

关于国泰君安集合资产管理计划第一号—— 君得利一号货币增强集合资产管理计划 合同变更的公告

时间：2021-09-15

尊敬的各位委托人：

国泰君安集合资产管理计划第一号——君得利一号货币增强集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“君得利一号”）成立于2005年10月11日，为了持续服务广大投资者，满足广大投资者的投资需求。根据《国泰君安集合资产管理计划第一号——君得利一号货币增强集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《管理合同》）第二十部分第一款“本合同生效后，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进行变更，并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划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网站公告满5个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有明确异议的，可在更新或修改内容生效前按照管理人公告的安排申请退出本集合计划。未在上述期间提出明确异议或申请退出本集合计划的，视为同意，管理人不再另行通知”的约定，管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司（以下简称“我司”）已就君得利一号合同变更事宜获得托管人的同意，变更生效后将按照相关规定向相关监管机构进行报备。

本次合同变更主要修改：

	原条款	更改后条款	备注
管理合同第三部分第（三）条	1、投资范围 本集合计划将投资于银行存款，债券逆回购，货币市场基金，剩余期限不超过3年的固定收益类投资品种，一级市场申购以及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。 其中，固定收益投资品种包括但不限于国债、政策性金融债、央行票据、高信用等级的短期融资券、金融机构债券、企业债、公司债等债券类资产；一级市场申购范	1、投资范围 本集合计划投资于流动性良好的金融工具，包括债券（国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包含协议存款、定期存款及其他银行	相关条款一并调整

	<p>围包括新股申购（IPO 询价新股、网上申购新股、市值配售新股等）以及新债申购（可分离交易债券、可交换债券、可转换债券和期限不超过 5 年的债券等固定收益类品种），不得参与股票、可分离交易债券、可交换债券、可转换债券和剩余期限超过 3 年的固定收益类等品种的二级市场买入行为。</p>	<p>存款）、货币市场工具、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。</p> <p>本集合计划不参与股票等资产的投资，不参与可转换债券（可分离交易可转债中的纯债部分除外）、可交换债券的投资。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>	
<p>管理合同第三部分第（三）条</p>	<p>2、资产配置比例（市值占集合计划总资产）：</p> <p>（1）现金、银行存款、一年内到期的政府债券、期限在 7 天以内（含 7 天）的债券逆回购等现金类资产的投资比例不低于 5%；</p> <p>（2）债券回购、同业存单等货币市场工具：0%~95%；</p> <p>（3）剩余期限 1 年以上但不超过 3 年的银行定期存款和协议存款、各种短期债券：0%~70%；</p> <p>（4）货币市场基金：0%~95%；</p> <p>（5）新股（包括 IPO 询价新股、网上申购新股和市值配售新股等）：0%~10%；</p> <p>（6）债券远期交易：0%~30%；（托管人对此不予监控）</p> <p>（7）正回购：0%~40%；</p> <p>（8）因可转换公司债券、分离交易可转债转股形成的股票以及因分离交易的可转换公司债券产生的权证等权益类资产：0%~20%，其中因所持股票所派发的权证以及因投资可分离交易债券而产生的权证不超过 3%（托管人对以上内容不予监控），不从二级市场买入可转债、分离交易可转债、股票和权证。</p> <p>（9）其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。</p>	<p>本集合计划中各类资产的投资比例如下：</p> <p>1、现金、银行存款、一年内到期的政府债券、期限在 7 天以内（含 7 天）的债券逆回购等现金类资产的投资比例不低于 5%；</p> <p>2、债券回购、同业存单等货币市场工具：0~95%；</p> <p>3、正回购：0%~40%。</p>	<p>相关条款一并调整</p>
<p>管理合同第三部分第（四）条</p>	<p>（四） 存续期限</p> <p>本集合计划未约定存续期限，但若符合所约定的终止清算条件时，则直接进入终止清算程序。</p>	<p>（四） 存续期限</p> <p>本集合计划管理期限自合同变更生效后 10 年。</p>	
<p>管理合同第四部分第（三）条</p>	<p>4、本计划在推广期、存续期均无规模上限限制。</p>	<p>4、本计划在存续期无规模上限限制。</p>	
<p>管理合同第（四）条</p>	<p>（四） 参与价格</p>	<p>（四） 参与价格</p>	

