

# 关于征求安信证券债券增利 1 号集合资产管理计划 合同变更意见的函

上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行：

根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及《安信证券债券增利 1 号集合资产管理计划合同》“第 26 部分 合同的补充、修改与变更”的规定，经与贵行初步协商一致，我公司将对《安信证券债券增利 1 号集合资产管理计划合同》（以下简称“合同”）中相关内容进行变更（以下简称“本次变更”），主要变更内容详情请详见附件《安信证券债券增利 1 号集合资产管理计划合同修订对照表》。现就上述变更事项，征求贵行意见。敬请于三个工作日内予以函复。

安信证券资产管理有限公司

二〇二一年十月十九日

附件：安信证券债券增利 1 号集合资产管理计划合同修订对照表

变更前	变更后
第 2 部分 释义	
	<p><b>增加：</b>  <b>有效划款指令：</b>指收款账户信息、大小写金额、划款用途、预留印鉴等书面要素及相关划款依据文件齐全，符合本协议及有关交易文件要求。</p>
第 4 部分 集合资产管理计划的基本情况	
<p>四、投资范围和投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划主要投资于固定收益类资产。</p> <p>固定收益类资产应为符合《指导意见》、《管理办法》规定的标准化债权类资产，包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的债券、中央银行票据、资产支持证券、非金融企业债务融资工具等。具体包括：银行存款、大额存单、同业存单、国债、央行票据、地方政府债、金融债（含次级债、混合资本债）、债券回购、公司债（含非公开发行）、企业债（含非公开发行）、项目收益债、专项债券、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、非公开定向债务融资工具、资产支持证券（ABS）优先级、资产支持票据（ABN）优先级、可转债、分离交易可转债、可交换债、债券型公募基金、货币市场基金。</p> <p>.....</p>	<p>四、投资范围和投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划主要投资于固定收益类资产。</p> <p>固定收益类资产应为符合《指导意见》、《管理办法》规定的标准化债权类资产，包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的债券、中央银行票据、资产支持证券、非金融企业债务融资工具等。投资范围具体包括：银行存款、大额存单、同业存单、国债、央行票据、地方政府债、金融债（含次级债、混合资本债）、债券回购、公司债（含非公开发行）、企业债（含非公开发行）、项目收益债、专项债券、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、非公开定向债务融资工具、资产支持证券（ABS）优先级、资产支持票据（ABN）优先级、可转债、分离交易可转债、可交换债、债券型公募基金、货币市场基金。</p> <p>.....</p>
<p>五、管理期限</p> <p>本集合计划管理期限为 10 年。当本计划非现金类资产全部变现时，管理人有权提前终止本计划。在到期之前经投资者同意后，并在符合法律法规、中国证监会相关规定以及本合同约定的前提下，本集合计划可展期。</p>	<p>五、管理期限</p> <p>本集合计划管理期限为 10 年。当本计划非现金类资产全部变现时，管理人有权提前终止本计划。在到期之前经投资者、托管人同意后，并在符合法律法规、中国证监会相关规定以及本合同约定的前提下，本集合计划可展期。</p>
<p>六、开放期、封闭期</p> <p>本计划自成立日起每满三个月开放一次，每次开放期为每满三个月之日起的次一工作开始连续十个工作日，投资者可于开放期的正常交易时间内申请参与，但仅可于开放期的前三个工作日的正常交易时间申请退出。具体以管理人公告为准。本集合计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。</p>	<p>六、开放期、封闭期</p> <p>本计划每周三、周四（如遇非工作日不开放、不顺延）为参与开放期，投资者可以在参与开放期内办理参与业务。</p> <p>投资者参与的每笔份额自参与之日起每 3 个月为一个封闭运作期，封闭运作期内不允许退出。每笔份额自参与之日起满 3 个月的月度对应日为退出开放期，投资者在退出开放期内可以办理退出业务。如果投资者在当期退出开放期未退出的，则投资者持有的该份额自该退出开放期的下一工作日起进入下一个封闭运作期，封闭运作期内不允许退出。</p> <p>对于投资者参与的每笔份额，第一个退出开放期指自参与之日起满 3 个月的月度对应日（若该月度对应日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一工作日），第二个退出开放期指自参与之日起满 6 个月的月度对应日（若该月度对应日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一工作</p>



日), 以此类推。

本集合计划退出开放期内, 其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于本计划资产净值的 10%; 主动投资于流动性受限资产的市值在退出开放期内合计不得超过本计划资产净值的 20%。

风险提示: 除法律法规、监管规定、本合同约定的开放期或本合同另有约定外, 本集合计划不允许投资者参与或退出, 投资者存在无法及时退出本集合计划的风险。

**第 4 部分 集合资产管理计划的基本情况**

十一、本集合计划的各项费用

1、参与费: 本集合计划按参与金额的不同设置差别费率, 详见本合同“第 5 部分 集合计划的参与和退出”。

.....

