

# 长江证券（上海）资产管理有限公司 关于征求长江资管锦和 1 号集合资产管理计划 资产管理合同（修订版 4）变更意见的函

宁波银行股份有限公司：

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《长江资管锦和 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（修订版 3）（以下简称《合同》）的相关条款进行变更，主要变更内容为：

- 1、调整退出费；
- 2、调整业绩报酬原则及计提方法；
- 3、调整收益分配原则。

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、《长江资管锦和1号集合资产管理计划资产管理合同（修订版4）变更对照简表》

长江证券（上海）资产管理有限公司



2022030400009637 *R*

附件：

## 长江资管锦和 1 号集合资产管理计划 资产管理合同（修订版 4）变更对照简表

原条款位置	变更前	变更后	备注						
四、集合资产管理计划的基本情况	<p>四、集合资产管理计划的基本情况</p> <p>（十一）本集合计划的各项费用</p> <p>1、认购/申购费率：0；</p> <p>2、退出费率：见本合同第五章；</p> <p>3、管理费率：0.5%/年。</p> <p>4、托管费率：0.03%/年。</p>	<p>四、集合资产管理计划的基本情况</p> <p>（十一）本集合计划的各项费用</p> <p>1、认购/申购费率：0；</p> <p>2、退出费率：0；</p> <p>3、管理费率：0.5%/年。</p> <p>4、托管费率：0.03%/年。</p>	调整退出费；						
五、集合计划的参与和退出	<p>五、集合计划的参与和退出</p> <p>（二）集合计划的退出</p> <p>.....</p> <p>4、退出费及退出份额的计算</p> <p>（1）退出费</p> <p>本集合计划收取退出费。</p> <p>退出费于委托资金退出或集合计划终止时收取，管理人根据每笔委托资金持有期限设定退出费收取比例，具体如下：</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="text-align: center;">份额持有期限</th> <th style="text-align: center;">退出费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">0-180天</td> <td style="text-align: center;">0.9</td> </tr> <tr> <td style="text-align: center;">181-365天</td> <td style="text-align: center;">0.8</td> </tr> </tbody> </table>	份额持有期限	退出费率	0-180天	0.9	181-365天	0.8	<p>五、集合计划的参与和退出</p> <p>（二）集合计划的退出</p> <p>.....</p> <p>4、退出费及退出份额的计算</p> <p>（1）退出费：本集合计划不收取退出费。</p> <p>（2）退出金额的计算公式</p> <p><u>退出金额=退出份额×退出申请当日计划的单位净值-业绩报酬（如有）</u></p> <p><u>退出金额的计算保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的误差归入集合计划财产。</u></p> <p>.....</p>	调整退出费
份额持有期限	退出费率								
0-180天	0.9								
181-365天	0.8								

366-730天	0.5
731天(含)以上	0

当 $R \leq X$ , 退出费为0。

当 $R > X$ , 退出费的计算公式如下:

退出费= $[Q \times P \times (R - X) \times T / 365 - Y] \times$ 退出费率

其中:

退出费率指投资者实际持有期限对应的退出费率;

R为同一笔份额的期间年化收益率,具体参见“第十三章、集合计划的费用、业绩报酬”中关于期间年化收益率R的定义,即:R为同一笔份额的期间年化收益率;

X为本计划的业绩报酬计提基准,具体参见“第十三章、集合计划的费用、业绩报酬”中关于业绩报酬X的定义,即:X为本计划的业绩报酬计提基准。集合计划存续期间可对业绩报酬计提基准进行调整,具体以管理人公告为准;

Q为同一笔份额对应期间应计提业绩报酬的计划份额,具体参见“第十三章、集合计划的费用、业绩报酬”中关于份额Q的定义;

单位净值P及持有期间T具体参见“第十三章、集合计划的费用、业绩报酬”中关于P及T的定义,即P为该份额认购(或申购)时的集合计划单位净值,持有期间T为该份额自计划成立(或申购)至本业绩报酬计提日(含当日)的自然天数;

Y为计提的业绩报酬,具体参见“第十三章、集合计划的费用、业绩报酬”中关于计提的业绩报酬Y的定义,即:Y为计提的业绩报酬,Y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。同一笔退出包含参与时间不同的份额时分别计算业绩报酬。

