然季度结束之日起【5】个交易日内由管理人向托管人发送当个自然季度管理费划付指令，托管人复核后于【5】个交易日内从集合计划资产中一次性扣除支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。”

现调整为：“管理人的管理费每日计算，逐日计提，自然季支付，托管人根据与管理人核对一致的财务数据，按照本协议约定的管理费计算方式计算并于每自然季度结束之日起第 5 个交易日自托管账户自动扣划管理费，管理人无需再出具资金划拨指令。如遇托管账户资金余额不足的，托管人可待托管账户有资金时再划扣。费用自动划扣后，托管人应向管理人告知管理费支付金额及计算方式，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。”

以上为合同主要修改内容，详细内容请见附件合同。本集合计划风险揭示书及计划说明书中的内容根据上述条款做相应变更。

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投资者征求意见。

投资者不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利，管理人可在临时开放期为投资者办理退出集合计划的业务；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人有权在公告中说明的回复期限届满后，将其份额强制退出集合计划，由此发生的相关税费或或有损失由投资者自行承担。投资者未在管理人指定期限内回复意见的，视为投资者同意。

合同变更生效日以管理人公告为准。集合计划份额的退出价格为退出当日集合计划单位净值。投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或认定为管理人的违约行为。”

本公告于 2020 年 7 月 7 日由管理人以网站公告的形式向投资者征求意见，投资者不同意变更的，应在征询意见发出的 5 个工作日内提出退出本集合计划的申请，即于 2020 年 7 月 13 日（含）前以邮件形式发送姓名+证件类型+证件号码+“不同意华金鸿腾年年盈集合资产管理计划合同变更”至管理人邮箱 ningpengfei@huajinsc.cn、tianjing@huajinsc.cn，管理人将设置特别开放期，仅为不同意合同变更的客户办理赎回业务，特别开放期安排将另行公告。在本公告满 5 个工作日后，变更后的华金鸿腾年年盈集合资产管理计划资产管理合同将于 2020 年 7 月 14 日生效。

特此公告！

