

中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划合同变更征询函

尊敬的投资者：

为了持续服务广大投资者，并满足广大投资者对中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划（以下简称“信信向荣 3 号”或“本集合计划”）的需求，根据此前已经生效的《中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划资产管理合同》及其附件（以下简称“原合同”）的约定及相关规定的要求，经征得托管人同意，我司拟对本集合计划的资产管理合同、说明书、风险揭示书进行变更。

拟变更的内容主要为：

- 1、产品费率：管理费率由“0.30%”下调至“0.20%”，业绩报酬计提基准由“3.80%”下调至“3.30%”，业绩报酬计提比例由“60%”下调至“50%”，并不再收取退出费率。
- 2、开放期：开放日由每周三开放调整为每周二、三、四开放。
- 3、估值程序：增加估值精度调整条款，相应增加信息披露和风险揭示相关内容。
- 4、关联交易：修改关联交易相关定义，并相应调整风险揭示中关联交易的表述。
- 5、投资比例超限的处理：修改投资比例超限的调整条款，根据最新监管规定将调整时限变更为 20 个交易日。
- 6、根据管理人发布的《关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告》，本集合计划的管理人于 2023 年 11 月 1 日起由“中信证券股份有限公司”变更为“中信证券资产管理有限公司”，因此相应修改与管理人主体变更相关的内容。
- 7、其他内容修改。

拟变更的条款详情请参见附件一《中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划资产管理合同变更条款对照表》、附件二《中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划说明书变更条款对照表》、附件三《中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划风险揭示书变更条款对照表》。原合同内容与本次变更内容不一致的，以本次变更内容为准。

根据原合同第二十四节的约定：

1、管理人有权在合同变更征询期对本集合计划设置特殊赎回开放日，不同意合同变更的投资者，应在该赎回开放日办理本集合计划的退出事宜。

此次合同变更征询期为 2024 年 5 月 8 日至 2024 年 5 月 8 日，在合同变更征询期内的指定特殊赎回开放期为 2024 年 5 月 8 日至 2024 年 5 月 8 日；在特殊赎回开放期进行赎回的份额不收取退出

费。如合同变更征询期结束时，本集合计划规模不低于 1000 万元且投资者不少于 2 人，则于 2024 年 7 月 10 日起此次合同变更事项正式生效。

2、如果投资者未在合同变更征询期内的指定特殊赎回开放期办理其持有本集合计划全部份额的退出事宜，则视为投资者同意此次合同变更事项。

3、此次合同变更生效后，投资者有权在开放日按照本集合计划资产管理合同的相关约定办理退出事宜。

征询意见结束后，我司将在公司网站公告此次合同变更是否生效等事宜。若此次合同变更符合生效条件，则本征询函及相关公告文件在此次合同变更生效日起成为原合同的组成部分，作为原合同附件，共同组成新的资产管理合同、说明书、风险揭示书（以下简称“新合同”）。原合同内容与本征询函及相关公告文件不一致的，以本征询函及相关公告文件内容为准。本集合计划自合同变更生效日起将适用新合同，我司将按规定报相关机构备案。合同变更生效日后，现有投资者无需另行签署新合同，新参与的投资者则需签署新合同。

如有疑问，可咨询电话：95548 转 5。

管理人网站：www.citicsam.com



中信证券资产管理有限公司

2024年7月25日

附件一:

中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划资产管理合同

变更条款对照表

变更前	变更后
第二节 释义	
<p>.....</p> <p>管理人（或资产管理人或证券期货经营机构）：在本集合计划中指中信证券股份有限公司（简称“中信证券”）。</p> <p>.....</p> <p>登记结算机构：指办理本集合计划登记结算业务的机构。本集合计划的登记结算机构为中信证券股份有限公司或接受中信证券股份有限公司委托代为办理本集合计划登记结算业务的机构。</p> <p>.....</p> <p>管理人网站：www.cs.ecitic.com。</p> <p>.....</p>	<p>.....</p> <p>管理人（或资产管理人）：在本集合计划中指中信证券资产管理有限公司（简称“中信证券资管”）。</p> <p>证券期货经营机构：在本集合计划中指管理人及中信证券股份有限公司。</p> <p>.....</p> <p>登记结算机构：指办理本集合计划登记结算业务的机构。本集合计划的登记结算机构为管理人或接受管理人委托代为办理本集合计划登记结算业务的机构。</p> <p>.....</p> <p>管理人网站：www.citicsam.com。</p> <p>.....</p>
第三节 承诺与声明	
<p>第四条 承诺与声明</p> <p>.....</p> <p>5、对于本集合计划的开放期安排、管理人自有资金参与退出、合同变更等有关管理人向投资者披露的事项，管理人将一般仅通过管理人网站（www.cs.ecitic.com）发布，投资者应及时关注该网站内容。</p> <p>.....</p>	<p>第四条 承诺与声明</p> <p>.....</p> <p>5、对于本集合计划的开放期安排、证券期货经营机构自有资金参与退出、合同变更等有关管理人向投资者披露的事项，管理人将一般仅通过管理人网站发布，投资者应及时关注该网站内容。</p> <p>.....</p>
第四节 当事人及权利义务	
<p>第六条 管理人</p> <p>名称：中信证券股份有限公司</p> <p>住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座</p> <p>法定代表人：张佑君</p> <p>通讯地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦</p> <p>联系电话：95548 转 5</p> <p>.....</p>	<p>第六条 管理人</p> <p>名称：中信证券资产管理有限公司</p> <p>住所：北京市丰台区金丽南路 3 号院 2 号楼 1 至 16 层 01 内六层 1-288 室</p> <p>法定代表人：杨冰</p> <p>通讯地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 16 层</p> <p>联系电话：95548 转 5</p> <p>.....</p>
第五节 资产管理计划的基本情况	
<p>第十五条 资产管理计划的基本情况</p> <p>.....</p> <p>（四）资产管理计划的投资目标、主要投资方</p>	<p>第十五条 资产管理计划的基本情况</p> <p>.....</p> <p>（四）资产管理计划的投资目标、主要投资方</p>