<p>四部分第 (四)条</p>	<p>本集合计划的参与价格始终为每份壹元人民币。</p>	<p>在集合计划推广期内参与，参与价格为每份壹元人民币。 在集合计划存续期内参与，每份额的参与价格为当日份额净值。</p>	
<p>管理合同第 七部分</p>	<p>无</p>	<p>七、集合计划的资产估值</p> <p>(一) 资产总值</p> <p>本集合计划的资产总值是指用集合计划的资金购买的各类有价证券、银行存款、回购、货币市场基金、集合计划各项应收款以及其他投资所形成的价值总和。</p> <p>(二) 资产净值</p> <p>本集合计划的资产净值是指本集合计划的资产总值减去负债后的净资产值。</p> <p>(三) 估值目的</p> <p>本集合计划资产估值的目的是客观、准确地反映本集合计划资产的价值。经资产估值后确定的资产净值是本集合计划收益分配、收费等的基础和依据。</p> <p>(四) 估值对象</p> <p>运用本集合计划资金购买的各类有价证券、银行存款、回购、货币市场基金、集合计划各项应收款以及其他资产等。</p> <p>(五) 估值日</p> <p>本集合计划的估值日为存续期内每个正常工作日。 T日的集合计划估值结果在T+1日通告，如果T+1日为非工作日则顺延处理。</p> <p>(六) 估值方法</p> <p>本集合计划按以下方式进行估值：</p> <p>1、投资固定收益品种的估值方法</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) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（另有规定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；具体估值机构由管理人与托管人另行协商约定；</p> <p>3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去可转换债券收盘价中所含债券应收利息后得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交</p>	<p>增加</p>

易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日收盘价减去可转换债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

4) 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。

5) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

6) 中小企业私募债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；

7) 对在银行间市场上市交易的资产支持证券，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。对在交易所上市的资产支持证券品种，以交易所提供的价格估值。对于未上市的资产支持证券，按照成本进行估值。

2、投资证券投资基金的估值方法

1) 持有的交易所上市基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

2) 持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF))，按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；

3) 持有的货币市场基金及理财债券基金，按基金管理人公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利；

4) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。

3、存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

4、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值；

5、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值；

如管理人或托管人发现集合估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布。

6、暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其它原因暂停营业时，或因其它任何不可抗力致使管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。

7、管理人按以上估值方法的第1—5项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划单位资产净值错误处理。

（七）估值程序

日常估值由管理人负责完成，托管人进行复核。管理人完成估值后将估值结果加盖在托管人处预留印鉴后以书面形式交托管人，托管人按照本说明书规定的计价方法、时间与程序进行复核，复核无误后签章返回给管理人。月末、年中和年末计价复核与本集合计划会计账目的核对同时进行。

（八）错误与遗漏的处理

估值结果精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。

		<p>除本说明书另有规定外，当估值导致计划单位资产净值小数点后四位发生差错时视为集合计划单位资产估值错误。国家另有规定的，从其规定。管理人和托管人采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性和及时性。差错处理原则及方法如下：</p> <p>1、当管理人确认已经发生估值错误情形且估值误差超过 0.5%时，管理人立即通告、予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。</p> <p>2、由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或由于不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的估值错误，管理人、托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。</p> <p>3、当管理人与托管人计算的单位净值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的计算结果为准公告。由此给集合计划或集合计划委托人造成的损失由管理人承担赔偿责任，托管人不负赔偿责任。</p> <p>4、因资产收益率估值错误而给委托人造成损失的，管理人应当先承担赔偿责任。赔偿仅限于因差错而导致的委托人的直接损失。管理人在赔偿委托人后，有权向有关责任方追偿。</p> <p>前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。</p>	
<p>管理合同第九部分第（二）条</p>	<p>（二）分配原则</p> <p>1、每一份额享有同等收益分配权；</p> <p>2、分红以份额（红利再投资）形式进行；</p> <p>3、T 日申购的计划份额不享有当日分红权益，自下一工作日起享有分红权益；T 日赎回的计划份额享有当日分红权益，自下一工作日起不享有分红权益；</p> <p>4、法律、法规或中国证监会另有规定的从其规定。</p>	<p>（二）分配原则</p> <p>各方一致同意实施收益分配时应遵循以下原则：</p> <p>1、每一集合计划份额享有同等的分配权；</p> <p>2、集合计划当期收益应先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；</p> <p>3、本计划收益分配方式为现金分红；</p> <p>4、集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去集合计划份额分红金额后不能低于集合计划份额面值；</p> <p>5、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；</p>	

