

关于申港证券睿盈8号集合资产管理计划 资产管理合同变更投资者意见征询函

尊敬的投资者：

申港证券股份有限公司（以下简称“我司”或“申港证券”）管理的“申港证券睿盈8号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）于2022年1月26日成立。根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理计划备案办法》等有关规定并结合本集合计划运作管理需要，我司拟变更部分合同条款，并已按照本集合计划合同约定与托管人书面达成一致，现根据《申港证券睿盈8号集合资产管理计划资产管理合同》第二十四章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”之第（一）节“资产管理合同变更的条件和程序”约定：

“1、因法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人书面协商一致后修改资产管理合同，并由管理人以指定网站公告的方式及时向投资者披露变更的具体内容。如投资者对变更的内容有异议，可以根据管理人的安排申请退出本集合计划；未在管理人指定的期限内申请退出其持有的全部集合计划份额，视为同意本集合计划变更，管理人不再另行通知。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致，并由管理人以指定网站公告方式或书面等形式通知投资者。投资者不同意变更的，有权在管理人指定的期限内申请退出其持有的全部集合计划份额，管理人应为其办理退出手续；投资者在上述指定期限内未申请退出其持有的全部集合计划份额的，视为投资者同意资产管理合同变更，管理人不再另行通知。投资者同意，无论其是否提出退出申请，按照上述约定进行的资产管理合同变更均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。若前述指定期限与产品开放期重合，则投资者在上述指定期限内根据资产管理合同约定参与集合计划的，视为同意资产管理合同变更并接受变更后的资产管理合同。资产管理合同变更自上述指定期限届满后次日或管理人公告中指定的资产管理合同变更生效日起生效。



3、集合计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意，并按上述规定履行资产管理合同变更程序。”

一、合同变更的内容

1、合同第一章“前言”更新为：

为规范申港证券睿盈8号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）运作，明确《申港证券睿盈8号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“资产管理合同”）当事人的权利与义务，维护投资者合法权益，依据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》等法律法规、中国证监会、中国证券业协会及中国证券投资基金业协会的有关规定，投资者、管理人、托管人遵循平等自愿、诚实信用、公平原则订立资产管理合同，维护投资者合法权益，不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

管理人应当对集合计划的设立、变更向中国证券投资基金业协会进行备案，并及时报送集合计划的运行情况、风险情况及终止清算报告等信息（如相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。

中国证券投资基金业协会办理集合计划备案不作为对集合计划财产安全和投资者收益的保证，也不表明中国证券投资基金业协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。投资者应当充分了解集合计划的投资范围、投资策略和风险收益等信息，根据自身风险承受能力审慎选择集合计划，自主判断投资价值，自行承担投资风险。

关于电子签名特别约定：资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函形式对本集合计划资产管理合同的有效修订和补充）以电子签名和/或纸质版合同签名的方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者作为本合同一方，以电子签名或纸质版合同签名的方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

若采用电子签名的方式，投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和

国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式签订资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函等形式对本集合计划资产管理合同的有效修订和补充）、风险揭示书或其他文书的，视为签署资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函等形式对本集合计划资产管理合同的有效修订和补充）、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。投资者可至管理人或销售机构提供或指定的电子平台（包括系统、网站或软件等）阅览和下载具体法律文书。

随着电子签名技术的发展和政策法律的变动，在不损害投资者利益的前提下，管理人有权调整本集合计划电子签名的相关约定。

2、更新原合同第二章“释义”中相关约定，并同步更新原合同其他相应条款：

【《适当性管理办法》指《证券期货投资者适当性管理办法》及其颁布机关对其不时做出的修订】

【《指导意见》指《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及其颁布机关对其不时做出的修订】

【《管理办法》指《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其颁布机关对其不时做出的修订】

【《运作规定》指《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其颁布机关对其不时做出的修订】

【《合同指引》指《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》及其颁布机关对其不时做出的修订】

【本合同或资产管理合同指《申港证券睿盈 8 号集合资产管理计划资产管理合同》及其的任何有效修订和补充】

【销售机构指申港证券股份有限公司及其他管理人委托的具有公开募集证券投资基金销售资格的机构】

【合格投资者指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管

理计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织：

(1) 具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；

(2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；

(3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

(5) 基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形】

【申购、申购参与指在存续期内购买本集合计划份额的行为】

【最低认购金额、最低参与金额指投资者的最低投资金额，本合同中指人民币 30 万元】

【最低持有金额指投资者的最低保有金额，本合同中指人民币 30 万元】

【集合计划资产、集合计划财产或资产管理计划财产指依据有关法律法规和资产管理合同，投资者参与本集合计划的资产净额】

【家庭金融总资产指全体家庭成员共有的全部金融资产，包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货和衍生品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债】

【7 个工作日可变现资产指可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及标准化期权合约和同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等】

【关联方按照《企业会计准则》及证券公司相关规定确定】

【不可抗力指遭受不可抗力事件一方不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律变化、系统故障、突发停电或其他突发事件、证券交易所或证券登记结算机构非正常暂停或停止交易或发送数据存在延误、错漏等】

3、原合同第二章“释义”中增加约定：

【估值日指集合计划存续期内每个交易日和月末最后一个自然日】

【锁定期指投资者参与本集合计划的委托份额自产品成立日/参与确认之日（存续期参与的为申购确认日）起 360 个自然日】

4、统一变更原合同中的相关表述：

“《资产管理合同》”的表述统一变更为“资产管理合同”；

“《说明书》”的表述统一变更为“说明书”；

“资产管理计划”的表述统一变更为“集合计划”

“委托资金”的表述统一变更为“参与资金”；

“委托财产”、“委托资产”的表述统一变更为“资产管理计划财产”；

“资产委托人”的表述统一变更为“投资者”；

“基金销售资格”的表述统一变更为“公开募集证券投资基金销售资格”；

“《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产”的表述统一变更为“《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产”。

5、更新合同第四章“当事人及权利义务”中相关表述：

【托管人

名称：招商银行股份有限公司上海分行

负责人：雷财华】

【（4）根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对集合计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）；】

6、原合同中第四章“当事人及权利义务”之“（二）管理人的权利和义务”的“2、管理人的义务包括但不限于”约定增加：

【（27）除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传；

（28）保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与集合计划时使用的结算账户或其同名账户；】

7、更新合同第五章“集合计划的基本情况”之“（四）投资目标、主要投资方向及投资范围、投资比例、产品风险等级”中的表述：

【1、投资目标

通过对于当前经济形势、货币政策、财政政策、产业政策及资本市场的细致分析研究，积极主动地对集合计划的大类资产进行配置调整，力争在有效控制风险的前提下，努力实现集合计划获取投资收益的目标。

2、主要投资方向及投资范围

本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求，主要投资以下资产：

（1）固定收益类资产：包括在交易所市场、银行间市场依法上市交易的国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（包括金融机构次级债、混合资本债、政策性金融债）、企业债、公司债（含非公开发行债券）、中期票据（含长期限含权中期票据）、短期融资券及超短期融资券、非公开定向债务融资工具、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、资产证券化产品（包括资产支持证券、资产支持票据）优先级（基础资产不包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、现金、银行存款、同业存单、债券逆回购、货币市场基金、债券型基金（含公募债券型QDII基金）；

