

长江证券（上海）资产管理有限公司  
关于征求长江资管尊享4号集合资产管理计划  
资产管理合同（修订版3）变更意见的函

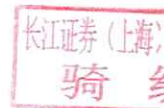
中国工商银行股份有限公司江苏省分行：

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《长江资管尊享4号集合资产管理计划资产管理合同（修订版2）》（以下简称《合同》）的相关条款进行变更，主要变更内容为：

- 1、调整投资范围和投资限制；
- 2、修改参与金额级差；
- 3、调整调整部分投资品种估值方式。

主要变更内容见附件中合同的变更对照表。

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，在管理人网站向委托人公告征询意见，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、《长江资管尊享4号集合资产管理计划资产管理合同（修订版3）变更对照简表》

长江证券（上海）资产管理有限公司

2022年6月6日



## 长江资管尊享4号

### 集合资产管理计划资产管理合同（修订版3）变更对照简表

原条款位置	变更前	变更后	备注
五、集合资产管理计划的基本情况	<p><b>五、集合资产管理计划的基本情况</b></p> <p>（四）投资范围和投资比例</p> <p>2、投资范围</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、资产支持证券（ABS）、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；</p> <p>权益类资产：包括国内依法发行的股票（含科创板股票、新股申购、定向增发、港股通标的股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、股票型基金、混合型基金、ETF、LOF等；</p> <p>金融衍生工具：国债期货。</p> <p>本计划属于固定收益类集合资产管理计划，产品通过主要投资于债权类资产构建投资组合，符合《运作规定》组合投资的要求。</p> <p>本计划可投资于债券正回购，债券回购为提升组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。</p> <p>.....</p> <p>（十）本集合计划的推广</p>	<p><b>五、集合资产管理计划的基本情况</b></p> <p>（四）投资范围和投资比例</p> <p>2、投资范围</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、<u>二级资本债</u>）、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、资产支持证券（ABS）、资产支持票据（ABN）、<u>非公开债</u>、非公开定向债务融资工具（PPN）、<u>项目收益债</u>、<u>永续债</u>、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>权益类资产：包括国内依法发行的股票（含<u>主板</u>、<u>创业板</u>、<u>科创板</u>股票、新股申购、定向增发、港股通标的股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、股票型基金、混合型基金、ETF、LOF等；</p> <p>金融衍生工具：国债期货。</p> <p>本计划属于固定收益类集合资产管理计划，产品通过主要投资于债权类资产构建投资组合，符合《运作规定》组合投资的要求。</p> <p>本计划可<u>参与</u>债券正回购，债券回购为提升组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。</p> <p>.....</p> <p>（十）本集合计划的推广</p>	调整投资范围

资产  
逢

	<p>(1) 直销机构  名称：长江证券（上海）资产管理有限公司  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  办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1198 号世纪汇一座 27 层  法定代表人：周纯  联系人：蒋媛媛  电话：021-80301224  传真：021-80301399  客户服务电话：4001-166-866  网址：www.cjzcg1.com</p> <p>(2) 代销机构  名称：长江证券股份有限公司  注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号  办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号  法定代表人：李新华  客户服务电话：95579  网址：www.95579.com</p> <p>管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点。各销售机构提供的销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。</p> <p>.....</p>	<p>1、销售机构</p> <p>(1) 直销机构  名称：长江证券（上海）资产管理有限公司  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  办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1198 号世纪汇一座 27 层  法定代表人：周纯  联系人：邓凌雯  电话：021-80301342  传真：021-80301399  客户服务电话：4001-166-866  网址：www.cjzcg1.com</p> <p>(2) 代销机构  名称：长江证券股份有限公司  注册地址：湖北省武汉市新华路特 8 号  办公地址：湖北省武汉市新华路特 8 号  法定代表人：金才玖  客户服务电话：95579  网址：www.95579.com</p> <p>管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点。各销售机构提供的销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。</p> <p>.....</p>	<p>调整法定代表人或授权代理人信息</p>
<p>六、资产管理计划的募集</p>	<p>六、资产管理计划的募集</p> <p>.....</p> <p>(三) 资产管理计划的最低认购金额、支付方式等  首次认购本计划的最低金额为人民币 30 万元，追加认购的最低金额为人民币 1</p>	<p>六、资产管理计划的募集</p> <p>.....</p> <p>(三) 资产管理计划的最低认购金额、支付方式等  首次认购本计划的最低金额为人民币 30 万元，追加认购的最低金额为人民币 1</p>	<p>调整参与金额级差</p>



