

银河金汇证券资产管理有限公司

关于修改银河智汇FOF1号集合资产管理计划 资产管理合同、说明书、风险揭示书等材料生效的公告

尊敬的投资者：

银河金汇证券资产管理有限公司管理的“银河智汇FOF1号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）成立于2019年6月6日。根据管理人投资运作需要，对本集合计划的资产管理合同、说明书、风险揭示书等材料中部分条款进行修改，同时就资产管理合同、说明书、风险揭示书等材料变更事宜进行公告并向投资者征询意见。

截至2022年10月18日，全部投资者同意本次资产管理合同、说明书、风险揭示书等材料的变更，并签署补充协议，符合本集合计划存续条件。

因此，自本公告发布之日起，本集合计划资产管理合同、说明书、风险揭示书等材料修改内容正式变更生效。

特此公告。

附件：

1、“银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划”资产管理合同、说明书、风险揭示书等材料主要变更内容对照表

2、关于发布《关于修改“银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划”资产管理合同、说明书、风险揭示书等材料征求投资者意见函》的公告及管理人、托管人已达成一致的公告

3、银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同（202209）；

4、银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同补充协议（202209）；

5、银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划说明书（202209）；

6、银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书（202209）；

银河金汇证券资产管理有限公司

2022 年 10 月 18 日

附件 1：“银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划”资产管理合同等材料主要变更内容对照表（说明书、风险揭示书、托管协议内相关条款一并修改）

1、对合同内部分产品要素进行修改：

（1）原合同第 5 部分“集合计划的基本情况”中“四、封闭期、开放期”：

原条款：	现条款：
<p>2、开放期：</p> <p>本集合计划的开放期分为参与开放期和退出开放期。</p> <p>参与开放期的开放日为自本集合计划成立之日起，每个自然月的 15 日（非工作日顺延至下一个工作日）。</p> <p>退出开放期的开放日为自本集合计划成立之日起，每年 1 月 15 日、4 月 15 日、7 月 15 日、10 月 15 日（非工作日顺延至下一个工作日）。</p>	<p>2、开放期：</p> <p>本集合计划的开放期分为参与开放期和退出开放期。</p> <p>参与开放期：每周一至周二为本集合计划每个开放期的开放日（如遇非工作日当天不开放）；</p> <p>退出开放期：每个自然月的最后一个工作日办理退出。</p> <p>如参与开放期与退出开放期重合，则本计划在重合开放期内既可参与也可退出。</p>

（2）原合同第 5 部分“集合计划的基本情况”

原条款：	现条款：
<p>六、投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级内容详见本产品合同第 11 部分“资产计划的投资”。</p> <p>七、存续期限</p> <p>本集合计划存续期限为自成立之日起【10】年（可展期）。</p>	<p>六、投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级</p> <p>1、投资目标</p> <p>【本集合计划拟重点精选具有成熟策略的证券投资类金融产品、金融衍生品等资产，努力控制投资风险，力争实现投资资产的稳健增值。</p> <p>上述投资目标仅供委托人参考，不构成管理人保证委托人委托资产本金不受损失或取得投资收益的承诺。】</p>

2、主要投资方向

本集合计划可投资如下资产：

（1）现金类资产：包括现金、银行存款（包括同业存款）、货币市场基金等。

（2）投资于股权类资产、商品及金融衍生品类资产、债权类资产等资产的金融产品：主要包括在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的量化对冲类私募证券投资基金、套利类私募证券投资基金、量化指数增强类私募证券投资基金、商品及金融衍生品类私募投资基金，证券投资类集合资金信托计划等金融产品。金融产品的底层资产，不投资于非标准化股权类资产和非标准化债权类资产、非标准化衍生品类资产。

特别的，投资者在此同意并授权可以将集合计划资产部分或全部投资于由管理人关联方（及其母公司的关联方）发行或代销或管理的金融产品，以及由管理人提供专业服务（包括但不限于作为管理人等）的金融产品；但管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循投资者利益优先原则，事后告知投资者和托管人，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。从事重大关联交易，交易应当遵守法律法规、行政法规、中国证监会的规定和合同约定。管理人应当遵循客户利

益优先原则，交易完成后，管理人应在5个工作日内书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人。管理人以本集合计划资产从事重大关联交易，应向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。