（2）债券正回购。

特别提示：本集合计划投资范围包括债券回购。

法律法规或监管机构允许投资品种，并且得到投资者书面确认的，经管理人及托管人书面一致同意后，可以将其纳入投资范围。】

8、更新合同第六章“集合计划的募集”之“（一）销售机构”中的表述：

【2、管理人可根据有关法律法规要求、集合计划运作情况，委托其他具有公开募集证券投资基金销售资格的机构（不包括独立基金销售机构）作为本集合计划的销售机构。若管理人有新增或变更本集合计划的销售机构，将提前在管理人指定网站上进行公告。管理人指定网站公告后即生效，管理人无需就增加或变更销售机构事宜征求投资者意见或与投资者另行签订协议。】

9、更新合同第六章“集合计划的募集”之“（二）募集对象、募集方式、募集期限”中的表述：

【（3）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产管理公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；】

【（5）基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；】

10、更新合同第六章“集合计划的募集”之“（三）认购事项”中的表述：

3、认购份额的计算方式

【净认购金额=认购金额/（1+认购费率）

认购费用=认购金额-净认购金额】

11、更新合同第七章“集合计划的成立与备案”之“（二）集合计划的备案”中的表述：

【管理人应在集合计划成立之日起5个工作日内报中国证券投资基金业协会备案（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。集合计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

集合计划在完成备案前，可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。

若集合计划未在中国证券投资基金业协会完成备案或不予备案，管理人可以

采取以下处理方式：

1、根据本合同约定进行合同变更，并根据变更生效且经备案通过后的合同进行后续管理；若合同变更未生效或仍未在中国证券投资基金业协会完成备案或不予备案的，管理人应对本集合计划进行终止清算；

2、对本集合计划进行终止清算。】

12、更新合同第八章“集合计划的参与、退出与转让”中的表述：

【（二）参与和退出的开放日和时间

2、开放期

（1）开放频率

本集合计划开放频率为每月的 20 日起开放 3 个工作日（遇节假日顺延），开放期内投资者可办理参与或满足条件的份额退出业务（退出需满足的条件详见本章第（四）节 2、参与和退出的程序和确认（5））。】

【（3）通知方式

管理人于首个或变更生效后首个开放期前至少 1 个工作日在指定网站发布具体开放期安排的公告。若中国证监会会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易场所交易时间变更或发生其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放期及开放时间进行相应的调整并告知投资者。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。

（三）临时开放期

本集合计划存续期内，管理人可以设置临时开放期，临时开放期的触发条件限于资产管理合同变更、监管规则修订等，临时开放期的具体安排以管理人届时在指定网站发布的有效公告为准。临时开放期只允许退出、不允许参与。投资者在临时开放期内申请退出的不受锁定期限制。】

【（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认

2、参与和退出的程序和确认

（4）当集合计划规模接近或达到约定的规模上限（如有）、投资者数量达到上限（200 人），或管理人认为有必要时，管理人有权暂停接受参与申请。如果 T 日参与申请的份额加上已有的参与份额已经超过规模上限（如有）或导致本集合计划投资者数量超过上限（200 人），则 T+1 日对 T 日参与申请的份额按照

“时间优先，金额优先”原则进行确认，根据时间先后顺序对参与资金进行确认，若出现参与时间相同的参与申请，则根据金额由大到小的顺序进行确认，以保证不超过规模上限（如有）和投资者数量上限（200 人）。

（5）投资者参与本集合计划后，每一持有份额需满足锁定期要求，即委托份额自产品成立日/参与确认之日（存续期参与的为申购确认日）起 360 个自然日内不得申请退出。若投资者选择分红转投资的，分红资金转为集合计划的份额申请退出的不受锁定期限制。

投资者仅可申请满足锁定期要求的份额退出，对于不满足锁定期要求的份额管理人有权拒绝赎回。

（6）投资者在提交退出申请时，其在销售机构必须有足够可用的集合计划份额余额，超出余额部分的退出申请将不予成交，仅受理账户实际持有份额的退出申请。销售机构对退出申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到退出申请。销售机构在 T 日规定时间受理的投资者退出申请，投资者在 T+2 日后可向销售机构查询退出的成交情况。】

【（五）参与和退出的金额限制

3、投资者部分退出集合计划的，其退出后持有的集合计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低持有金额（人民币 30 万元）。

（1）若投资者某笔退出申请后导致该投资者持有的剩余部分资产净值低于最低持有金额要求，且剩余部分不包含处于锁定期内不得退出的份额的，投资者应当申请一次性全部集合计划份额的退出；投资者在此同意，若上述部分退出申请触及上述限制且投资者未一次性全部退出的，接受管理人按照最低持有金额强制保留其持有本集合计划的份额。

（2）若投资者申请部分退出后剩余部分不满足最低持有金额要求，且剩余部分包含处于锁定期内不得申请赎回的份额的，管理人有权按照最低持有金额强制保留其持有本集合计划的份额。

】

【（十二）违约退出

1、违约退出情形

违约退出适用于投资者身患重疾、突发意外等急需使用资金的情形。申请

违约退出的投资者需提供情形说明及相关佐证材料，如投资者提供的说明及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，管理人有权拒绝办理投资者的违约退出申请。

2、违约退出的费用及违约退出金额的计算方式

(1) 违约退出费率为：0.05%。

(2) 违约退出金额的计算方式

违约退出费用=（违约退出份额×实际违约退出申请日集合计划份额净值-退出费（如有）-业绩报酬（如有））×违约退出费率

违约退出金额=违约退出份额×实际违约退出申请日集合计划份额净值-违约退出费用-退出费（如有）-业绩报酬（如有）

违约退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔违约退出时，按上述公式进行逐笔计算。

违约退出费用全额归入集合计划财产。】

【（十六）投资者变更情况报送

管理人定期将集合计划投资者变更情况报送中国证券投资基金业协会（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。】

13、更新合同第八章“集合计划的参与、退出与转让”之“（十五）管理人自有资金参与集合计划”的表述：

【1、自有资金参与的条件

管理人以自有资金参与本集合计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按照《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司股东会、董事会或者其他授权程序的批准。

2、自有资金参与的方式和金额

在本集合计划初始募集期和存续期内，管理人及其子公司可以以自有资金参与本集合计划，参与金额不得低于本集合计划初始募集期最低参与金额限制（不含参与费用）。

3、自有资金参与和退出

管理人及其子公司以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该集合计划

总份额的 50%。管理人以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该集合计划总份额的 20%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。

在本集合计划初始募集期内，投资者和托管人在此同意并授权管理人及其子公司可以以自有资金参与本集合计划。存续期内，管理人及其子公司自有资金参与、退出集合计划的，应当提前 5 个工作日以邮件形式或其他托管人认可的方式征询托管人，取得其同意，并通过征询公告或征询函形式征询全体投资者意见，其中投资者意见征询的方式具体为：