向、投资比例、产品风险等级

.....

3、投资比例

.....

(4) 本集合计划参与债券等证券发行申购时, 所申报的金额不得超过本集合计划的总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

.....

(九) 本资产管理计划的服务机构

本集合资产管理计划份额登记、估值与核算、信息技术系统服务机构为中信证券股份有限公司。在证券投资基金业协会登记的业务登记编码 PT0300000208。

.....

(十一) 本集合计划的各项费用

.....

2、退出费: 按照集合计划份额持有期限的不同设置不同的退出费率, 具体退出费率如下表所示:

连续持有时间 (N)	退出费率
N < 180天	1%
N ≥ 180天	0

根据本合同第五十七条(一)款进行合同变更时, 本集合计划对在特殊赎回开放日赎回的份额不收取退出费。

.....

4、管理费(年费率): 0.30%;

5、业绩报酬: 在符合提取业绩报酬条件的情况下, 本集合计划在分红确认日、投资者退出确认日和计划终止日, 将根据投资者的期间年化收益率(R), 对期间年化收益率超过3.80%以上的部分按照60%的比例收取管理人业绩报酬, 但若分红确认日距本集合计划的成立日或上一个计提业绩报酬的分红确认日的间隔期间不足6个月的, 管理人在本次分红确认日不得提取业绩报酬。

.....

向、投资比例、产品风险等级

.....

3、投资比例

.....

(4) 本集合计划参与债券等证券发行申购时, 所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产, 所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。

.....

(九) 本资产管理计划的服务机构

本集合资产管理计划份额登记、估值与核算、信息技术系统服务机构为中信证券资产管理有限公司。在证券投资基金业协会登记的业务登记编码 PT0700033054

.....

(十一) 本集合计划的各项费用

.....

2、退出费: 0%;

.....

4、管理费(年费率): 0.20%;

5、业绩报酬: 在符合提取业绩报酬条件的情况下, 本集合计划在分红确认日、投资者退出确认日和计划终止日, 将根据投资者的期间年化收益率(R), 对期间年化收益率超过3.30%以上的部分按照50%的比例收取管理人业绩报酬, 但若分红确认日距本集合计划的成立日或上一个计提业绩报酬的分红确认日的间隔期间不足6个月的, 管理人在本次分红确认日不得提取业绩报酬。

.....

第八节 集合计划的参与、退出与转让

第二十三条 集合计划的参与、退出

.....

(二) 参与和退出的开放日和时间

1、开放期: 本集合计划成立后, 每个星期三为开放日(如遇非工作日则顺延至该日之后最近一个工作日), 投资者可以在开放期办理参与、退出业务(管理人通告暂停参与、退出时除外)。

.....

第二十三条 集合计划的参与、退出

.....

(二) 参与和退出的开放日和时间

1、开放期: 本集合计划成立后, 每个星期二、三、四为开放日(如遇非工作日则顺延至该日之后最近一个工作日), 投资者可以在开放期办理参与、退出业务(管理人通告暂停参与、退出时除外)。

.....

(六) 参与和退出的费用

参与费用由投资者另行承担，主要用于支付市场销售等各项费用，不列入集合计划资产。

本集合计划的参与费率为零。

退出费用由投资者另行承担，并全额计入集合计划财产。

本集合计划退出费率按照集合计划份额持有期限的不同设置不同的退出费率，具体退出费率如下表所示：

连续持有时间 (N)	退出费率
N < 180天	1%
N ≥ 180天	0

管理人有权在履行合同变更手续后调高本集合计划的参与费率或退出费率，但管理人调低参与费率或退出费率的，无需另行征询投资者的意见、履行合同变更程序，仅通过管理人网站提前公告即可。

根据本合同第五十七条（一）款进行合同变更时，本集合计划对在特殊赎回开放日赎回的份额不收取退出费。

(六) 参与和退出的费用

参与费用由投资者另行承担，主要用于支付市场销售等各项费用，不列入集合计划资产。

本集合计划的参与费率为零。

退出费用由投资者另行承担，并全额计入集合计划财产。

本集合计划的退出费率为零。

第八节 集合计划的参与、退出与转让

第二十六条 证券期货经营机构自有资金参与情况

.....