		<p>6、集合计划成立不满3个月可不进行收益分配；</p> <p>7、在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下进行收益分配，收益分配的相关事宜以管理人临时公告为准；</p> <p>8、红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日；</p> <p>9、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>	
<p>管理合同第九部分第（三）-（四）条</p>	<p>（三）分配方案</p> <p>本集合计划收益分配方案如下：</p> <p>1、本集合计划每日收益情况按如下方式计算：</p> $\text{每万份集合计划当日净收益} = (\text{当日集合计划净收益} / \text{当日集合计划总份额}) * 10000$ <p>上述收益的精度为0.0001元，小数点第五位采用去尾的方式，由此产生的未分配收益计入本集合的收益。</p> <p>2、本集合计划根据每日收益情况，将当日净收益全部分配给委托人，每一计划份额分配的收益相等。若当日净收益大于零，为委托人记正收益；若当日净收益小于零，为委托人记负收益；若当日净收益等于零，当日不为委托人记收益。</p> <p>3、本集合计划每日计算收益并分配，以人民币元方式簿记，每月累计收益支付方式采用红利再投资（即红利转计划份额）方式；若在每月累计收益支付时，累计收益为负值，则将缩减委托人的计划份额。委托人可通过退出计划份额获得现金收益。</p> <p>4、T日申购的计划份额不享有当日分红权益，T日退出的计划份额享有当日分红权益。</p> <p>5、在不影响委托人利益情况下，集合计划管理人可调整拟定新的收益分配方案，由托管人核实后确定，并通过推广代销网点、管理人网站通告委托人。</p> <p>（四）分配方式</p> <p>本集合计划收益分配以份额（红利再投资）的形式进行，每日计提，每月结转。具体情况见分配方案。</p>	<p>（三）收益分配方式</p> <p>本集合计划收益分配方式为现金分红。托管人根据管理人指令将分红款划入注册登记机构清算账户，再划入销售机构指定收款账户，最后由销售机构划入委托人账户。</p>	
<p>管理合同第十部分第（二）条</p>	<p>1、定期报告：包括集合计划盈利状况通告，集合计划管理季度、年度报告，托管季度、年度报告和年度审计意见。</p> <p>（1）集合计划盈利状况通告。每个开放日披露截止前</p>	<p>1、定期报告：包括集合计划净值披露，集合计划管理季度、年度报告，托管季度、年度报告和年度审计意见。</p> <p>（1）净值披露</p>	