（1）管理人及其子公司（如有）拟在开放期（含退出开放期）参与或退出的，通过公告方式征询投资者意见。管理人将保障不同意投资者的退出权利，不同意管理人及其子公司（如有）自有资金参与、退出的投资者可在管理人指定的开放期内退出（不受锁定期限制），未在管理人指定的开放期退出其持有全部份额及开放期参与的投资者视为同意管理人及其子公司（如有）自有资金的参与、退出。

（2）管理人及其子公司（如有）拟在仅开放参与的开放期参与的，通过事前征询函方式征询投资者意见，并区分全体投资者回复意见情况分别处理，若全体投资者均同意，则管理人及其子公司（如有）自有资金可以在本次开放期内参与，且本次开放期不再开放退出；若未取得全体投资者同意（含投资者未答复的情况），则管理人及其子公司（如有）自有资金将不在本次开放期内参与。

管理人及其子公司（如有）自有资金参与集合计划的持有期限不得少于 6 个月。

因集合计划规模变动等客观因素导致前述比例被动不符合相关监管规定或其预警值、合同约定的，不视为管理人违反此项约定，但在客观条件允许的情况下，管理人应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定采取必要措施稳妥处置。前述被动超限情况的调整，无需提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人并取得其同意，但应于调整后 5 个工作日内告知全体投资者和托管人。

为应对本集合计划巨额退出以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守资产管理合同约定的前提下，管理人及其子公司以自有资金参与及其后续退出集合计划可不受上述限制，但应当及时告知投资者

和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。

4、自有资金的收益分配和风险承担

管理人自有资金持有的集合计划份额与投资者持有的同类份额享有同等权益、承担同等风险。

5、风险揭示：管理人及其子公司自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响集合计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注集合计划规模变动情况，控制风险。管理人及其子公司以自有资金参与或退出本集合计划并不代表管理人对本集合计划的风险和收益水平作出任何形式的判断，亦不对本集合计划的同类份额本金或收益提供任何形式的保障。】

14、更新合同第十一章“集合计划的投资”中的表述：

【（一）投资目标

通过对于当前经济形势、货币政策、财政政策、产业政策及资本市场的细致分析研究，积极主动地对集合计划的大类资产进行配置调整，力争在有效控制风险的前提下，努力实现集合计划获取投资收益的目标。

（二）投资范围及比例

1、主要投资方向及投资范围

本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求，主要投资以下资产：

（1）固定收益类资产：包括在交易所市场、银行间市场依法上市交易的国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（包括金融机构次级债、混合资本债、政策性金融债）、企业债、公司债（含非公开发行债券）、中期票据（含长期限含权中期票据）、短期融资券及超短期融资券、非公开定向债务融资工具、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、资产证券化产品（包括资产支持证券、资产支持票据）优先级（基础资产不包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、现金、银行存款、同业存单、债券逆回购、货币市场基金、债券型基金（含公募债券型 QDII 基金）；

（2）债券正回购。

特别提示：本集合计划投资范围包括债券回购。

法律法规或监管机构允许投资品种，并且得到投资者书面确认的，经管理人及托管人书面一致同意后，可以将其纳入投资范围。】

【（三）投资比例超限的处理方式及流程

如因证券期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素，导致集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的或者资产管理合同约定的投资比例，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和中国证券投资基金业协会报告（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。】

【（3）制定投资策略与资产配置比例

投资经理综合考虑政治、经济及资本市场状况等因素，根据投资目标、原则、限制和研究建议，拟定投资策略，包括整体资产配置策略（期限结构和资产结构）、具体资产配置方案等，报资产管理业务投资决策委员会审批通过。】

【（六）投资限制

为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：

1、债券（不含短期公司债券（是指债券期限不超过一年的公司债券）、短期融资券、超短期融资券）的债项评级需为 AA 级及以上，短期公司债券、短期融资券、超短期融资券的债项评级需为 A-1 级，如债券无债项评级的，发行人主体评级或债券担保人评级需为 AA 级及以上。主体评级和担保人评级均不参考中债资信评估有限责任公司出具的评级结果；

2、本集合计划总资产不得超过集合计划净资产的 180%；

3、本集合计划投资于同一资产的资金不得超过本集合计划资产净值的 25%，银行活期存款、国债、地方政府债券、央行票据和政策性金融债除外；

4、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本集合计划资产净值的 20%；

5、本集合计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本集合计划资产净值的 10%；

6、本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，本集合计划的总资产不得超过其净资产的 120%，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；

- 7、本集合计划投资的可转债和可交换债不得转股或换股；
- 8、不得投资于投资范围之外的投资品种；
- 9、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

（七）买入后持仓债券的债项评级、发行人主体评级或担保人评级低于投资评级限制的处理方式及流程

如因证券期货市场环境变化或相关主体经营情况等的因素，导致买入后持仓债券的债项评级、发行人主体评级或担保人评级发生评级下调且低于投资评级限制的，管理人须于 20 个工作日内对该债券风险作出补充评估并明确处置决定，并在集合计划定期报告中进行相应披露。

（八）禁止行为

1、利用集合计划从事内幕交易、操纵市场或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

2、泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关交易活动；

3、为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利；

4、利用集合计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；

5、为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；

6、从事不公平交易、利益输送等损害投资者合法权益的行为；

7、利用集合计划进行商业贿赂；

8、侵占、挪用集合计划财产；

9、利用集合计划或者职务便利为投资者以外的第三方谋取不正当利益；

10、直接或者间接向投资者返还管理费；

11、以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用集合计划财产进行不必要的交易；

12、直接投资商业银行信贷资产；违规为地方政府及其部门提供融资，要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；直接或者间接投资法律、行政法规和

国家政策禁止投资的行业或领域；

13、从事或者变相从事信贷业务，或者直接投向信贷资产，中国证监会、协会另有规定的除外；

14、通过委托贷款、信托贷款等方式从事经营性民间借贷活动；

15、通过设置无条件刚性回购安排变相从事借贷活动，产品投资收益不与投资标的的经营业绩或者收益挂钩；

16、投向保理资产、融资租赁资产、典当资产等与资产管理相冲突的资产及其收（受）益权，以及投向从事前述业务的公司的股权；

17、投向国家禁止或者限制投资的项目，不符合国家产业政策、环境保护政策、土地管理政策的项目；

18、通过地方金融资产交易所等平台，投资不符合要求的非标准化债权资产；

19、开展借贷、担保、明股实债等投资活动，中国证监会、协会另有规定的除外；

20、通过投资公司、合伙企业、资产管理产品等方式间接从事或者变相从事本款第13项至第19项规定的活动；

21、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。】

15、原合同中第十四章“利益冲突及关联交易”之“（二）关联交易”中约定：

【关联方指管理人及托管人的关联方，关联交易指管理人将集合计划资产投资于管理人、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，或者从事其他重大关联交易。