（3）金融衍生品类资产：股指期货，主要用于对冲风险。在满足法律法规或监管部门要求的前提下，经管理人、托管行一致同意，在履行适当书面程序后，可以相应调整本产品的投资标的范围。

本集合计划投资非标准化资产的，应当穿透披露具体投资标的，暂未确定具体投资标的的，应当至少每季度于季度报告中进行披露。如涉及关联交易，将一并披露关联交易相关情况。

3、投资比例

（1）现金类资产的比例为资产管理计划总资产的0-20%；

（2）投资于股权类资产、商品及金融衍生品类资产、债权类资产等资产的资产管理产品的比例为资产管理计划总资产的80-100%；

（3）金融衍生品类资产的比例为资产管理计划总资产的0-20%。

以上资产穿透至底层并分类汇总后，股权类资产占集合计划资产总值比例为

	<p>80%-100%，债权类资产、商品及金融衍生品类资产合计占集合计划资产总值比例为 0-20%。上述投资比例符合《运作规定》组合投资的要求。</p> <p>4、产品风险等级</p> <p>管理人根据相关法律法规及其内部相关制度规定，将本集合计划的风险评级评价为【中高】，且根据前述风险评级，本集合计划适合向合格投资者中的专业投资者和风险承受能力评估结果为【相对积极型、积极型】的普通投资者销售。但法律法规及销售机构另有规定的除外。</p> <p>七、存续期限</p> <p>本集合计划存续期限为自成立之日起【10】年。</p>
--	---

(3) 原合同第 11 部分“集合计划的投资”中“二、投资范围及比例”：

原条款：	现条款：
<p>1、投资范围</p> <p>本集合计划可投资如下资产：</p> <p>(1) 现金类资产：包括现金、银行存款（包括同业存款）、货币市场基金等。</p> <p>(2) 投资于股权类资产、商品及金融衍生品类资产、债权类资产等资产的金融产品：主要包括在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的量化对冲类私募证券投资基金、套</p>	<p>1、投资范围</p> <p>本集合计划可投资如下资产：</p> <p>(1) 现金类资产：包括现金、银行存款（包括同业存款）、货币市场基金等。</p> <p>(2) 投资于股权类资产、商品及金融衍生品类资产、债权类资产等资产的金融产品：主要包括在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的量化对冲类私募证券投资基金、套</p>

利类私募证券投资基金、量化指数增强类私募证券投资基金、商品及金融衍生品类私募投资基金，证券投资类集合资金信托计划等金融产品。金融产品的底层资产，不投资于非标准化股权类资产和非标准化债权类资产。

特别的，投资者在此同意并授权可以将集合计划资产部分或全部投资于由管理人关联方（及其母公司的关联方）发行或代销或管理的金融产品，以及由管理人提供专业服务（包括但不限于作为管理人、**投资顾问**等）的金融产品；但管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循投资者利益优先原则，事后告知投资者和托管人，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。从事重大关联交易，交易应当遵守法律法规、行政法规、中国证监会的规定和合同约定。管理人应当遵循客户利益优先原则，交易完成后，管理人应在5个工作日内书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人。管理人以本集合计划资产从事重大关联交易，应向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。

(3) 金融衍生品类资产：**场外看跌期权**、股指期货，主要用于对冲风险。

利类私募证券投资基金、量化指数增强类私募证券投资基金、商品及金融衍生品类私募投资基金，证券投资类集合资金信托计划等金融产品。金融产品的底层资产，不投资于非标准化股权类资产和非标准化债权类资产、**非标准化衍生品类资产**。

特别的，投资者在此同意并授权可以将集合计划资产部分或全部投资于由管理人关联方（及其母公司的关联方）发行或代销或管理的金融产品，以及由管理人提供专业服务（包括但不限于作为管理人等）的金融产品；但管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循投资者利益优先原则，事后告知投资者和托管人，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。从事重大关联交易，交易应当遵守法律法规、行政法规、中国证监会的规定和合同约定。管理人应当遵循客户利益优先原则，交易完成后，管理人应在5个工作日内书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人。管理人以本集合计划资产从事重大关联交易，应向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。