3、管理费: 0.7%/年。

.....

5、业绩报酬: 若符合业绩报酬提取条件, 本集合计划管理人于本集合计划分红日、委托人退出日和本集合计划终止日提取超过业绩报酬计提基准 5% (不含) 以上部分的 15% 作为业绩报酬。其中, 分红日提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次。详见本合同“第 13 部分 集合计划的费用、业绩报酬”。

二、本集合计划的各项费用

1、参与费: 本集合计划不收取参与费。

.....

3、管理费: 0.5%/年。

.....

5、业绩报酬: 若符合业绩报酬提取条件, 本集合计划管理人于本集合计划分红日、委托人退出日和本集合计划终止日提取超过业绩报酬计提基准 5% (不含) 以上部分的 20% 作为业绩报酬。其中, 分红日提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次。详见本合同“第 13 部分 集合计划的费用、业绩报酬”。

**第 5 部分 集合计划的参与和退出**

一、集合计划的参与

(四) 参与费及参与份额的计算

1、参与费率

本集合计划按参与金额的不同设置差别费率, 具体如下:

单笔参与金额 (M)	参与费率
M ≥ 500 万	免收参与费
M < 500 万	0.3%

2、参与份额的计算方法

(1) 初始销售期参与份额的计算

净参与金额 = 参与金额 / (1 + 参与费率)

参与费用 = 参与金额 - 净参与金额

参与份额 = (净参与金额 + 初始销售利息) / 集合计划份额面值

.....

(2) 存续期参与份额的计算

净参与份额 = 参与金额 / (1 + 参与费率)

参与费用 = 参与金额 - 净参与金额

参与份额 = 净参与金额 / 参与申请日的集合计划单位净值

.....

一、集合计划的参与

(四) 参与费及参与份额的计算

1、参与费率

本集合计划不收取参与费。

2、参与份额的计算方法

(1) 初始销售期参与份额的计算

参与份额 = (参与金额 + 初始销售利息) / 集合计划份额面值

.....

(2) 存续期参与份额的计算

参与份额 = 参与金额 / 参与申请日的集合计划单位净值

.....

<b>第 5 部分 集合计划的参与和退出</b>	
<p>二、集合计划的退出</p> <p>(一) 退出的办理时间</p> <p>本计划自成立日起每满三个月开放一次，每次开放期为每满三个月之日起的次一工作日开始连续开放十个工作日，投资者仅可于开放期内前三个工作日正常交易时间内申请退出。具体以管理人公告为准。</p>	<p>二、集合计划的退出</p> <p>(一) 退出的办理时间</p> <p>投资者参与的每笔份额自参与之日起每 3 个月为一个封闭运作期，封闭运作期内不允许退出。每笔份额自参与之日起满 3 个月的月度对应日为退出开放期，投资者在退出开放期内可以办理退出业务。如果投资者在当期退出开放期未退出的，则投资者持有的该份额自该退出开放期的下一工作日起进入下一个封闭运作期，封闭运作期内不允许退出。</p> <p>对于投资者参与的每笔份额，第一个退出开放期指自参与之日起满 3 个月的月度对应日（若该月度对应日为非工作日或不存对应日期的，则顺延至下一工作日），第二个退出开放期指自参与之日起满 6 个月的月度对应日（若该月度对应日为非工作日或不存对应日期的，则顺延至下一工作日），以此类推。</p>
<b>第 6 部分 管理人自有资金参与集合计划</b>	
<p>管理人不以自有资金参与本集合计划，但为应对集合计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突的前提下，管理人及其附属机构可以以自有资金参与及退出本集合计划，但应当及时告知人和托管人，并向中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报告。</p>	<p>管理人不以自有资金参与本集合计划，但为应对集合计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突的前提下，管理人及其附属机构可以以自有资金参与及退出本集合计划，但应当及时告知委托人和托管人，并向中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报告。</p>
<b>第 12 部分 集合计划估值</b>	
<p>七、估值方法</p> <p>在不违反现行法律法规的前提下，管理人按照公平、公允、保护投资者利益的原则选择合适的估值方法，并应就此与托管人达成一致。</p> <p>1、基金产品估值方法：</p> <p>(1) 场外公募基金（包括托管在场外的交易型指数基金ETF、上市型开放式基金LOF）产品定期披露单位净值的，以估值日基金产品单位净值估值（以公开披露的净值或管理人盖章版净值函为准）；估值日基金净值未公布的，则按基金产品最近披露的净值估值。</p> <p>(2) 交易所基金（包括封闭基金场内交易的交易型指数基金ETF、上市型开放式基金LOF）按照其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值。</p> <p>(3) 货币市场基金按成本估值，每天按公布的估值日万份收益计提收益。</p> <p>.....</p> <p>3、债券估值方法</p> <p>(1) 在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：</p> <p>.....</p> <p>对于在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对</p>	<p>七、估值方法</p> <p>在不违反现行法律法规的前提下，管理人按照公平、公允、保护投资者利益的原则选择合适的估值方法，并应就此与托管人达成一致。</p> <p>1、基金产品估值方法：</p> <p>(1) 场外公募基金（包括托管在场外的交易型指数基金ETF、上市型开放式基金LOF）产品定期披露单位净值的，以估值日前一日基金产品单位净值估值（以公开披露的净值或管理人盖章版净值函为准）；估值日前一日基金净值未公布的，则按基金产品最近披露的净值估值。</p> <p>(2) 交易所基金（包括封闭基金场内交易的交易型指数基金ETF、上市型开放式基金LOF）按照其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值。</p> <p>(3) 摊余成本法货币市场基金按成本估值，每天按公布的估值日前一日万份收益计提收益。</p> <p>.....</p> <p>3、债券估值方法</p> <p>(1) 在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：</p> <p>.....</p> <p>对于在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对</p>