投资者在此同意并授权管理人可以从事上述关联交易。交易完成后，管理人应及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露，通过管理人指定网站告知投资者，并按相关规定报告，采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。

管理人、托管人关联方名单详见附件一。】

现变更为：

【1、关联交易定义

本集合计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：

- (1) 买卖本集合计划关联方发行证券或承销期内承销的证券；
- (2) 通过本集合计划关联方（管理人除外）席位及交易单元进行产品交易；
- (3) 向本集合计划关联方（管理人、托管人除外）支付报酬；
- (4) 投资于管理人及管理人关联方所管理的资产管理产品、资产支持证券；
- (5) 与关联方开展证券等交易，交易对手方、质押券涉及关联方。

其中管理人从事的重大关联交易包括但不限于：

(1) 本集合计划与一个关联方之间单笔交易金额达到 3000 万元以上且占本集合计划资产净值 5%以上的交易；

(2) 管理人管理的多个资产管理计划与一个关联方之间年度累计交易金额达到 8000 万元以上且占该多个资产管理计划资产净值 10%以上的交易；

(3) 本集合计划投资其关联方发行证券或承销期内承销的证券。

除上述提到的重大关联交易外，其他关联交易视为一般关联交易。

如法律法规、监管规定以及管理人内部管理制度发生变化的，管理人将适时调整上述定义和区分标准，并以公告的形式进行披露及遵照执行。

2、关联交易程序

管理人进行关联交易，应当符合本合同约定的投资目标及策略，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益，并区分一般和重大关联交易进行分级管理，履行不同的交易决策及信息披露程序。

投资者在此同意并授权管理人可以从事一般关联交易，根据管理人的内部制度由相关内控部门进行审批，交易完成后管理人在定期报告中向投资者统一进行披露，并告知托管人及向监管机构报告。管理人从事重大关联交易的，应通过逐笔征求意见或者公告确认等方式取得投资者同意，根据管理人的内部制度提交资产管理业务投资决策委员会进行审批，交易完成后管理人在临时报告和定期报告中向投资者披露，并告知托管人及向监管机构报告。（如信披与报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）

如法律法规、监管规定以及管理人内部管理制度发生变化的，管理人将适时调整上述内部审批机制，并以公告的形式进行披露及遵照执行。

3、关联方认定

关联方按照《企业会计准则》及证券公司相关规定确定。本集合计划关联方包括管理人、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。管理人关联方名单详见管理人指定网站公告。托管人关联方名单详见托管人官网（www.cmbchina.com）最新披露名单为准。

管理人、托管人根据自身及对方提供的关联方名单进行关联交易监控，双方均应事前将其关联方名单或关联方披露途径明确告知相对方。因一方未及时提供关联方名单或提供渠道不能查询最新关联方信息导致另一方监控不及时，由违约方承担相关责任。】

16、更新合同第十五章“投资经理的指定与变更”之“（二）投资经理变更的条件和程序”中的相关表述：

【（二）投资经理变更的条件和程序

管理人可以根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知投资者，变更生效时间以管理人公告为准。】

17、更新合同第十七章“投资指令的发送、确认和执行”之“（六）更换投资指令被授权人的程序”中的相关表述：

【管理人更换投资指令被授权人、更改或终止对投资指令被授权人的授权范围的，应提前通知托管人，变更授权的文件应由管理人的法定代表人或其授权代表签署并加盖公章。变更授权的文件应载明新授权生效日期，若托管人收到文件的日期晚于其载明的生效日期的，则自托管人收到该文件时生效，同时原授权文件作废。变更授权的文件应以原件形式送达托管人。变更授权文件生效前，托管人仍应按原约定执行投资指令，管理人不得否认其效力。在特殊情况下，可按双方商定的方式处理。**】**

18、原合同第十八章“越权交易的界定”之“（二）越权交易的处理程序”中约定：

【1、违反有关法律法规和资产管理合同的规定进行的投资交易行为

（1）托管人发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反资产管

理合同约定的，有权拒绝执行并通知管理人，并有权报告中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会。

(2) 根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人应及时通知管理人，并有权报告中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会。

(3) 管理人应向托管人主动报告越权交易，托管人有权督促管理人在限期内改正并在该限期内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权报告中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会。】

现变更为：

【1、违反有关法律法规和资产管理合同的规定进行的投资交易行为

(1) 托管人发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反资产管理合同约定的，有权拒绝执行并通知管理人，并有权报告中国证监会相关派出机构。

(2) 根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人应及时通知管理人，并有权报告中国证监会相关派出机构。

(3) 管理人应向托管人主动报告越权交易，托管人有权督促管理人在限期内改正并在该限期内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权报告中国证监会相关派出机构。

(4) 资产托管人发现资产管理人可能存在违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定，但难以明确界定时，应立即通知资产管理人，由管理人负责解决。】

19、更新合同第十八章“越权交易的界定”之“(三) 托管人对管理人投资运作的监督”中的约定：

(三) 托管人对管理人投资运作的监督

托管人根据相关法律法规及资产管理合同的约定，对本集合计划以下投资事项进行监督：

1、主要投资方向及投资范围

(1) 固定收益类资产：包括在交易所市场、银行间市场依法上市交易的国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（包括金融机构次级债、

混合资本债、政策性金融债）、企业债、公司债（含非公开发行债券）、中期票据（含长期限含权中期票据）、短期融资券及超短期融资券、非公开定向债务融资工具、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、资产证券化产品（包括资产支持证券、资产支持票据）优先级、现金、银行存款、同业存单、债券逆回购、货币市场基金、债券型基金（含公募债券型 QDII 基金）；

（2）债券正回购。

法律法规或监管机构允许投资品种，并且得到投资者书面确认的，经管理人及托管人书面一致同意后，可以将其纳入投资范围。

2、投资比例

固定收益类资产：占集合计划总资产的比例为 80%-100%。

具体比例按照该固定收益类资产的市值占整个资产管理计划总值的比例来计算。

3、投资限制

（1）债券（不含短期公司债券（是指债券期限不超过一年的公司债券）、短期融资券、超短期融资券）的债项评级需为 AA 级及以上，短期公司债券、短期融资券、超短期融资券的债项评级需为 A-1 级，如债券无债项评级的，发行人主体评级或债券担保人评级需为 AA 级及以上。主体评级和担保人评级均不参考中债资信评估有限责任公司出具的评级结果。

（2）本集合计划总资产不得超过集合计划净资产的 180%。

（3）本集合计划投资于同一资产的资金不得超过本集合计划资产净值的 25%，银行活期存款、国债、地方政府债券、央行票据和政策性金融债除外；

（4）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本集合计划资产净值的 20%。

（5）本集合计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本集合计划资产净值的 10%。

（6）本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，本集合计划的总资产不得超过其净资产的 120%，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。

（7）本集合计划投资的可转债和可交换债不得转股或换股。

(8) 不得投资于投资范围之外的投资品种。

(9) 法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

20、原合同第十九章“集合计划财产的估值和会计核算”之“(三)估值方法”中约定：

【1、证券交易所上市的债券估值方法：

(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，采用第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价。