	<p>一个开放日每万份计划的净收益及以最近七日收益所折算的年收益率状况。收益计算由管理人拟定，由托管人复核。</p> <p>每万份集合计划当日净收益 = (当日集合计划净收益 (及之前或有节假日) / 当日集合计划总份额) * 10000</p> <p>上述收益的精度为 0.0001 元，第五位采用去尾的方式。</p> <p>以最近七日收益所折算的年资产收益率% = [((7 R / 7) * 365) / 10000] * 100%</p> <p>7R = Ri 为最近第 i 公历日的每万份集合计划收益，收益率采取四舍五入方式保留至小数点后第四位。</p>	<p>集合计划净值通告。管理人在每个开放日披露前一个开放日的份额净值、累计净值 (非工作日则顺延至下一工作日)，供投资人参考。</p>	
<p>管理合同第十四部分第 (四) - (六) 条</p>	<p>(四) 退出价格</p> <p>本集合计划为 1 元/份，并始终按此价格进行退出。</p> <p>(五) 退出原则</p> <p>1、本集合计划的退出费用为 0。</p> <p>2、当日退出的集合计划份额享受当日的收益分配。</p> <p>管理人可根据计划运作的实际情况，在不影响委托人实质利益的前提下，经与托管人协商调整上述原则。</p> <p>(六) 其他有关退出的规定详见《集合计划说明书》</p>	<p>(四) 退出原则</p> <p>1、“未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出申请日当日 (T 日) 的集合计划份额净值为基准进行计算；</p> <p>2、“份额退出”原则，即退出以份额申请，并以获得现金的方式实现集合计划的退出；</p> <p>3、委托人可在本集合计划成立后的存续期内通过退出计划份额的方式实现集合计划的部分或全部退出。委托人部分退出集合计划份额时，如其该笔退出完成后在该推广机构剩余的集合计划份额低于 1000 份时，则管理人自动将该委托人在该推广机构的全份额退出给委托人；</p> <p>4、集合计划管理人可根据集合计划运作的实际情况并不影响委托人实质利益的前提下调整上述原则。集合计划管理人必须在新规则开始实施 3 个工作日前报告委托人。</p> <p>(五) 退出的程序</p> <p>1、退出的申请方式</p> <p>委托人应当以书面形式或管理人同意的其它方式申请退出。</p> <p>2、退出申请的确认</p> <p>推广机构在 T 日 (退出申请日) 规定时间受理的委托人申请，正常情况下管理人在 T+1 日内对该申请的有效性进行确认。委托人在 T+ 2 日后可向集合计划推广机构查询退出的成交情况。</p>	

		<p>3、 退出申请的款项支付</p> <p>集合计划退出的登记结算将按照注册与过户登记人（中国证券登记结算有限责任公司）的有关规定办理。</p> <p>若管理人确认委托人退出申请成功后，集合计划管理人应指示集合计划托管人于 T+1 日内将退出款项从集合计划托管专户划出。推广机构收到退出款后于 1 个工作日内划往退出委托人指定的银行账户。在发生巨额退出的情形时，款项的支付办法参照巨额退出的有关条款处理。</p> <p>4、 退出的注册登记</p> <p>（1）委托人退出集合计划成功后，注册与过户登记人在 T+1 日为委托人扣除权益并办理扣除权益的注册登记手续。</p> <p>（2）管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响委托人的合法权益，并最迟于开始实施 3 个工作日前报告委托人。</p> <p>（六）退出的价格和费用</p> <p>1、 退出价格：退出申请当日集合计划当日净值。</p> <p>2、 退出费：退出费率为 0。</p>	
<p>管理合同第十四部分第（七）条</p>	<p>（七）巨额退出的处理办法</p> <p>本集合计划的巨额退出处理办法如下：</p> <p>1、 巨额退出的认定</p> <p>本集合计划连续两个开放日累计净退出总额超过集合计划总份额的 5%，即认为发生了巨额退出。</p> <p>2、 巨额退出的处理</p> <p>当出现巨额退出时，管理人可以根据当时集合计划的资产组合状况和巨额退出情况采取不同的处理方式：</p> <p>（1）全额退出：当管理人认为有条件支付委托人的退出申请而不会损害委托人利益时，按正常退出程序办理。</p> <p>（2）顺延退出：如本集合计划连续两个开放日累计净退出总额超过集合计划总份额的 5%，管理人在这两个开放日累计接受退出比例不低于集合计划总份额 5%的前提下，对其余退出申请顺延至下一个工作日内办理。对于</p>	<p>（七）巨额退出的处理办法</p> <p>本集合计划的巨额退出处理办法如下：</p> <p>1、 巨额退出的认定</p> <p>本集合计划单个开放日，集合计划净退出申请总额超过上一日本集合计划总份额的 10%，即认为发生了巨额退出。</p> <p>2、 巨额退出的处理</p> <p>当出现巨额退出时，管理人可以根据当时集合计划的资产组合状况和巨额退出情况采取不同的处理方式：</p> <p>（1）全额退出：当管理人认为有条件支付委托人的退出申请而不会损害委托人利益时，按正常退出程序办理。</p> <p>（2）部分顺延退出：当管理人认为兑付委托人的退出申请有困难，或认为兑付委托人的退出申请而进行的资产变现可能使本计划单位资产净值发生较大波动</p>	