<p>存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值按成本估值。</p>	<p>存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。</p>
<p><b>第 13 部分 集合计划的费用、业绩报酬</b></p>	
<p>一、集合计划税费计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、托管人的托管费</p> <p>.....</p> <p>托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人于次月首日起 5 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p>	<p>一、集合计划税费计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、托管人的托管费</p> <p>.....</p> <p>托管人的托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人于次月首日起 5 个工作日内依据管理人的有效划款指令从本集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p>
<p><b>第 13 部分 集合计划的费用、业绩报酬</b></p>	
<p>一、集合计划税费计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>2、管理人的管理费</p> <p>本集合计划应给付管理人管理费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为0.7%。计算方法如下：</p> $M=V \times 0.7\% \div \text{当年实际天数}$ <p>M为每日应支付的管理费； V为前一日集合计划资产净值。</p> <p>管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人于次月首日起 5 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p>	<p>一、集合计划税费计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>2、管理人的管理费</p> <p>本集合计划应给付管理人管理费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为0.5%。计算方法如下：</p> $M=V \times 0.5\% \div \text{当年实际天数}$ <p>M为每日应支付的管理费； V为前一日集合计划资产净值。</p> <p>管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人于次月首日起 5 个工作日内依据管理人的有效划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p>
<p><b>第 13 部分 集合计划的费用、业绩报酬</b></p>	
<p>一、集合计划税费计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>7、按照国家有关规定可以列入的其他费用。</p> <p>其他费用是指银行结算费用、开户费、银行账户维护费；银行间市场账户开户费、维护费、银行间交易费、转托管费；审计事务所审计费、询证费；TA 服务费等集合计划运营过程中发生的相关费用。</p> <p>其中集合计划的年度审计费，按与会计师事务所签定协议所规定的金额，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。</p>	<p>一、集合计划税费计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>7、按照国家有关规定可以列入的其他费用。</p> <p>其他费用是指银行结算费用、开户费、银行账户维护费；银行间市场账户开户费、维护费、银行间交易费、转托管费；审计集合计划财产的会计师事务所审计费、询证费；TA 服务费等集合计划运营过程中发生的相关费用。</p> <p>其中集合计划的年度审计费，按与会计师事务所签定协议所规定的金额，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。</p>
<p><b>第 13 部分 集合计划的费用、业绩报酬</b></p>	
<p>二、不列入集合计划费用的项目</p> <p>集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与销售有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务、处置资产管理计划事务不当导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。</p>	<p>二、不列入集合计划费用的项目</p> <p>集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与销售有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务、处置资产管理计划事务不当导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。</p>
<p><b>第 13 部分 集合计划的费用、业绩报酬</b></p>	