(3) 金融衍生品类资产：**股指期**

<p>特别的，投资者同意并授权管理人可以代表本集合计划与管理人母公司中国银河证券股份有限公司签署场外期权相关协议。</p> <p>在满足法律法规或监管部门要求的前提下，经管理人、托管行一致同意，在履行适当书面程序后，可以相应调整本产品的投资标的范围。</p> <p>【本集合计划投资非标准化资产的：本集合计划为 FOF 产品，于设立之时，暂未确定金融产品方面的具体投资标的。本集合计划将于成立之后、并完成金融产品投资后的 5 个工作日内，以公告的方式在管理人网站披露投资标的。如涉及关联交易，将一并披露关联交易相关情况】：</p>	<p>货，主要用于对冲风险。在满足法律法规或监管部门要求的前提下，经管理人、托管行一致同意，在履行适当书面程序后，可以相应调整本产品的投资标的的范围。</p> <p>本集合计划投资非标准化资产的，应当穿透披露具体投资标的，暂未确定具体投资标的的，应当至少每季度于季度报告中进行披露。如涉及关联交易，将一并披露关联交易相关情况。</p>
--	--

(4) 原合同第 11 章“集合计划的投资”：

<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>二、投资范围及比例</p> <p>3、资产管理计划改变投向和比例的，新增上述投资范围外的投资品种或各类型资产投资比例的，应当事先取得投资者同意，由全体投资者、管理人和托管人协商一致并签署补充协议对本章节内容进行变更。</p>	<p>二、投资范围及比例</p> <p>3、资产管理计划改变投向和比例的，新增上述投资范围外的投资品种或各类型资产投资比例的，应当事先取得投资者同意，按照本合同第 24 部分约定履行合同变更程序。</p>
<p>原条款：</p>	<p>现条款：</p>
<p>八、投资限制及禁止行为</p> <p>(一) 投资限制</p>	<p>八、投资限制及禁止行为</p> <p>(一) 投资限制</p> <p>增加下述条款：</p>

	7、本计划资产组合中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该资产管理计划资产净值的 20%。
--	---

(5) 原合同第 20 部分“集合计划的费用、业绩报酬”：

原条款：	现条款：
<p>四、管理人提取业绩报酬（含增值税，计入管理费）</p> <p>1、管理人计提业绩报酬的原则</p> <p>（1）对委托人持有份额及退出份额（包括由于合同变更导致的份额退出）按份额认(申)购时间的不同，分别计算的每笔份额的实际年化收益率（R）计提业绩报酬。</p> <p>（2）本集合计划业绩报酬计提日为委托人份额退出日或本集合计划终止日（含二次清算终止日，下同）。在本集合计划终止日，对集合计划中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬；在委托人份额退出日，仅对退出份额中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬。</p> <p>（3）集合计划终止日符合业绩报酬计提条件的，管理人先计提业绩报酬，再分配剩余资金。在委托人份额退出日符合业绩报酬计提条件的，管理人应先将委托人申请退出的份额所对应的业绩报酬从退出金额中扣除后，再向委托人分配退出款。</p>	<p>四、管理人提取业绩报酬（含增值税，计入管理费）</p> <p>1、业绩报酬</p> <p>业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”：在两类情况下管理人将根据资产委托人的收益情况对本计划提取业绩报酬，一类是资产委托人申请退出或本计划终止时提取业绩报酬；另一类是分红时提取业绩报酬。</p> <p>当计划份额退出、计划终止或分红时，管理人将提取退出份额或分红份额当期超过年化收益 3.5%盈利部分的 10% 作为业绩报酬。如本次计划分红时间距上次分红时间（如有）不足 6 个月（每月按 30 个自然日计算），则本次计划分红不对资产管理计划份额计提业绩报酬。</p> <p>本集合计划业绩报酬提取频率原则上不得超过每 6 个月一次，但因投资者退出集合计划（含本集合计划终止时投资者退出），管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的除外。</p> <p>业绩报酬的计提方法如下：</p>

(4) 本集合计划业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次,但因投资者退出集合计划、本集合计划终止,管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的除外。

2、业绩报酬的计提方法

管理人于业绩报酬计提日,将按份额认(申)购时间的不同,针对委托人每笔份额分别核算其业绩报酬核算期。业绩报酬核算期是指针对委托人所持有的每笔份额,上一个管理人实际计提了业绩报酬的业绩报酬计提日(以下简称:上一业绩报酬计提日;如上一个业绩报酬计提日不存在,则为本集合计划成立日或委托人该笔份额申购确认日)至本次业绩报酬计提日期间。

