

海通怡然恒旭 1 号集合资产管理计划

第五次合同变更主要条款

合同条款	合同变更前	合同变更后
投资范围	<p>本集合计划的投资范围包括股票、港股通的标的股、债券、期货、期权等证券期货交易所交易的投资品种；央行票据、短期融资券、中期票据等银行间市场交易的投资品种；公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品；债券回购；以及中国证监会认可的其他标准化投资品种。</p>	<p>1、债权类资产：国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、可转换债券、可分离债、经银行间市场交易商协会批准在发行的各类债务融资工具（如短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持票据）、资产支持证券、债券型公募基金、货币市场基金、银行存款、债券逆回购等；</p> <p>2、股权类资产：国内依法发行的股票（含科创板、港股通的标的股）、沪深交易所发行及上市的存托凭证、股票型公募基金（包括 ETF 场内基金）、混合型公募基金等。</p> <p>本集合计划可以参与新股申购、债券正回购业务。</p>
投资比例	<p>—(1) 固定收益类：占计划资产的 0—80%；固定收益类资产包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、可转换债券、次级债、私募债、可分离债、短期融资券、中期票据（含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）、资产支持证券、债券型基金、分级基金优先级份额、债券逆回购以及其它具有明显固定收益特征的证券等；</p> <p>—(2) 权益类：占计划资产的 0-80%；—权益类包括股票(含优先股)、港股通的标的股、股票型及混合型基金等；</p> <p>本集合计划投资于港股通的，须待相关法律、法规及业务细则出台并经过管理人和托管人系统测试通过后再投资；</p> <p>—(3) 金融衍生品：期货（股指期货、国债期货、商品期货）、期权；本集合计划以套期保值、套利及投机为目的投资于股指期货；股指期货的风险敞口不超过计划资产净值的 80%。股指期货的风</p>	<p>1、投资于股权类资产的比例按市值计算为资产管理计划总资产的 0-80%（不含）；</p> <p>2、投资于债权类资产的比例按市值计算为资产管理计划总资产的 0-80%（不含）；</p> <p>3、债券回购：债券正回购融入资金余额不超过集合计划前一日资产净值的 100%；参与债券逆回购资金余额不得超过集合计划前一日资产净值的 100%；</p> <p>4、本集合计划股权类资产按市值计算不得超过净资产的 100%，本集合计划总资产占净资产的比例不超过 140%。</p>

	<p>险敞口指集合资产管理计划所持有的多仓股指期货合约价值，减去空仓股指期货合约价值；</p> <p>（4）债券正回购：债券正回购融入资金余额不超过计划前一日资产净值的100%。</p>	
<p style="text-align: center;">投资限制</p>	<p>为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>1、集合计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；</p> <p>2、管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种除外；</p> <p>3、管理人管理的全部资产管理计划合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>4、本集合计划的总资产占净资产的比例不超过 200%，若未来监管部门相关法规对该比例限制予以修改或取消，管理人经公告并告知托管人后将按照新的监管标准予以调整，无需再征得委托人同意；</p> <p>5、在开放退出期内，本集合计划资产组合中 7 个工作日内可变现资产价值不低于计划资产净值的 10%；</p> <p>6、本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过计划资产净值的 20%；</p> <p>7、证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。</p>	<p>为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>（1）本集合计划投资同一资产的资金，不超过本集合计划资产净值的 15%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；</p> <p>（2）本集合计划投资于公司债、企业债、中期票据等信用债（可转债除外）的债券主体评级或债项评级不低于 AA（含）；可转债的债券主体评级或债项评级不低于 AA-（含）；短期融资券债项评级不低于 A-1 级（含）。本集合计划不投资于中小企业私募债；</p> <p>（3）管理人管理的全部资产管理计划合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>（4）在开放退出期内，7 个工作日内可变现资产价值不低于计划资产净值的 10%，本集合资产管理计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过资产管理计划净值的 20%；</p> <p>（5）本集合计划股权类资产按市值计算不得超过净资产的 100%，本集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 140%；</p> <p>（6）债券正回购、逆回购：债券正回购融入资金余额不超过集合计划前一日资产净值的 100%；债券逆回购资金余额不得超过集合计划前一日资产净值的 100%；</p> <p>（7）集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>（8）本集合计划不投资于管理人管理的</p>

		<p>参照公募基金运作的资产管理产品；</p> <p>(9) 本集合计划投资于公开募集证券投资基金占计划资产总值的比例按市值计算不得超过 80% (不含)；</p> <p>(10) 本集合资产管理计划投资资产支持证券的限制要求如下：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 不投资于底层资产为资产管理产品或其收（受）益权的资产支持证券； 2) 不投资于资产支持证券次级份额； 3) 仅投资于在上海/深圳证券交易所挂牌和在中国银行间市场交易商协会注册的资产支持证券。 <p>(11) 本集合计划投资于科创板股票的比例按市值计算合计不超过计划资产净值的 30%；</p> <p>(12) 法律法规及中国证监会限制的其他行为。</p>
开放安排	<p>本集合计划自成立日起进每周第一个工作日为委托人办理参与、退出业务。</p>	<p>第五次合同变更生效后，本集合计划存续期内每周三为开放参与日，为投资者办理参与业务，如遇节假日则顺延至下一工作日；同时，每年 3 月、6 月、9 月和 12 月第一周的周三为开放退出日，为满足持有期限的投资者办理退出业务，如遇节假日则顺延至下一工作日。</p> <p>投资者参与本集合计划持有每笔份额的天数不得少于 180 个自然日(含 180 个自然日)，募集期参与的从成立日起计算持有期天数。本集合计划于上述开放退出日为投资者持有天数满 180 个自然日的份额办理退出业务(红利再投资而来的份额不受每笔份额持有天数不得少于 180 个自然日(含 180 个自然日)的限制)。</p>
最低参与金额	<p>首次参与的最低金额均为 40 万，追加参与的最低金额为 1000 元，不设金额级差。</p>	<p>首次参与的最低金额为 40 万（不含参与费用），追加参与的最低金额为 1 万元，不设金额级差。</p>
相关费用	<ol style="list-style-type: none"> 1、参与费：0% 2、退出费：0% 3、管理费：0.8% 4、托管费：0.1% 	<ol style="list-style-type: none"> 1、参与费：1%（根据公告可进行调减） 2、退出费：按持有期限划分 <ol style="list-style-type: none"> (1) D≤365 天：1% (2) D>365 天：0%

		<p>3、管理费：0.8%</p> <p>4、托管费：0.05%</p>
业绩报酬	<p>年化收益率 10%以上计提 10%作为管理人业绩报酬。</p>	<p>第五次合同变更生效前，本集合计划业绩报酬计提基准 B 为 10%，业绩报酬计提比例 X 为 10%；第五次合同变更生效后，管理人可以在集合计划存续期内调整业绩报酬计提基准 B 和业绩报酬计提比例 X，调整频率不超过一年一次且业绩报酬调整公告应于本合同约定的开放退出日前一工作日进行公告（不同意该次业绩报酬调整的投资者可于本合同约定的开放退出日退出），具体以管理人公告为准。本集合计划计提业绩报酬时，对符合业绩报酬提取条件的份额按照计提区间内适用的业绩报酬计提基准分段计算。</p>
其他	按合同最新模板调整相关表述。	

注：具体请以资产管理合同为准。