(2) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，采用选取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。

(3) 对在交易所市场上市交易的可转换债券、可交换债券，选取每日收盘价作为估值价。

(4) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券及其他不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定其公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，采用管理人和托管人共同认可的最能反映公允价值的价格进行估值。

2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值。

3、银行间市场交易的债券、资产支持证券（票据）等固定收益品种，按监管机构或行业协会有关规定，采用中央国债登记结算公司提供的估值价确定公允价值。

4、同一债券在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、场内购买的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值，该日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；场外购买的基金以估值日前一基金份额净值估值，该日无交易的，以最近公告的基金份额净值估值；场外购买的货币市场基金，按基金管理人公布的估值日前一交易日的每万份收益估值。

6、银行存款和债券回购以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息，在利息到账日以实收利息入账，并冲减已计提部分。

7、估值中涉及主要货币对人民币汇率的，将依据当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币与主要货币的中间价为准。若本集合计划现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本集合计划的估值汇率时，

管理人与托管人协商一致后可根据实际情况调整本集合计划的估值汇率。

8、估值技术是指管理人和托管人协商一致的，被市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的确定公允价值的方法。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况并与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

9、如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，管理人可根据具体情况并与托管人商议后，按最能反映该投资品种公允价值的方法估值。

10、相关法律法规以及监管机构有强制规定，从其规定，如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

11、如管理人或托管人发现集合计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益的时候，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

12、根据相关法律法规，集合计划资产净值计算和会计核算义务由管理人承担，本集合计划的会计责任方由管理人承担，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划资产净值的计算结果对外予以公布。】

现变更为：

【1、证券交易所上市的债券估值方法：

（1）对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转债、可交债除外），采用第三方估值机构提供的价格确定公允价值。

（2）对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

2、对银行间市场上市交易的固定收益品种，采用第三方估值机构提供的价格确定公允价值。

3、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

4、对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

5、货币市场基金（非净值型）按照前一日该基金公布的每万份收益逐日计提收益。

6、场外申购或认购的公募基金（包括净值型货币市场基金）以估值日前一日基金净值估值，该日无交易的，以最近公告的基金净值计算；场内购入的基金，以估值日证券交易所挂牌的该证券收盘价估值，该日无交易的，以最近一日收盘价计算。

7、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息，在利息到账日以实收利息入账，并冲减已计提部分。

8、债券回购和具有固定回报的买入返售金融资产：以买入/外放成本列示，按约定收益率逐日计提收益/成本。

9、如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，管理人可根据具体情况并与托管人商议后，按最能反映该投资品种公允价值的方法估值。

10、相关法律法规以及监管机构有强制规定，从其规定，如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

11、如管理人或托管人发现计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益的时候，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

12、根据相关法律法规，计划资产净值计算和会计核算义务由管理人承担，本集合计划的会计责任方由管理人承担，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对计划资产净值的计算结果对外予以公布，但托管人有权向监管部门报告。】

21、更新合同第十九章“集合计划财产的估值和会计核算”之“（五）估值程序”中的表述：

【（五）估值程序

1、本集合计划资产的日常估值由管理人进行。管理人应于估值日交易结束后计算当日的资产净值并以电话、邮件、电子对账系统等双方认可的其它方式与托管人核对。管理人于每个开放期将集合计划当天的单位净值及累计单位净值以邮件、电子对账系统等双方认可的方式发送给托管人进行复核，托管人复核无误后，以邮件、电子对账系统等双方认可的方式返回给管理人，由管理人负责在其

网站上进行披露。月末、年中和年末估值复核与会计账目的核对同时进行。】

22、原合同第二十章“集合计划的费用与税收”之“（一）集合计划的费用种类、费率、计提标准、计提方式与支付方式”增加约定：

【8、银行间费用（如有）：管理人应根据银行间费用相关法律法规及本合同约定，将账户开户、结算管理等各项费用列入或摊入当期集合计划财产运作费用，经管理人和托管人核对无误后，由管理人授权后划付。投资者和管理人在此申明已了解集合计划财产投资会产生的银行间费用，并确保账户中有足够资金用于银行间费用的支付，如因托管账户中的资金不足以支付银行间费用影响到指令的执行，托管人不承担由此产生的损失和责任。如集合计划财产未起始运作，由管理人在收到托管人的缴费通知后完成支付，托管人不承担垫付费用义务。

23、更新原合同中第二十章“集合计划的费用与税收”之“（一）集合计划的费用种类、费率、计提标准、计提方式与支付方式”中相关约定：

【2、管理人的管理费

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.5%年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日集合计划资产净值】

24、更新原合同中第二十章“集合计划的费用与税收”之“（三）管理人的业绩报酬”：

【1、业绩报酬的计提原则及提取频率

（1）本集合计划将在两种情况下计提业绩报酬：

①是投资者申请退出（含临时开放期的退出及违约退出）或本集合计划终止清算时提取；②是收益分配时提取；

（2）按份额持有人每笔参与份额分别计提业绩报酬；

（3）当投资者申请退出或本集合计划终止清算时，业绩报酬从投资者退出

或清算金额中扣除；收益分配时，业绩报酬从投资者收益分配金额中扣除，收益分配金额应当覆盖业绩报酬；

（4）份额持有人退出或本集合计划终止时，业绩报酬对应按照份额持有人退出份额和本集合计划终止时持有份额计算。如退出份额为某一笔持仓份额的一部分，则该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔剩余份额不受影响；

（5）业绩报酬提取应当与集合计划的存续期限、收益分配和投资运作特征相匹配，从收益分配金额中提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次。

2、业绩报酬的计算方法及计提比例

在业绩报酬计提日，管理人计算上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年化收益率 R ，若年化收益率 R 小于或等于 r ，则管理人不提取业绩报酬；若年化收益率 R 大于 r ，则管理人对超出部分按 50%的比例提取业绩报酬，于支付日由管理人出具划款指令给托管人，由托管人根据划款指令支付。

年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1^* - P_0^*}{P_0 \times D}$$

R 为年化收益率； P_1^* 为业绩报酬计提日前一日的累计单位净值； P_0^* 为上一个业绩报酬计提日前一日的累计单位净值（若不存在则取份额确认日前一日的累计单位净值）； P_0 为上一个业绩报酬计提日前一日的单位净值（若不存在则取份额确认日前一日的单位净值）； D 为上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（清盘计提业绩报酬时， D 为上一个业绩报酬计提日到集合计划终止日的年限，若上一个业绩报酬计提日不存在则取份额确认日）。

管理人业绩报酬计提公式如下：

收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (I)
$R \leq r$	0	0
$R > r$	50%	$I = [(R - r) \times 50\%] \times A \times D$

其中：

（1） I 为管理人应提的业绩报酬；

(2) A 为对应份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额；

(3) D 为上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（清盘计提业绩报酬时，D 为上一个业绩报酬计提日到集合计划终止日的年限；若上一个业绩报酬计提日不存在则取份额确认日）；