	万元，首次及追加认购金额级差为1万元人民币。法律法规另有规定的，从其规定。 .....	万元，不设参与金额级差。法律法规另有规定的，从其规定。 .....	
八、资产管理计划的参与、退出与转让	<p><b>八、资产管理计划的参与、退出与转让</b></p> <p>(一) 集合计划的参与和退出 .....</p> <p>4、参与和退出的方式、价格、程序及确认 .....</p> <p>(3) 参与和退出的数量限制 投资者首次参与本集合计划的最低金额为人民币 30 万元，追加参与本集合计划的最低金额为 1 万元，首次及追加参与金额级差为 1 万元。 .....</p>	<p><b>八、资产管理计划的参与、退出与转让</b></p> <p>(一) 集合计划的参与和退出 .....</p> <p>4、参与和退出的方式、价格、程序及确认 .....</p> <p>(3) 参与和退出的数量限制 投资者首次参与本集合计划的最低金额为人民币 30 万元，追加参与本集合计划的最低金额为 1 万元，不设参与金额级差。 .....</p>	修改参与金额级差
十一、资产管理计划的投资	<p><b>十一、资产管理计划的投资</b></p> <p>(二) 投资范围和投资比例</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、集合票据、集合债券、资产支持证券（ABS）、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；</p> <p>权益类资产：包括国内依法发行的股票（含科创板股票、新股申购、定向增发、港股通标的股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、股票型基金、混合型基金、ETF、LOF 等；</p> <p>金融衍生工具：国债期货。</p> <p>本计划属于固定收益类集合资产管理计划，产品通过主要投资于债权类资产构建</p>	<p><b>十一、资产管理计划的投资</b></p> <p>(二) 投资范围和投资比例</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、<u>二级资本债</u>）、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、资产支持证券（ABS）、资产支持票据（ABN）、<u>非公开债</u>、非公开定向债务融资工具（PPN）、<u>项目收益债</u>、<u>永续债</u>、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>权益类资产：包括国内依法发行的股票（含<u>主板</u>、<u>创业板</u>、<u>科创板股票</u>、新股申购、定向增发、港股通标的股票及其他经中国证监会核准上市的股票）、股票型基金、混合型基金、ETF、LOF 等；</p> <p>金融衍生工具：国债期货。</p>	调整投资范围

	<p>投资组合，符合《运作规定》组合投资的要求。</p> <p>本计划可投资于债券正回购，债券回购为提升组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。</p> <p>.....</p> <p>(七) 投资限制和投资禁止</p> <p>1、本集合计划的投资限制包括：</p> <p>.....</p> <p>(2) 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%，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%；</p> <p>(3) 集合计划所投资信用债的主体或债项评级不得低于 AA；（中债资信不纳入参考）</p> <p>.....</p>	<p>本计划属于固定收益类集合资产管理计划，产品通过主要投资于债权类资产构建投资组合，符合《运作规定》组合投资的要求。</p> <p>本计划可参与债券正回购，债券回购为提升组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。</p> <p>.....</p> <p>(七) 投资限制和投资禁止</p> <p>1、本集合计划的投资限制包括：</p> <p>.....</p> <p>(2) 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%，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%；<u>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；</u></p> <p>(3) 集合计划所投资信用债的主体或债项评级<u>需高于或等于</u>AA；（中债资信不纳入参考）</p> <p>.....</p>	调整计划投资限制
十五、投资经理的指定与变更	<p>十五、投资经理的指定与变更</p> <p>本计划的投资经理由管理人负责指定。</p> <p>本计划的投资经理基本信息如下：</p> <p>姓名：柳祚勇</p> <p>从业简历：13年从业经验，2006年6月进入长江证券，曾在固定收益总部、资产管理总部从事过债券研究、行业研究、宏观与策略研究等工作，历任长江证券超越理财龙腾1号、稳健增利、可转债、增强债券、乐享1天、年年盈系列等产品投资经理。现任长江资管固定收益投资部总经理。</p> <p>学历：武汉大学金融学硕士。</p> <p>兼职情况：无。</p>	<p>十五、投资经理的指定与变更</p> <p>本计划的投资经理由管理人负责指定。</p> <p>本计划的投资经理基本信息如下：</p> <p>.....</p>	删减一位投资经理