管理人根据当个业绩报酬核算期的委托人每笔份额实际年化收益率(R)情况,分段计提业绩报酬(H),委托人所持份额以认(申)购时间的不同分别进行业绩报酬的核算和计提,具体计提规则如下:

实际年化收益	计提比例	业绩报酬(H)计算规则
$R \leq r$	0	$H=0$
$R > r$	10%	$H = [(R-r) \times 10\%] \times C \times N / 365$

其中:

$$R = \frac{P_1 - P_0}{P} \times \frac{365}{N} \times 100\%$$

P1 为业绩报酬计提日的集合计划

当资产委托人申请退出、计划分红或本计划终止时,管理人根据资产委托人每一计划份额的收益率(R)提取业绩报酬。经计算确认的业绩报酬从资产委托人退出、计划分红款或计划清算款中以现金支付。

其中,计划分红时计划参与份额(红利转投份额)的参与日重定为上一个业绩报酬提取日。当分红款少于业绩报酬,则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时,当分红款少于业绩报酬,管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。

A=退出日、分红除权日或计划终止日计划累计份额净值;

C=上一个业绩报酬提取日计划累计份额净值;若“上一个业绩报酬提取日”不存在,则C为该份额参与开放日计划份额累计净值(参与份额)或计划份额初始面值(认购份额);

D=上一个业绩报酬提取日计划份额净值;若“上一个业绩报酬提取日”不存在,则D为该份额参与开放日计划份额净值(参与份额)或计划份额初始面值(认购份额);

E=业绩报酬;

F=退出份额或分红除权日持有份额;

T=上一个业绩报酬计提确认日至

<p>单位累计净值；</p> <p>P0 为上一业绩报酬计提日（若该笔份额无上一业绩报酬计提日的，则为集合计划认购日或委托人该笔份额申购日）集合计划的单位累计净值；</p> <p>P 为上一业绩报酬计提日（若该笔份额无上一业绩报酬计提日的，则为集合计划认购日或委托人该笔份额申购日）集合计划的单位净值；</p> <p>N 为该笔份额当个业绩报酬核算期的天数；</p> <p>C 为委托人该笔份额的成本=认（申）购时的集合计划单位净值*认（申）购份额；</p> <p>r 为业绩报酬计提基准，数值为 3.5%。</p> <p>本集合计划的业绩报酬计提基准，仅作为管理人提取业绩报酬的基准，不构成管理人保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺，不构成管理人的投资业绩预测，不构成预期收益率。</p> <p>业绩报酬计提日为本集合计划终止日的，管理人的业绩报酬为符合业绩报酬计提条件的全部份额根据上述约定计算的业绩报酬之和；业绩报酬计提日为委托人份额退出日的，管理人的业绩报酬为符合业绩报酬计提条件的全部退出份额根据上述约定计算的业绩</p>	<p>本业绩报酬计提确认日的自然天数；若“上一个业绩报酬计提确认日”不存在，则为该份额参与确认日；</p> <p>$E_{(i, j)}$：上一次计划分红除权日至本次计划分红除权日的存续自然天数（算头不算尾）；</p> <p>年 化 收 益 率</p> $R = (A - C) / D \times 365 / T \times 100\%$ <p>业绩报酬计提标准（针对分红时提取报酬须额外满足条件 $E_{(i, j)} \geq 6$ 个月，每月按 30 个自然日计算，但对首次通过分红时提取业绩报酬则无需满足本条件）：</p> <p>当 $R > 3.5\%$ 时，对超过 3.5% 的收益部分提取 10% 的业绩报酬，即：</p> $E = F \times D \times ((A - C) / D \times 365 / T - 3.5\%) \times T / 365 \times 10\%$ <p>当 $R \leq 3.5\%$ 时，则不提取业绩报酬。</p> <p>如果管理人已经提取业绩报酬，即使资产委托人退出时净值有所下跌，则该部分已提取的业绩报酬将不退还资产委托人。</p> <p>业绩报酬在资产委托人分红、退出时或本计划清算时由资产管理人负责计算，资产托管人不承担复核义务。业绩报酬从资产委托人的退出资金、分红款或清算资金中扣除后支付，由资产管理人向资产托管人发送业绩报酬划付指令，资产托管人根据资产管理人指令</p>
--	--

