

长江证券（上海）资产管理有限公司

关于征求长江资管乐享年年盈 10 号集合资产管理计划 资产管理合同（修订版 2）变更意见的函

中国农业银行股份有限公司：

长江证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“公司”）为了给投资者提供更加优质的理财服务，拟对《长江资管乐享年年盈 10 号集合资产管理计划资产管理合同》（修订版 1）（以下简称《合同》）的相关条款进行变更，主要变更内容为：

- 1、调整投资范围及投资限制；
- 2、调整部分债券的估值方式。

主要变更内容见附件中合同的变更对照表，具体以变更后的合同为准。

特致此函，恳请贵行复函确认。公司收到贵行回函后，将根据监管规定和合同约定，在管理人网站向投资者公告征询意见，并申请办理合同变更备案。变更内容将于合同变更程序完成后生效。

附件：1、《长江资管乐享年年盈 10 号集合资产管理计划资产管理合同（修订版 2）变更对照简表》

长江证券（上海）资产管理有限公司

2021 年 4 月 28 日

长江证券(上海)
骑

中国农业银行股份

长江资管乐享年年盈 10 号

集合资产管理计划资产管理合同（修订版 2）变更对照简表

原条款位置	变更前	变更后	备注
四、当事人及权利义务	托管人 机构名称：中国农业银行股份有限公司 负责人：周慕冰 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 通讯地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸东座 9 层 联系电话：010-68121566 联系人：刘亮	托管人 机构名称：中国农业银行股份有限公司 负责人：谷澍 注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号 通讯地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸东座 9 层 联系电话：010-68121566 联系人：刘亮	调整托管人信息
五、资产管理计划的基本情况	五、资产管理计划的基本情况 （四）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级 2、投资范围 本集合计划的投资范围为：交易所和银行间上市交易的债权类资产，包括国债、地方政府债、铁道债、企业债、公司债、专项债、项目收益债、各类金融债（含次级债、混合资本债、政策性金融债）、可转换债券、可交换债券、央行票据、超短期融资券、短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）、债券型基金、货币市场基金、同业存单、债券逆回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金等；	五、资产管理计划的基本情况 （四）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级 2、投资范围 本集合计划的投资范围为：交易所和银行间上市交易的债权类资产，包括国债、地方政府债、铁道债、企业债、公司债、专项债、项目收益债、各类金融债（含次级债、混合资本债、政策性金融债）、可转换债券、可交换债券、央行票据、超短期融资券、短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）、永续债、非公开发行债券、资产支持证券、债券型基金、货币市场基金、同业存单、债券逆回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存	调整投资范围

	<p>.....</p> <p>(一) 资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构</p> <p>1、销售机构</p> <p>(1) 直销机构</p> <p>名称: 长江证券(上海)资产管理有限公司</p> <p>注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层</p> <p>办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层</p> <p>法定代表人: 周纯</p> <p>联系人: 蒋媛媛</p> <p>电话: 021-80304224</p> <p>传真: 021-80301399</p> <p>客户服务电话: 4001-166-866</p> <p>网址: www.cjzcg1.com</p>	<p>款)、现金等;</p> <p>.....</p> <p>(一) 资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构</p> <p>(1) 直销机构</p> <p>名称: 长江证券(上海)资产管理有限公司</p> <p>注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1198号世纪汇一座27层</p> <p>办公地址: 上海市浦东新区世纪大道1198号世纪汇一座27层</p> <p>法定代表人: 周纯</p> <p>联系人: 邓凌雯</p> <p>电话: 021-80301342</p> <p>传真: 021-80301399</p> <p>客户服务电话: 4001-166-866</p> <p>网址: www.cjzcg1.com</p>	修改联系人及方式
<p>十一、资产管理计划的投</p> <p>资</p>	<p>十一、资产管理计划的投</p> <p>资</p> <p>(二) 投资范围及比例</p> <p>本集合计划的投资范围为: 交易所和银行间上市交易的债权类资产, 包括国债、地方政府债、铁道债、企业债、公司债、专项债、项目收益债、各类金融债(含次级债、混合资本债、政策性金融债)、可转换债券、可交换债券、央行票据、超短期融资券、短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据(ABN)、非公开定向债务融资工具(PPN)、债券型基金、货币市场基金、同业存单、债券逆回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款).....</p> <p>(七) 投资限制和投资禁止</p>	<p>十一、资产管理计划的投</p> <p>资</p> <p>(二) 投资范围及比例</p> <p>1、本集合计划的投资范围为: 交易所和银行间上市交易的债权类资产, 包括国债、地方政府债、铁道债、企业债、公司债、专项债、项目收益债、各类金融债(含次级债、混合资本债、政策性金融债)、可转换债券、可交换债券、央行票据、超短期融资券、短期融资券、中期票据、集合债券、资产支持票据(ABN)、非公开定向债务融资工具(PPN)、永续债、非公开发行业债券、资产支持证券、债券型基金、货币市场基金、同业存单、债券逆回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、现金等;</p> <p>.....</p>	调整投资范围