(4) r 为管理人业绩报酬计提的计提基准，在本集合计划成立时约定为【5.3%】。

管理人有权根据市场情况及集合计划运作情况调整业绩报酬计提的计提基准，但调整频率必须和本集合计划开放退出期匹配，调整周期不能短于两次开放退出期的间隔时间。管理人将提前 3 个交易日以在管理人网站公告的形式告知相关调整。业绩报酬计提基准的变化，可能对投资者的利益产生不利影响。已持有本集合计划份额的投资者，如不接受调整后的业绩报酬计提基准的，有权并应当根据资产管理合同约定在开放期办理退出集合计划份额；在开放期后投资者继续持有任何本集合计划份额的，视为对调整后的业绩报酬计提基准无异议。

因业绩报酬计算涉及注册登记数据，业绩报酬的计算工作由管理人完成，托管人根据管理人指令进行划款。

3、业绩报酬支付

由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人据此计提应付的管理人业绩报酬，于收到划付指令后在 5 个工作日内从集合计划资产中将计提的业绩报酬一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

4、业绩报酬计提基准确定依据及说明

本集合计划设置的业绩报酬计提基准主要是管理人基于集合计划的投资组合，并考虑管理成本、合理利润等相关费用后确定。管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划资产本金不受损失，也不保证最低收益。本集合计划的业绩报酬计提基准仅为本集合计划管理人提取业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人和销售机构保证资产管理计划财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。】

25、更新原合同中第二十章“集合计划的费用与税收”之“（四）费用调

整”：

【（四）费用调整

在不损害投资者利益的前提下，管理人可调减管理费率或与托管人协商调减托管费率，并在新的费率开始实施前在管理人指定网站公告，无须征得投资者同意，管理人指定网站上发布公告即视为履行了告知义务。】

26、原合同中第二十一章“集合计划的收益分配”中“（二）收益分配原则”增加约定：

【5、在不违反法律法规且对投资者利益无实质不利影响的前提下，管理人可在法律法规允许的前提下，酌情调整收益分配原则和支付方式，并于变更实施日前在管理人指定网站向投资者披露。】

27、更新原合同中第二十一章“集合计划的收益分配”中“（四）收益分配的执行方式”中的表述：

【4、若采用分红转投资的方式，管理人将把分红资金自动转为集合计划份额进行再投资，分红资金转为集合计划的份额申请退出的不受锁定期限制。

托管人依据合同约定及管理人指令，对收益分配方案中的可供分配利润、分配方式、分配金额等要素进行核对。若划至份额登记机构统一分配，托管人对于收益分配方案的复核内容限于对收益分配的总金额进行复核，对于在不同投资者之间分配的金额、分配顺序不承担复核义务，管理人应对向受益人划转资金本息的及时性、准确性负责。】

28、更新原合同第二十一章“集合计划的收益分配”中“（三）收益分配方案的确定与通知”的表述：

【（三）收益分配方案的确定与通知

收益分配方案载明可供分配利润、分配对象、分配原则、分配时间、分配比例、分配方式等内容。】

29、更新原合同第二十二章“信息披露与报告”中的表述：

【信息披露文件将于管理人指定网站公告（www.shgsec.com），投资者可以

进入上述网站，输入注册时预设的账户信息及其他必要的验证信息完成登录后，在产品信息界面的相关栏目中进行查阅。相关法律法规关于信息披露与报告的规定发生变化时，本集合计划从其最新规定。若查询方式发生变化，以管理人届时有效公告为准。

托管人信息披露的内容主要涉及对管理人编制的份额净值、份额申购赎回价格、定期报告等公开披露的报告中的财务部分进行复核。

（一）定期报告

定期报告包括集合计划份额净值报告、集合计划的季度报告和年度报告、集合计划的季度和年度托管报告、年度审计报告。】

【2、集合计划的季度和年度管理报告

（9）投资经理变更、关联交易等涉及投资者权益的重大事项；】

【3、集合计划的季度和年度托管报告

托管人在每季度和每年度提供集合计划季度报告和年度报告，季度报告应于每季度结束之日起一个月内由管理人通过指定网站等披露，年度报告应于在每年度结束之日起四个月内披露（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。

4、年度审计报告

管理人应当聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对集合计划进行年度审计，审计机构应当对集合计划会计核算及净值计算等出具意见。】

【（二）临时报告

集合计划存续期间，发生资产管理合同约定或可能对集合计划持续运行、投资者利益、集合计划资产净值产生重大影响的事项，管理人应当在事项发生之日起5日内以指定网站公告方式向投资者披露，并按照相关规定及时报告。临时报告的情形包括但不限于：】

【（三）管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划的，管理人将以指定网站公告方式向投资者充分披露，并及时向中国证监会相关派出机构报告（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）。】

30、原合同中第二十三章“风险揭示”中约定：

【3、资产管理计划份额转让所涉风险

在技术条件成熟的前提下，经管理人申请并开通份额转让事宜后，本集合计划份额可以转让。本集合计划份额如允许通过证券交易所以及中国证监会认可的交易平台依法转让，将会存在因转让场所规则限制、投资者持有份额被司法冻结、投资者未满足资产管理合同最低参与金额要求或其他不可抗力的因素等造成的转让失败风险。

4、集合计划未在中国证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

本集合计划相关材料需要报中国证券投资基金业协会备案，若出现未完成备案手续或不予备案的情形，则需要按照监管机构或自律协会的要求修改资产管理合同或者根据资产管理合同约定本集合计划应当终止清算，存在无法投资运作的风险。同时可能发生备案时间较长的情况，且监管机构要求集合计划证券账户、期货账户等需备案通过后方可申请开通，因此存在影响集合计划的运营、投资的风险，请投资者注意。】

【2、市场风险

集合计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、衍生品风险等。】

【9、关联交易的风险

本集合计划可能投资于管理人、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，或从事其他关联交易。

虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则，遵守相关法律法规的规定进行操作，积极防范利益冲突，但仍可能存在因从事关联交易被监管机构认为存在重大风险，且管理人无法确保关联交易比类似的非关联交易的实际交易结果更优，进而可能影响投资者的利益。此外，管理人运用集合计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规被限制相关权利的行使，进而可能影响集合计划资产的投资收益。】

【11、投资者退出的风险

投资者部分退出集合计划的，其退出后持有的集合计划份额净值应当不低于

规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的集合计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出集合计划的，应当一次性全部退出。在此情况下投资者可能面临无法按申请份额退出本集合计划的风险。】

【22、存续期内持仓债券主体或担保人评级下调的风险】

本集合计划存续期内，可能发生买入后持仓债券主体或担保人发生评级下调且低于投资评级限制的情况，管理人将根据本合同约定对该债券风险作出补充评估并明确处置决定，进而产生相应的风险。】

现修改为：

【3、集合计划份额转让所涉风险】

在技术条件成熟的前提下，经管理人申请并开通份额转让事宜后，本集合计划份额可以转让。本集合计划份额如允许通过证券交易所以及中国证监会认可的交易平台依法转让，将会存在因转让场所规则限制、投资者持有份额被司法冻结、投资者未满足资产管理合同最低持有金额要求或其他不可抗力的因素等造成的转让失败风险。

