

关于申港证券明珠 FOF1 号集合资产管理计划 资产管理合同变更的协商函

招商证券股份有限公司：

申港证券股份有限公司（以下简称“我司”或“申港证券”）管理的“申港证券明珠 FOF1 号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）于 2020 年 4 月 10 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》等的有关规定并结合本集合计划运作管理需要，拟变更部分合同条款，并征求贵司意见，根据《申港证券明珠 FOF1 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“（一）资产管理合同变更的条件和程序”之约定：

“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。

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。”



具体的变更内容如下：

一、原合同“第八节 资产管理计划的参与、退出与转让”中“（二）参与和退出的开放期和时间”中“2、开放期”中约定：

【（1）开放频率

本集合计划开放参与的频率为每自然月的10日开始，连续开放5个工作日（遇节假日顺延），每个开放期投资者（投资者应符合合格投资者标准）均可以参与；每年4月、10月的10日起连续5个工作日（遇节假日顺延）的开放期，投资者可以退出。特别地，本集合计划的首个开放退出的日期为自产品成立满6个月后的开放期。】

现变更为：

【（1）开放频率

本集合计划开放参与的频率为每自然月的10日开始，连续开放5个工作日（遇节假日顺延），每个开放期投资者（投资者应符合合格投资者标准）均可以参与；每年6月、12月的10日起连续5个工作日（遇节假日顺延）的开放期，投资者可以退出。特别地，本集合计划的首个开放退出的日期为自产品成立满6个月后的开放期。】

二、原合同“第八节 资产管理计划的参与、退出与转让”中“（六）参与和退出的费用”项下的全部内容更新为：

【1、参与费率：0%，本集合计划不收取参与费用。

2、退出费率：0%，本集合计划不收取退出费用。】

三、原合同“第八节 资产管理计划的参与、退出与转让”中“（十一）投资者在资产管理计划投资运作期间的份额转让事宜”中约定：

【本集合资产管理计划份额不得转让。】

现变更为：

【本集合计划存续期间，在转让条件允许的情况下，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记

手续。转让后，持有集合计划份额的合格投资者合计不得超过 200 人。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订资产管理合同。】

四、原合同“十四、利益冲突及关联交易”中“（二）关联交易”中“1、关联交易定义”约定：

【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，或者从事其他关联交易。

管理人从事的重大关联交易是指：

（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；

（4）管理人根据实质重于形式的原则认定的其他重大关联交易。

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。管理人将根据法律法规、监管规定以及内控管理需要，适时调整上述区分标准，具体详见管理人公告并及时通知托管人。】

现变更为：

【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（含资产支持证券）；

（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）投资于本集合计划关联方管理的其他资产管理计划；

（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。

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（含资产支持证券）。

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，具体详见管理人公告并及时通知托管人。】

五、原合同“第十九节 资产管理计划财产的估值和会计核算”之“（三）估值方法”中约定：

【9、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(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；

(2) 首次公开发行未上市的股票和权证，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。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值。

(4) 非公开发行有明确锁定期的股票，采取如下方法确定公允价值：

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该股票的价值。

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV = C + (P - C) \times \frac{D_1 - D_r}{D_1}$$

其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得成本做相应调整）；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1 为该非公开

发行股票锁定期所含的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。】

现变更为：

【9、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(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。

(2) 首次公开发行未上市的股票和权证，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，按发行价估值。

(3) 优先股按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(4) 流通受限股票，采取如下方法确定公允价值：

流通受限股票，是指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于首次发行有明确锁定期的股票、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、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，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。

流通受限股票按以下公式确定估值日该流通受限股票的价值：

$$FV = S \times (1 - LoMD)$$

其中：

FV：估值日该流通受限股票的价值

S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值

LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣。】

六、原合同“第十九节 资产管理计划财产的估值和会计核算”之“（三）估值方法”中删除以下内容，后续项目编号同步调整：

【12、汇率：

本资管计划外币资产价值计算中，涉及港币对人民币汇率的，应当以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。

若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估值汇率，并

及时报中国证监会备案。

若无法取得上述汇率价格信息时，以托管人所提供的合理公开外汇市场交易价格为准。】

以上变更内容《申港证券明珠 FOF1 号集合资产管理计划产品说明书》所涉内容将同步进行变更。

以上事宜，请贵司确认。本函自管理人加盖公章或合同专用章并托管人回执后生效。

申港证券股份有限公司（盖章）

签署日：2023年12月1日



回 执

我司已知悉，并同意你司在《关于申港证券明珠 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同变更的协商函》中所提及的相关合同条款的变更。

招商证券股份有限公司（盖章）

签署日：2023 年 12 月 01 日