(2) 退出金额的计算公式

退出金额=退出份额 $\times$ 退出申请当日本计划的单位净值-退出费-业绩报酬

	<p>(如有)</p> <p>退出金额的计算保留到小数点后两位, 小数点后第三位四舍五入, 由此产生的误差归入集合计划财产。</p> <p>.....</p>		
十三、集合计划的费用、业绩报酬	<p>十三、集合计划的费用、业绩报酬</p> <p>(四) 管理人的业绩报酬</p> <p>1、管理人收取业绩报酬的原则:</p> <p>(1) 同一投资者不同时间多次参与的, 对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率, 计提业绩报酬。</p> <p>(2) 在投资者份额退出日和计划终止份额退出日对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬。</p> <p>(3) 在投资者份额退出日或计划终止份额退出日提取业绩报酬的, 业绩报酬从退出资金或计划清算款中扣除。</p> <p>(4) 投资者申请退出时, 管理人按“先进先出”的原则, 即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额, 计算、提取退出份额对应的业绩报酬。</p> <p>(5) 投资者强制退出的份额和正常退出的份额一样收取业绩报酬。</p> <p>2、业绩报酬的计提方法</p> <p>管理人在投资者份额退出日和计划终止份额退出日计提业绩报酬, 业绩报酬以计提份额持有期间T的年化收益率R为基准计算。</p> <p>(1) 期间年化收益率R的计算方式</p> $R = \frac{A - P + D}{P} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ <p>其中A为业绩报酬计提日集合计划的单位净值, — P为该份额认购(或申购)时的集合计划单位净值, D为该份额认购(或申购)至</p>	<p>十三、集合计划的费用、业绩报酬</p> <p>(四) 管理人的业绩报酬</p> <p>1、管理人收取业绩报酬的原则:</p> <p>(1) 同一投资者不同时间多次参与的, 对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率, 计提业绩报酬。</p> <p>(2) 在收益分配的权益登记日, 投资者份额退出日和计划终止份额退出日对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬。</p> <p>(3) 在收益分配的权益登记日提取业绩报酬的, 业绩报酬从分红中扣除; 当分红额不足提取业绩报酬时, 以分红额为限。</p> <p>(4) 在投资者份额退出日或计划终止份额退出日提取业绩报酬的, 业绩报酬从退出资金或计划清算款中扣除。</p> <p>(5) 投资者申请退出时, 管理人按“先进先出”的原则, 即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额, 计算, 提取退出份额对应的业绩报酬。</p> <p>(6) 投资者强制退出的份额和正常退出的份额一样收取业绩报酬。</p> <p>2、业绩报酬的计提方法: 管理人在本集合计划权益登记日, 投资者份额退出日和计划终止份额退出日计提业绩报酬, 业绩报酬以计提份额持有期间T的年化收益率R为基准计算。</p> <p>(1) 期间年化收益率R的计算方式</p> $R = \frac{A - P + D}{P} \times \frac{365}{T} \times 100\%$	调整业绩报酬原则及计提方法



本业绩报酬计提日（含当日）已经发生的累计单位分红金额，持有期间 $T$ 为该份额自计划成立（或申购）至本业绩报酬计提日（含当日）的自然天数， $R$ 的计算在百分号内保留两位小数。

（2）业绩报酬的计算方法

业绩报酬计算方法为：

年化收益率	提取比例	业绩报酬公式
$R < X$	0	0
$R \geq X$	5%	$Y = Q \times P \times (R - X) \times 5\% \times T / 365$

其中：

$R$ 为同一笔份额的期间年化收益率；

$X$ 为本计划的业绩报酬计提基准。集合计划在存续期间可对业绩报酬计提基准进行调整，具体以推广期/开放期前管理人公告为准；

$Y$ 为计提的业绩报酬， $Y$ 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。同一笔退出包含参与时间不同的份额时分别计算业绩报酬；

$Q$ 为同一笔份额对应期间应计提业绩报酬的计划份额；

为免歧义，特别说明：本集合计划约定的业绩报酬计提基准，仅是管理人计提业绩报酬及退出费用的基准，并非管理人向投资者作出的预期收益，更非管理人向投资者做出保本保收益的承诺，管理人不得以任何方式向投资者作保本或保收益的承诺；