6、集合计划未在中国证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

本集合计划相关材料需要报中国证券投资基金业协会备案，可能出现未完成备案手续或不予备案的情形，包括首次提交备案及修改资产管理合同后提交备案未通过等情况，故存在无法投资运作需提前终止或因备案周期较长影响相关账户开立，从而影响集合计划的投资运作的风险。】

【2、市场风险】

集合计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、企业经营风险等。】

【9、关联交易的风险】

(1) 关联交易特别风险提示

虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因管理人运用集合计划财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能导致投资者的利益受损。

此外，管理人运用集合计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响集合计划财产的投资收益。

（2）一般关联交易特定风险提示

根据本合同约定：“投资者在此同意并授权管理人可以从事一般关联交易”，管理人虽会采取措施防范利益冲突，保护投资者的合法权益，但投资者仍有可能面临一般关联交易存在相关投资风险、无法事前知悉每笔一般关联交易等情况，导致投资者利益受到损害的风险。

（3）重大关联交易特定风险提示

本集合计划进行重大关联交易时，管理人应遵守法律法规、监管规定、行业自律组织要求、合同约定及管理人相关内控制度，保护投资者的合法权益，但投资者仍有可能面临重大关联交易存在相关投资风险等情况，导致投资者利益受到损害的风险。

投资者应充分知悉本合同条款关于重大关联交易的各项机制安排和所涉风险，关注管理人相关公告并及时做出相应安排。】

【11、投资者退出的风险

投资者部分退出集合计划的，其退出后持有的集合计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低持有金额。投资者持有的集合计划份额净值低于规定的最低持有金额时，需要退出集合计划的，应当一次性全部退出。否则，投资者接受管理人将其持有的全部集合计划份额强制一次性退出的风险。】

【22、存续期内持仓债项评级、发行人主体评级或担保人评级下调的风险

本集合计划存续期内，可能发生持仓债项评级、发行人主体评级或担保人发生评级下调且低于投资限制的情况，如遇评级下调，管理人可根据实际情况进行处置决定，包括但不限于继续持有已下调评级的资产、低于市场估值卖出已下调评级的资产等，进而产生相应的风险。】

31、合同第二十三章“风险揭示”中增加约定：

【4、集合计划锁定期无法赎回的风险

本集合计划对投资者的每笔参与份额持有时间设置锁定期，锁定期为当次参与所对应的申购确认日起 360 个自然日，投资者仅可申请满足锁定期要求的份额退出，对于不满足锁定期要求的份额管理人有权拒绝赎回。

5、管理人强制按照最低持有金额保留持有份额的风险

（1）若投资者某笔退出申请后导致该投资者持有的剩余部分资产净值低于最低持有金额要求，且剩余部分不包含处于锁定期内不得退出的份额的，投资者应当申请一次性全部集合计划份额的退出；投资者在此同意，若上述部分退出申请触及上述限制且投资者未一次性全部退出的，接受管理人按照最低持有金额强制保留其持有本集合计划的份额。

（2）若投资者申请部分退出后剩余部分不满足最低持有金额要求，且剩余部分包含处于锁定期内不得申请赎回的份额的，管理人有权按照最低持有金额强制保留其持有本集合计划的份额。】

【（7）可转换债券、可交换债券的投资风险

本集合计划可投资于可转换债券、可交换债券，需要承担可转换债券和可交换债券市场的流动性风险、债券价格受所对应股票价格波动影响而波动的风险等。

①可交换债券的收益波动风险

可交换债券与标的股票挂钩，其波动因素除利率风险、流动性风险外，还受换股价格、标的股票价格、赎回条款、向下修正条款、投资者的预期等诸多因素的影响。具有波动风险的收益包括：持有期间获取利息，持有至到期被发行人以到期赎回价格赎回而获取的赎回收益，或在存续期内被发行人按照债券面值加应计利息赎回而获取的赎回收益；在报价系统公司以高于票面价值转让的收益等。

②发行人资信风险

若由于发行人自身的相关风险或不可控制的因素，发行人的财务状况发生不利变化，导致不能按约定偿付贷款本息或在业务往来中发生严重违约行为，

将可能使发行人资信状况恶化，发行人上述受限资产将可能用于对相关债权人的偿付，发行人的资产将会大幅减少，并面临集中偿付的巨大压力，届时发行人的偿债能力将严重下降，从而影响债券还本付息。

③可转换债券的价格受到证券市场政策、市场利率、公司股票价格、转股价格、赎回条款及回售条款、投资者心理预期、剩余期限等多种因素的影响，其价格波动较为复杂，甚至出现异常波动或与其投资价值严重背离的现象，存在价格波动风险。

（8）QDII 基金的投资风险

本集合计划可能投资于 QDII 基金，由于境外投资受到各个国家/地区宏观经济运行情况货币政策、财政政策、产业政策、税法、汇率、交易规则、结算、托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使 QDII 基金资产面临潜在风险。此外，境外投资的成本、境外市场的波动性也可能高于国内市场，存在一定的市场风险。】

32、原合同中第二十四章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”中约定：

【（一）资产管理合同变更的条件和程序

1、因法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人书面协商一致后修改资产管理合同，并由管理人以指定网站公告的方式及时向投资者披露变更的具体内容。如投资者对变更的内容有异议，可以根据管理人的安排申请退出本集合计划；未在管理人指定的期限内申请退出其持有的全部集合计划份额，视为同意本集合计划变更，管理人不再另行通知。】

【4、根据资产管理合同约定进行资产管理合同变更的，同意变更的投资者无需就资产管理合同变更与管理人、托管人另行签署变更后的资产管理合同或关于资产管理合同变更的补充协议，经管理人公告的资产管理合同变更内容自变更生效时起自动成为变更后资产管理合同的组成部分。资产管理合同变更后，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的资产管理合同行使相关权利，履行相应义务。】

【（三）集合计划的终止

5、存续期内，连续五个工作日集合计划投资者少于 2 人或开放期发生所有投资者提出全部份额的赎回申请，且当日无新增申购申请的情况；

特别提示：若本集合计划存续期间开放期发生所有投资者提出全部份额的赎回申请，且发生所有投资者全部份额赎回的当日无新增申购申请的情况下，当日投资者的退出申请将被判定为赎回失败，同时本集合计划将提前终止，终止后相关事项以合同终止约定为准；

6、未在中国证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；】

【（五）集合计划的财产清算

2、集合计划财产清算的程序

（5）将清算报告及时向中国证监会相关派出机构和中国证券投资基金业协会报告；】

【5、集合计划延期清算处理方式

若本集合计划在清算时有未能变现的证券或资产，管理人可进行延期清算，对前述未能变现的证券或资产在可变现后进行二次清算，并将变现后的资产扣除相关费用后按照投资者持有份额占总份额的比例或资产管理合同的约定，以货币资金形式全部分配给投资者。】