	<p>当日退出申请，应当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；未受理部分委托人可选择顺延至下一开放日办理或撤销退出申请。照此规定转入下个开放日的退出申请在下个开放日享有优先退出权。</p> <p>(3) 暂停退出：如本集合计划连续 10 个开放日累计净退出总额超过集合计划总份额的 25%，管理人可暂停接受退出申请；已经接受的退出申请按日期先后可顺延至不超过 20 个工作日内完成。当已接受的退出申请完成退出后，本集合计划重新开始办理退出申请。</p>	<p>时，管理人在当期接受退出比例不低于计划总份额 10%的前提下，对其余退出申请可延期予以办理，暂停或暂缓退出期限不超过 20 个工作日。对于当期的退出申请，应当按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当期受理的退出份额。对未受理部分，委托人可选择延至下 1 个工作日办理或撤销退出申请。选择延至下 1 个工作日办理的退出，退出价格为下一个工作日的单位资产净值，延期退出不受开放期时间限制，直至全部退出为止。</p> <p>(3) 暂停退出：连续两个或两个以上开放日，都出现集合计划净退出申请总额超过上一日本集合计划总份额的 10%时，即认为发生了连续巨额退出，管理人可暂停接受退出申请。已经接受的退出申请，按申请退出日期先后可顺延至不超过 20 个工作日内完成。当已接受的退出申请完成退出后，本集合计划重新开始办理退出申请。</p>	
管理合同第十五部分	本计划无存续期限限制，无需展期安排。	本集合计划不展期。	
说明书第五部分第（二）、（三）条	<p>（二）申购方式</p> <p>存续期内委托人只能通过现金购买份额的方式参与本集合计划。集合计划因分配收益而增加委托人参与份额的情形除外。</p> <p>（三）申购价格</p> <p>本集合计划存续期参与价格始终为每份壹元。</p>	<p>（二）申购价格</p> <p>在集合计划存续期内参与，每份额的参与价格为当日份额净值。</p> <p>（三）申购份额的计算方法</p> <p>参与份额=参与金额/参与申请日集合计划份额净值 参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。。</p>	
说明书第五部分第（四）条	<p>（四）认购原则</p> <p>1、委托人参与本集合计划前，应当已经是管理人或推广代销机构的客户。</p> <p>2、委托人在推广期内可多次参与本集合计划，但初次参与金额不得低于 50000 元。</p> <p>3、集合计划的申购费用为 0。</p> <p>4、委托人申购一旦完成资金交付，由推广代销机构审核无误出具缴款凭证后将不能撤消。</p> <p>5、本计划在推广期、存续期均无规模上限限制。</p> <p>6、当日申购的集合计划份额不享受当日收益分配。</p> <p>管理人可根据计划运作的实际情况，在不影响委托人实</p>	<p>（四）申购原则</p> <p>1、委托人在存续期内可多次参与本集合计划。但初次参与金额不得低于 50000 元。</p> <p>2、本集合计划存续期参与采用“未知价”原则，即在开放日，参与集合计划的价格以参与申请日当日（T 日）的计划份额净值为基准进行计算。</p> <p>3、集合计划的申购费用为 0。</p> <p>4、委托人申购一旦完成资金交付，由推广代销机构审核无误出具缴款凭证后将不能撤消。</p> <p>5、本计划在推广期、存续期均无规模上限限制。</p> <p>管理人可根据计划运作的实际情况，在不影响委托人</p>	