业绩报酬计提基准的调整频率和不得高于本集合计划的开放期频率，调整周期不短于该产品两次开放期的间隔时间，业绩报酬提取比例符合《运作规定》要求提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的60%的规定，业绩报酬计提频率符合《运作规定》要求提取频率不得超过6个月一次的规定，……

（3）业绩报酬计提方式

在集合计划份额退出日和集合计划终止份额退出日计提业绩报酬的，业绩报

其中 $A$ 为业绩报酬计提日集合计划的单位净值；

①若份额之前未被计提过业绩报酬，则 $P$ 为该份额认购（或申购）时的集合计划单位净值， $D$ 为该份额认购（申购）至本业绩报酬计提日（含当日）已经发生的累计单位分红金额，持有期间 $T$ 为该份额自计划成立（或申购）至本业绩报酬计提日（含当日）的自然天数；

②若份额之前被计提过业绩报酬，则 $P$ 为该份额最近一个业绩报酬计提日的单位净值， $D$ 为该份额最近一个业绩报酬计提日至本业绩报酬计提日（含当日）已经发生的累计单位分红金额，持有期间 $T$ 为该份额自最近一个业绩报酬计提日至本业绩报酬计提日（含当日）的自然天数；

③若份额之前因本集合计划分红被计提过业绩报酬，且该次分红距离计划终止日的间隔小于6个月，则该份额在本集合计划计划终止时不提取业绩报酬。

$R$ 的计算在百分号内保留两位小数。

（2）业绩报酬的计算方法

业绩报酬计算方法为：

年化收益率	提取比例	业绩报酬公式
$R < X\%$	0	0
$R \geq X\%$	$B\%$	$Y = Q \times P \times (R - X\%) \times B\% \times T / 365$

其中：

$R$ 为期间年化收益率；

$X\%$ 为本计划的业绩报酬计提基准。本计划初始成立时确定的业绩报酬计提基准将在本计划发行时通过管理人公告的形式予以确定。本计划在存续期间管理人有权根据相关监管规定，调整业绩报酬计提基准，具体以管理人公告为准；

$B$ 为本计划业绩报酬计提比例，管理人有权根据相关监管规定，调整业绩报酬计提比例，具体以每次开放期前管理人公告为准。提取比例

	<p>酬从退出资金或清算资金中扣除。投资者多次参与集合计划的，退出份额采取“先进先出”原则。投资者强制退出的份额和正常退出的份额一样收取业绩报酬。</p>	<p>不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的60%； Y为计提的业绩报酬； Q为应计提业绩报酬的计划份额。 Y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。同一笔退出包含参与时间不同的份额时分别计算业绩报酬。 为免歧义，特别说明：本集合计划约定的业绩报酬计提基准，仅是管理人计提业绩报酬的基准，并非管理人向投资者作出的预期收益，更非管理人向投资者做出保本保收益的承诺。管理人不得以任何方式向投资者作保本或保收益的承诺。 (3) 业绩报酬计提方式 在集合计划收益分配的权益登记日计提业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；当分红额不足提取业绩报酬时，以分红额为限。 在集合计划份额退出日和集合计划终止份额退出日计提业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。投资者多次参与集合计划的，退出份额采取“先进先出”原则。投资者强制退出的份额和正常退出的份额一样收取业绩报酬。</p>	
<p>十四、集合计划的收益分配</p>	<p>十四、集合计划的收益分配 …… (三) 收益分配原则 1、每份集合计划份额享有同等分配权； 2、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配； 3、收益分配基准日的单位净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值； 4、集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益孰低数； 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>	<p>十四、集合计划的收益分配 …… (三) 收益分配原则 1、每份集合计划份额享有同等分配权； 2、当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配； 3、收益分配基准日的单位净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值； 4、集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益孰低数； 5、两次相邻的分红之间的时间间隔需大于6个月；</p>	<p>调整收益分配原则</p>

		6. 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。	
--	--	-------------------------	--



## 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锦和1号集合资产管理计划资产管理合同（修订版4）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。