【7、集合计划财产清算完毕后，管理人按照规定注销证券账户，托管人按照规定注销银行间债券账户，并按照规定注销集合计划财产的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。】

现变更为：

【（一）资产管理合同变更的条件和程序

1、因法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人书面协商一致后修改资产管理合同，并由管理人以指定网站公告的方式及时向投资者披露变更的具体内容。如投资者对变更的内容有异议，可以根据管理人的安排申请退出本集合计划。】

【4、资产管理合同变更与管理人、托管人另行签署变更后的资产管理合同或关于资产管理合同变更的补充协议，资产管理合同变更内容自变更生效时起自动成为变更后资产管理合同的组成部分。资产管理合同变更后，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的资产管理合同行使相关权利，履行相应义务。】

【（三）集合计划的终止

5、存续期内，连续五个工作日集合计划投资者少于 2 人或开放期发生所有投资者提出全部份额的赎回申请，且无新增申购申请或申购申请不满足本集合计划存续条件的情况；

特别提示：若本集合计划存续期间开放期发生所有投资者提出全部份额的赎回申请，且无新增申购申请或申购申请不满足本集合计划存续条件，当日投资者的退出申请将按赎回失败处理，同时本集合计划将提前终止，终止后相关事项以合同终止约定为准；

6、未在中国证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形（本合同另有规定的从其规定）；

7、发生资产管理合同约定的应当终止的情形；】

【（五）集合计划的财产清算

2、集合计划财产清算的程序

（5）将清算报告及时向中国证券投资基金业协会报告（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）；】

【5、集合计划延期清算处理方式

若本集合计划在清算时有未能流通变现的资产，管理人可进行多次分配，并制定多次清算方案，该方案应经托管人认可，通过管理人指定网站进行披露。管理人应根据多次清算方案的规定，对前述未能流通变现的资产在可流通变现后进行多次清算，并将变现后的资产扣除相关费用后按照投资者持有份额占总份额的比例或资产管理合同的约定，以货币资金形式全部分配给投资者。】

【7、集合计划财产清算完毕后，管理人按照规定注销证券账户，托管人按照规定注销银行间债券账户，并按照规定注销集合计划财产的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。】

33、更新原合同中第二十五章“违约责任”中的相关表述：

【1、不可抗力。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划资产损失扩大。任

何一方当事人延迟履行合同义务后,发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同,该方不能减轻或免除相应责任。

2、管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会或中国证券投资基金业协会等监管机构的规定作为或不作为而造成的损失等。

3、管理人由于按照资产管理合同规定的投资原则行使或不行使其投资权利而造成的损失等。

4、在计划运作过程中,管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责,但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

(二)在发生一方或多方当事人违约的情况下,资产管理合同能够继续履行的,应当继续履行。

(三)资产管理合同一方当事人造成违约后,其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大;没有采取适当措施致使损失扩大的,不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(四)由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错,管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但是未能发现错误的,由此造成集合计划财产或投资者损失,管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(五)一方当事人依据资产管理合同向另一方当事人赔偿的损失,仅限于直接损失。

(六)在投资者的集合计划资产被司法机关或其他政府机构冻结的情况下,管理人和托管人没有义务代表投资者就针对集合计划资产所提起的司法或行政程序进行答辩,但是可以提供必要的协助。

(七)托管人对于存放在托管人之外的资产管理计划财产的任何损失、及基于从第三方机构(包括但不限于证券交易所、期货交易所等)合法获得的信息及合理信赖上述信息而操作导致资产管理计划财产的任何损失等都应是免责。

(八)如果管理人和托管人其中一方违约,给集合计划资产造成损失的,应由违约方就直接损失进行赔偿,另一方可接受集合计划投资者委托向违约方追偿;管理人、托管人因共同行为给集合计划财产或投资者造成损害的,应当根据各自

的过错程度承担相应的赔偿责任。】

34、更新合同中第二十七章“资产管理合同的效力”中相关表述：

【（一）资产管理合同签署的方式

资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函、网站公告征求意见等形式对本合同的有效修订和补充）可采用电子或纸质方式签订，中国证券投资基金业协会另有规定的从其规定。管理人、托管人作为资产管理合同签署方，已接受资产管理合同项下的全部条款。】

【（四）资产管理合同的组成

说明书、风险揭示书、经管理人确认有效的投资者参与/退出本集合计划的申请材料或数据电文和各销售机构出具的集合计划参与/退出业务受理有关凭证、投资者通过电子签名方式产生的数据电文、管理人通过指定网站发布的公告等是资产管理合同的有效组成部分。说明书如与资产管理合同有不一致的，以资产管理合同为准。】

35、更新合同中第二十九章“其他事项”中相关表述：

【资产管理合同未尽事宜，由合同当事人各方依据有关法律法规协商办理。

除资产管理合同另有定义之外，词语在资产管理合同中使用具有与在说明书、风险揭示书中使用时相同的含义。】

36、删除原合同附件一“关联方名单”。

二、变更方案的安排

现将投资者如何参与本集合计划合同变更相关事宜说明如下：

自合同变更及设置临时开放期公告发布之日，请投资者至我司或自行打印或通过申港证券 APP 以电子签署等有效途径填写《申港证券睿盈 8 号集合资产管理计划合同变更征询的回函》（以下简称“回函”）并务必于 2024 年 2 月 19 日（含）前将回函意见通过邮寄、电子签章等方式告知管理人。同时，对于本次回函，做如下说明：

1、本次合同变更期间（即征询期间）为：自合同变更及设置临时开放期公告发布之日到 2024 年 2 月 19 日（含）止，投资者回函必须在上述时间内完成。

-
- 2、若投资者回函意见为“同意”，即视为同意合同变更相关内容。
 - 3、若投资者回函意见为“不同意”，应在征询期间提出退出申请，对于提出退出申请的投资者，管理人将按照正常退出申请流程进行退出份额确认。
 - 4、若投资者未在征询期间回复意见且未在管理人指定的期限内申请退出其持有的全部集合计划份额的，视为同意此次资产管理合同变更。
 - 5、若投资者的回函意见与其退出申请不一致，则以退出申请为准。

特别提醒：

本集合计划原有持仓客户锁定期起始日为每笔份额确认日。

自合同变更生效之日起，合同变更内容即成为本集合计划资产管理合同的重要组成部分，相关法律文本将同步更新。

感谢您的支持与配合！如有疑问，可咨询申港证券股份有限公司。

邮寄回函地址：

地址：上海浦东新区世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 19 楼

联系人：杨程

联系电话：（021）20639471



申港证券睿盈 8 号集合资产管理计划

合同变更征询的回函

请投资者根据以上内容作出意见表示：同意合同变更之投资者，请于“同意”栏填写“同意”并签字或盖章；不同意合同变更之投资者，请于“不同意”栏填写“不同意”并签字或盖章。

申港证券睿盈8号集合资产管理计划合同变更征询的回函	
意见	投资者反馈
同意	
不同意	
签字或盖章： 年 月 日	