<p>报酬之和。</p> <p>如管理人已经提取业绩报酬，即使投资者退出本集合计划时净值有所下跌，则该部分已提取业绩报酬亦不退还投资者。业绩报酬在业绩报酬计提日计提，由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人复核后据此计提应付管理人业绩报酬。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</p>	<p>要求进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。</p> <p>特别提示：本计划设置的业绩报酬计提基准并不构成对资产委托人投资本金不受损失或者取得最低或任何其他程度投资收益或者限定损失金额和比例的承诺。</p>
--	---

(6) 原合同第 21 部分“投资收益与分配”：

<p>原条款：</p> <p>存续期间，本集合计划不分红。</p>	<p>现条款：</p> <p>(一) 资产管理计划利润的构成</p> <p>资产管理计划利润指计划利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入扣除相关费用后的余额，资产管理计划已实现收益指计划利润减去公允价值变动损益后的余额。</p> <p>(二) 可供分配利润</p> <p>资产管理计划可供分配利润指截至收益分配基准日资产负债表中“未分配收益”与“未分配收益中已实现”的孰低数。</p> <p>(三) 资产管理计划收益分配原则</p> <p>1、在符合有关计划分红条件的前提下，管理人有权决定是否对计划进行收益分配，收益分配的基准、次数、比例、时间亦由管理人决定；</p>
--	--

2、本计划的收益分配采取红利再投资等方式，红利再投资是将现金红利按照计划分红除权日的计划份额净值自动转为计划份额；

3、资产管理计划收益分配后计划份额净值不能低于面值；即计划收益分配基准日的计划份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一资产管理计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案

资产管理计划收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、资产管理计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（五）收益分配方案的确定、通知与执行方式

1、本资产管理计划收益分配方案由管理人拟定，并由管理人在托管人复核后以约定的形式通知计划份额持有人。

2、在收益分配方案通知资产管理计划份额持有人后，资产管理计划份额持有人所转换的资产管计划份额将以分红除权日的计划份额净值为计算基

	<p>准确定再投资份额，红利再投资所转换的资产管理计划份额将直接记入其资产管理计划账户。</p>
--	--

(7) 原合同第 24 部分“合同的变更、展期、终止与财产清算”：

原条款：	现条款：
<p>一、合同的变更</p>	<p>一、合同的变更</p> <p>增加下述条款：</p> <p>7、全体投资者和托管人同意：</p> <p>（1）尽管本合同有其他约定，但管理人有权调低参与费率和退出费率，并在管理人网站公告，而不需要另行征求投资者和托管人意见。</p> <p>（2）尽管本合同有其他约定，但经托管人书面回意，管理人有权根据市场情况调低托管费率和支付频率，并在管理人网站公告，而不需要另行征求投资者意见。</p> <p>（3）尽管本合同有其他约定，但管理人有权根据市场情况调低管理费费率和支付频率，并在管理人网站公告，而不需要另行征求投资者和托管人意见，但应当书面告知托管人。</p>

2、对合同内部分产品要素进行修改：

- (1) 更新原合同第 4 部分“管理人注册信息及联系人”内容；
- (2) 原合同第 8 部分“参与的办理时间”、“退出的办理时间”有关参与开放期及退出开放期内容参照合同第 5 部分开放期修改的内容一并予以修改；
- (3) 原合同第 11 部分“投资策略”根据合同第 11 部分投资范围的修改予以修

改；

(4) 原合同第 14 部分“利益冲突及关联交易”原有关场外期权关联交易的约定根据合同第 11 部分投资范围的修改予以修改；

(5) 原合同第 15 部分根据集合计划前期已发布公告更新投资经理信息；

(6) 原合同第 19 部分“集合计划财产的估值和会计核算”、第 22 部分“信息披露与报告”、第 23 部分“风险揭示”，根据上述投资范围及投资限制修改，同步修改涉及场外期权的相应内容等；

(7) 第 27 部分“合同的成立与生效”中“三、合同期限”同步删除“到期可展期”的内容；

(8) 增加第 28 部分“反商业贿赂”及第 29 部分“个人信息处理”内容等。

3、管理人同时调整原合同说明书、风险揭示书及托管协议内涉及以上修改内容的条款，具体以变更后的《银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同（202209）》、《银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同补充协议（202209）》、《银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划说明书（202209）》、《银河智汇 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书（202209）》为准。