	<p>1、本集合计划的投资限制包括： (3) 集合计划不得投资于主体评级低于AA的信用债，无主体评级的，债项评级不得低于AA；（中债资信不纳入参考）</p>	<p>(七) 投资限制和投资禁止 1、本集合计划的投资限制包括： (3) 集合计划所投资信用债主体或债项评级需高于或等于AA；（中债资信不纳入参考）</p>	调整投资限制
<p>十四、利益冲突及关联交易</p>	<p>十四、利益冲突及关联交易 (一) 关联交易及利益冲突情形 投资者在此同意并授权管理人可以将本计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券、设立的证券投资基金产品。因此，本计划未来可能投资管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行或承销的证券、设立的证券投资基金产品。 本计划运作过程中可能发生存在利益冲突的情形。</p>	<p>十四、利益冲突及关联交易 (一) 关联交易及利益冲突情形 投资者在此同意并授权管理人可以将本计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他关联交易及重大关联交易。本计划运作过程中可能发生上述利益冲突的情形。</p>	调整关联交易表述
<p>十八、越权交易的界定</p>	<p>十八、越权交易的界定 (三) 托管人对管理人投资运作的监督 1、托管人对管理人的投资行为行使监督权。托管人根据本合同有关资产管理计划财产投资政策的约定，承诺对本计划项下投资事项进行监督。托管人对下述事项履行投资监督义务： (1) 投资范围及比例 本集合计划的投资范围为：交易所和银行间上市交易的债权类资产，包括国债、地方政府债、铁道债、企业债、公司债、专项债、项目收益债、各类金融债（含次级债、混合资本债、政策性金融债）、可转换债券、可交换债券、央行票据、超短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）、债券型基金、货币市场基金、同业存单、债券逆回购</p>	<p>十八、越权交易的界定 (三) 托管人对管理人投资运作的监督 1、托管人对管理人的投资行为行使监督权。托管人根据本合同有关资产管理计划财产投资政策的约定，承诺对本计划项下投资事项进行监督。托管人对下述事项履行投资监督义务： (1) 投资范围及比例 本集合计划的投资范围为：交易所和银行间上市交易的债权类资产，包括国债、地方政府债、铁道债、企业债、公司债、专项债、项目收益债、各类金融债（含次级债、混合资本债、政策性金融债）、可转换债券、可交换债券、央行票据、超短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）、永续债、非公开发行债券、资产支持证券、债券型基金、货币市场基金、同</p>	调整投资范围

<p>十九、资产管理计划的估值和会计核算</p>	<p>购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金等； (3) 投资限制： 3) 集合计划不得投资于主体评级低于AA-的信用债，无主体评级的，债项评级不得低于AA；（中债资信不纳入参考）</p>	<p>业存单、债券逆回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金等； (3) 投资限制： 3) 集合计划所投资信用债主体或债项评级需高于或等于AA；（中债资信不纳入参考）</p>	<p>调整投资限制</p>
<p>十九、资产管理计划的估值和会计核算</p> <p>(三) 估值方法： 1、债券估值方法</p> <p>(6) 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，按成本估值。</p>	<p>十九、资产管理计划的估值和会计核算</p> <p>(三) 估值方法： 1、债券估值方法</p> <p>(6) 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，按成本估值。</p> <p>(7) 对在交易所挂牌转让的资产支持证券，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>(8) 对在银行间市场上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。对在银行间市场上交易且中债登公司未提供价格的，采用估值技术确定公允价值，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>十九、资产管理计划的估值和会计核算</p> <p>(三) 估值方法： 1、债券估值方法</p> <p>(6) 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>(7) 对在交易所挂牌转让的资产支持证券，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>(8) 对在银行间市场上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。对在银行间市场上交易且中债登公司未提供价格的，采用估值技术确定公允价值，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>调整部分债券的估值方式</p>
<p>二十三、风险提示</p>	<p>二十三、风险提示</p> <p>(三) 本集合计划特有风险</p>	<p>二十三、风险提示</p> <p>(三) 本集合计划特有风险</p>	<p>调整关联交易表述</p>

<p>12、关联交易的特有风险</p> <p>根据本集合计划资产管理合同的约定，本计划未来可能投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，设立的证券投资基金产品。管理人将参照相关法律法规、监管规则以及本合同的约定做好关联交易的管控。请投资者注意前述关联交易可能存在的各项风险。</p>	<p>12、关联交易的特有风险</p> <p>投资者在此同意并授权管理人可以将本计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他关联交易及重大关联交易。由此产生的风险请投资者知悉。</p>	
---	--	--

回执

长江证券（上海）资产管理有限公司：

贵司《长江证券（上海）资产管理有限公司关于征求长江资管乐享年年盈 10 号集合资产管理计划资产管理合同（修订版 2）变更意见的函》已收悉。经研究，我行对贵司拟变更内容无异议，请贵司依法履行相关法律程序。

请管理人于不晚于合同变更生效当日向托管人通知合同变更生效事宜，并提供合同变更生效公告以及更新后的合同。

特此函复。



回