	质利益的前提下，经与托管人协商调整上述原则。	实质利益的前提下，经与托管人协商调整上述原则。	
说明书第九部分	<p>(一) 违规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；</p> <p>(二) 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；</p> <p>(三) 将集合计划资产投资于一家公司发行的证券超过集合计划资产净值的 10%；</p> <p>(四) 管理人管理的集合计划（含本集合计划资产）投资于一家公司发行的证券，超过该证券发行总量的 10%；</p> <p>(五) 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>(六) 将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人有关联方关系的公司（包括管理人的控股股东、其他管理人可以直接或间接控制的公司）发行的证券的资金超过集合计划资产净值的 7%；</p> <p>(七) 通过二级市场买入股票；</p> <p>(八) 证券法规规定、《管理办法》、《实施细则》、《规范》等禁止从事的其他投资。</p>	<p>(一) 违规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；</p> <p>(二) 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；</p> <p>(三) 通过二级市场买入股票；</p> <p>(四) 证券法律法规和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。</p>	
说明书第五部分第（五）条	<p>5、参与份额的计算方法</p> <p>参与份额=申购金额/（1元/份）</p>	删除	
说明书第十一部分	<p>1、债券估值</p> <p>(1) 交易所债券按摊余成本法估值</p> <p>(2) 银行间同业市场上市交易的债券于每一计价日采用“摊余成本法”进行估值，同时为了避免采用摊余成本法计算的价值与市场公允价值发生重大偏离，从而导致对本计划持有人的利益产生稀释和不公平的结果，每一估值日，管理人和托管人采用公允价值（第三方中债登发布）对本计划持有的估值对象进行重新评估并计算偏离度，即影子定价。当偏离度的绝对值达到 1.95%，管理人应根据风险控制的需要调整组合，使本计划资产净值更能公允地反映本计划资产价值，确保以摊余成本法计算的价值不会对本计划份额持有人造成实质性的损害。</p>	删除	

<p>“摊余成本法”是指，采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价至本金，每日计提收益。</p> <p>“影子定价”是指，采用第三方提供估值价格（目前同业普遍采用中央国债登记结算有限公司提供的证券价格）作为公允价值计算本计划资产净值的偏离度。</p> <p>本计划资产净值的偏离度=（“影子定价”确定的本计划资产净值—“成本摊余”确定的本计划资产净值）/“成本摊余”确定的本计划资产净值。</p> <p>2、资产支持证券（包括 MBS、ABS）等成交不活跃证券 资产支持证券（包括 MBS、ABS）等成交不活跃证券采用摊余成本法估值。</p> <p>3、逆回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。</p> <p>4、银行存款以成本列示，按确定利率在实际持有期间内逐日计提利息。</p> <p>5、货币市场基金的收益以基金公布的前一日收益估值。</p> <p>6、股票估值</p> <p>（1）本计划持有的网上中签新股在上市前采用发行价估值，上市之日起采用成本法估值。</p> <p>（2）本计划持有的网下获配新股在解锁上市前按发行价估值，解锁上市之日起按成本法估值。</p> <p>7、债券远期估值</p> <p>（1）远期买入，买入债券按市价计入账面，在合约期内按市价进行估值，对远期合约价款记入负债，对买入市价计价的资产与远期合约价计价的负债的差额，在合约期内直线摊销。</p> <p>（2）远期卖出，原持仓债券，按原有核算及估值方法持续进行，对远期卖出债券按市价记入负债（与买入债券同样方法在合约期内估值），对远期合约价款记入资产，资产与负债的差额，在合约期内直线摊销。</p> <p>（3）鉴于交收信用风险，当市价变动造成的有利可能收益或不利可能损失，对市价和和约价的差额计算的可能盈亏超过交纳的保证金的部分不进行估值。</p>		
---	--	--