<p>三、管理人提取业绩报酬</p> <p>当集合计划份额退出、终止或分红时，管理人将根据份额持有期间收益率计提业绩报酬。</p> <p>当集合计划份额退出、终止或分红时，管理人将提取退出份额（集合计划终止视同于退出情形）或分红份额当期实际年化收益率（R）超过 5%（不含）以上部分的 15%作为业绩报酬。若委托人当期的实际年化收益率小于等于 5%，则管理人不计提业绩报酬。其中，分红提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次。</p> <p>.....</p> <p>(2) 业绩报酬的提取方法</p> <p>.....</p> <p>业绩报酬比例计算方法如下：</p> $H = P \times (R - 5\%) \times 15\% \times A$ <p>.....</p> <p>管理人负责计算业绩报酬，托管人不承担复核的责任，管理人于每个业绩报酬提取日提取业绩报酬，由托管人于业绩报酬提取日后5个工作日内按照管理人指令从本集合计划资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。</p>	<p>三、管理人提取业绩报酬</p> <p>当集合计划份额退出、终止或分红时，管理人将根据份额持有期间收益率计提业绩报酬。</p> <p>当集合计划份额退出、终止或分红时，管理人将提取退出份额（集合计划终止视同于退出情形）或分红份额当期实际年化收益率（R）超过 5%（不含）以上部分的 20%作为业绩报酬。若委托人当期的实际年化收益率小于等于 5%，则管理人不计提业绩报酬。其中，分红提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次。</p> <p>.....</p> <p>(2) 业绩报酬的提取方法</p> <p>.....</p> <p>业绩报酬比例计算方法如下：</p> $H = P \times (R - 5\%) \times 20\% \times A$ <p>.....</p> <p>管理人负责计算业绩报酬，托管人不承担复核的责任，管理人于每个业绩报酬提取日提取业绩报酬，由托管人于业绩报酬提取日后 5 个工作日内按照管理人有效划款指令从本集合计划资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。</p>
<p><b>第 17 部分 投资限制及禁止行为</b></p>	
<p>一、投资限制</p> <p>.....</p> <p>若法律法规、监管规定等有变化，管理人履行合同变更程序后，可以对上述投资限制进行调整，并在管理人网站公告告知委托人。</p>	<p>一、投资限制</p> <p>.....</p> <p>若法律法规、监管规定等有变化，管理人履行合同变更程序，且与托管人协商一致后，可以对上述投资限制进行调整，并在管理人网站公告告知委托人。</p>
<p><b>第 25 部分 合同的成立与生效</b></p>	
<p>一、合同的成立与生效</p> <p>本合同由管理人、托管人法定代表人\负责人或授权签字人签字并加盖公章或资产托管业务合同专用章，委托人签署（如果委托人是自然人则应签字，如果委托人是非自然人则应盖公章，并由法定代表人或其授权签字人签字）/以电子合同、电子签名签署后成立。管理人、托管人和委托人作为本合同当事人，以约定的签名方式签署本合同，即表明管理人、托管人和委托人完全接受本合同项下的全部条款。</p> <p>本合同成立后，满足以下条件时生效：委托人参与资金实际交付并经注册登记机构确认。</p> <p>本集合计划终止，本合同终止。但合同项下有关清算、违约责任、争议解决的条款仍然有效。</p> <p>二、合同的组成</p> <p>《安信证券债券增利 1 号集合资产管理计划说明书》、经管理人确认有效的委托人参与、退出本集合计划的申请材料或数据电文和各销售机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证或委托人通过电子签名方式产生的数据电文</p>	<p>本合同由管理人、托管人法定代表人\负责人或授权签字人签字并加盖公章或资产托管业务合同专用章，委托人签署（如果委托人是自然人则应签字，如果委托人是非自然人则应盖公章，并由法定代表人或其授权签字人签字）/以电子合同、电子签名签署后成立。管理人、托管人和委托人作为本合同当事人，以约定的签名方式签署本合同，即表明管理人、托管人和委托人完全接受本合同项下的全部条款。</p> <p>本合同成立后，满足以下条件时生效：委托人参与资金实际交付并经注册登记机构确认。</p> <p>本集合计划终止，本合同终止。但合同项下有关清算、违约责任、争议解决的条款仍然有效。</p>

<p>等为本合同的附件，是合同的组成部分，与合同具有同等法律效力。</p>	
<p>附件 投资监督事项表</p>	
<p>监控比例及限制</p> <p>5、若法律法规、监管规定等有变化，管理人履行合同变更程序，可以对上述投资限制进行调整，并在管理人网站公告告知委托人。</p>	<p>监控比例及限制</p> <p>5、若法律法规、监管规定等有变化，管理人履行合同变更程序，且与托管人协商一致后，可以对上述投资限制进行调整，并在管理人网站公告告知委托人。</p>