	<p>是否取得基金从业资格：是。</p> <p>最近三年是否被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚：否。</p>		
<p>十九、资产管理计划财产的估值和会计核算</p>	<p>十九、资产管理计划财产的估值和会计核算</p> <p>(三) 估值方法：</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值方法：</p> <p>(1) 证券交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）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；</p> <p>(2) 证券交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；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；</p> <p>(3) 证券交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的债券收盘价减去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；</p> <p>(4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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>(5) 对手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>2、处于未上市期间的有价证券的估值方法应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同</p>	<p>十九、资产管理计划财产的估值和会计核算</p> <p>(三) 估值方法：</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，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；</p> <p>(2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日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；</p> <p>(3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；</p> <p>(4) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价，并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；</p> <p>(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值；</p> <p>(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对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估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同</p>	<p>调整部分投资品种估值方式</p>

<p>一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票、债券,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>(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在证券交易所上市后,按证券交易所上市的同一股票的收盘价估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>3、银行间市场交易的固定收益品种的估值</p> <p>(1)银行间市场交易的固定收益品种,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;</p> <p>(2)对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种,按成本估值;</p> <p>(3)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,按成本估值。</p> <p>4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的,按证券所处的市场分别估值。</p> <p>5、证券投资基金的估值方法:</p> <p>(1)上市流通的证券投资基金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;</p> <p>(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;</p>	<p>一股票的估值方法估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;</p> <p>(2)首次公开发行未上市的股票、债券,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>(3)在发行时明确一定期限限售期的股票,包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份等,不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票,按以下方法估值:</p> $FV = S \times (1 - LoMD)$ <p>其中:</p> <p>FV:估值日该流通受限股票的价值</p> <p>S:估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值</p> <p>LoMD:该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣</p> <p>股票的锁定期起始日及估值起始日为上市公司发布公告日。</p> <p>3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种,回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。</p> <p>4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的,按证券所处的市场分别估值。</p> <p>5、投资证券投资基金的估值方法</p> <p>1)上市流通的证券投资基金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。</p> <p>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。</p>	
--	---	--



	<p>(3) 持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司的每万份收益计算。</p> <p>6、存款的估值方法 持有的银行存款（协议存款、定期存款及其他银行存款）以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。</p> <p>7、本计划投资国债期货衍生品品种合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</p> <p>8、债券逆回购的估值方法 持有的债券逆回购以本金列示，按约定利率逐日确认利息收入。</p> <p>9、债券正回购交易的估值方法 以成本列示，按商定利率，在实际持有期间内逐日计算利息。</p> <p>.....</p>	<p>3) 持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计算。</p> <p>4) 场内持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的，按照第 1) 条规定的方法估值；不能在交易所交易的，按照第 2) 条规定的方法估值。</p> <p>5) 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。</p> <p>6、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。</p> <p>7、债券逆回购的估值方法 持有的债券逆回购以本金列示，按约定利率逐日确认利息收入。</p> <p>8、债券正回购交易的估值方法 以成本列示，按商定利率，在实际持有期间内逐日计算利息。</p> <p>9、本计划投资国债期货衍生品品种合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</p> <p>.....</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尊享4号集合资产管理计划资产管理合同（修订版3）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。

中国工商银行股份有限公司江苏省分行  
年 月 日