	<p>8、待摊风险资产盈亏</p> <p>本计划持有的新股和剩余期限大于 397 天的上市债券变现后，如当日变现所得大于成本，则为盈利；如当日变现所得少于成本，则为亏损。投资新股和剩余期限大于 397 天的债券变现获得的盈利或产生的亏损实行向后摊销的方式，计入待摊风险资产盈亏中，在 90 日平均摊销至集合计划资产净值。如投资获得盈亏当日距本计划到期日不足 90 日的，待摊风险资产盈亏应根据实际剩余期限进行均匀摊销。</p> <p>9、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。</p> <p>10、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。</p> <p>11、暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所法定节假日或其它原因暂停营业时，或因其它任何不可抗力致使管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，管理人必须按规定完成估值工作。</p> <p>12、管理人按以上估值方法的第 1—8 项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划单位资产净值错误处理。</p>		
<p>说明书第十 三部分第 (三) - (五) 条</p>	<p>(三) 退出方式</p> <p>委托人以申请退出计划份额，并获得现金的方式实现集合计划的退出。</p> <p>(四) 退出价格</p> <p>本集合计划为 1 元/份，并始终按此价格进行退出。</p> <p>(五) 退出原则</p> <p>1、本集合计划的退出费用为 0。</p> <p>2、当日退出的集合计划份额享受当日的收益分配。</p> <p>管理人可根据计划运作的实际情况，在不影响委托人实质利益的前提下，经与托管人协商调整上述原则。</p>	<p>(三) 参与和退出的数额限制</p> <p>本集合计划每次退出份额应大于或等于 1000 份，若某笔退出导致该委托人在某一推广机构处持有的份额少于 1000 份，则余额部分系统自动一起退出。</p> <p>(四) 退出费用</p> <p>本集合计划退出费为 0。</p> <p>(五) 退出金额的计算</p> <p>退出金额=退出份额×退出申请日集合计划份额净值。</p> <p>若委托人退出后剩余份额小于最小持有额（1000 份）的，退出金额可能不等于退出数量。</p> <p>退出金额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，由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。</p>	
<p>说明书第十</p>	<p>3、退出金额的计算方式。退出金额为按实际确认的有</p>	<p>删除</p>	

三部分第 (六)条	效退出份额乘以1元/份，保留到小数点后两位。		
--------------	------------------------	--	--

本次合同变更生效后，本集合计划不再采用摊余成本法进行估值，不再披露每万份净收益和七日年化收益率，而是按照修订后的集合计划合同约定的估值方法对集合计划资产进行估值，并按法律法规要求计算并披露集合计划净值信息。基于此，已删除全文中有关“每万份净收益”和“七日年化收益率”的释义、计算、披露等有关内容，已删除全文中有关本集合计划采用摊余成本法估值的相关内容；已删除全文中有关收益支付相关内容；已修订本集合计划有关存续期参与退出原则的相关内容，包括但不限于参与份额与赎回金额的计算方式、参与与赎回原则等。

此外，根据监管规定和管理人实际情况对相关法律法规，管理人及托管人基本信息，合同的签署和附件，集合计划的展期、合同补充、修改的程序等一并进行调整。

以上所涉《管理合同》及相关文件中合同当事人相关信息一并更新，详见变更后的《管理合同》。《计划说明书》等相关文件根据最新的管理合同，同步调整所涉及的对应条款。

管理人将更新和调整后的《管理合同》、《说明书》及相关文件通过管理人网站进行披露，敬请各位委托人认真阅读。

经履行本集合计划合同变更相应的程序之后，我对合同变更的后续事项做如下安排：

1、我自合同变更之日起，在管理人网站公告，更新或修改的内容在管理人网站公告满5个工作日后生效，具体生效日期为2021年9月24日；

2、如委托人对本次合同变更有异议，可在合同变更生效前按照《资产管理合同》的规定申请退出本集合计划。

3、为充分保障广大委托人的合法权益，本集合计划自本公告公示之日起至2021年9月23日期间，仅开放退出，不开放参与。变更生效之日起恢复参与和退出，不再另行公告。

特此公告