.....如果托管人未按照管理人征询通知中要求的方式进行反馈，或未在管理人征询通知中限定的期限内及时反馈，或在反馈中意见表示不明确的，则均视为托管人同意证券期货经营机构及其子公司可以按该征询通知披露的情况、进行自有资金参与或退出。管理人将提前5个工作日通过管理人网站公告征询全体投资者的意见，投资者不同意的，应在管理人征询公告中披露的证券期货经营机构或其子公司自有资金参与或退出的开放日前（含当日）的任意一个开放日内办理其持有本集合计划全部份额的退出事宜，投资者须按合同约定承担退出费。.....

.....

第二十六条 证券期货经营机构自有资金参与情况

.....

.....如果托管人未按照管理人征询通知中要求的方式进行反馈，或未在管理人征询通知中限定的期限内及时反馈，或在反馈中意见表示不明确的，则均视为托管人同意证券期货经营机构及其子公司可以按该征询通知披露的情况、进行自有资金参与或退出。管理人将提前5个工作日通过管理人网站公告征询全体投资者的意见，投资者不同意的，应在管理人征询公告中披露的证券期货经营机构或其子公司自有资金参与或退出的开放日前（含当日）的任意一个开放日内办理其持有本集合计划全部份额的退出事宜。.....

.....

第十一节 资产管理计划的投资

第三十二条 资产管理计划的投资

.....

(二) 投资范围及比例

.....

2.投资比例

.....

第三十二条 资产管理计划的投资

.....

(二) 投资范围及比例

.....

2.投资比例

.....

<p>(4) 本集合计划参与债券等证券发行申购时, 所申报的金额不得超过本集合计划的总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>.....</p> <p>(三) 投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等非因管理人主观因素导致突破本合同或法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例限制的, 管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个工作日内调整至符合要求, 并按相关规定报告或备案。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的, 应当按照相关规定及时报告或备案。</p> <p>.....</p> <p>(六) 投资策略</p> <p>.....</p> <p>2、决策程序</p> <p>(1) 自上而下的资产配置。 管理人资产管理业务投资决策委员会基于资产管理部的研究支持, 决定投资组合中各类资产的分配比例、重点投资范围以及重大投资决策, 赋予投资经理在一定时间范围内实施投资行为的幅度空间。</p> <p>研究支持包括: 依托管理人内外部研究资源, 资产管理部通过对宏观经济政策研究以及数量模型分析, 把握宏观经济与证券市场波动的趋势, 在对各种投资策略进行研究评估后, 定期拟定资产配置建议和拟采取的投资策略, 一并递交投资决策委员会讨论确定。</p> <p>(2) 自下而上的资产选择。 投资经理在既定的资产配置比例和投资策略安排下, 借助资产管理部研究团队、管理人内外部研究资源和集合计划的收益-风险特征, 在备选库的范围内, 结合自身对证券市场和上市公司的分析判断, 决定具体的投资品种、规模并决定买卖时机。</p> <p>研究支持主要包括: 投资策略的收益风险评估, 整合研究资源, 定期编制和维护备选库, 及时向投资经理提供具体的趋势变化分析。</p> <p>.....</p>	<p>(4) 本集合计划参与债券等证券发行申购时, 所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产, 所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>.....</p> <p>(三) 投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等非因管理人主观因素导致资产管理计划投资不符合本合同或法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例和投资限制的, 管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个工作日内调整至符合要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的, 应当按照相关规定及时报告。</p> <p>.....</p> <p>(六) 投资策略</p> <p>.....</p> <p>2、决策程序</p> <p>(1) 自上而下的资产配置。 管理人投资决策委员会基于研究支持, 决定投资组合中各类资产的分配比例、重点投资范围以及重大投资决策, 赋予投资经理在一定时间范围内实施投资行为的幅度空间。</p> <p>研究支持包括: 依托管理人内外部研究资源, 管理人通过对宏观经济政策研究以及数量模型分析, 把握宏观经济与证券市场波动的趋势, 在对各种投资策略进行研究评估后, 定期拟定资产配置建议和拟采取的投资策略, 一并递交投资决策委员会讨论确定。</p> <p>(2) 自下而上的资产选择。 投资经理在既定的资产配置比例和投资策略安排下, 借助管理人研究团队、管理人内外部研究资源和集合计划的收益-风险特征, 在备选库的范围内, 结合自身对证券市场和上市公司的分析判断, 决定具体的投资品种、规模并决定买卖时机。</p> <p>研究支持主要包括: 投资策略的收益风险评估, 整合研究资源, 定期编制和维护备选库, 及时向投资经理提供具体的趋势变化分析。</p> <p>.....</p>
<p>第十四节 利益冲突及关联交易</p>	
<p>第三十五条 集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形</p> <p>本集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形包括但不限于:</p>	<p>第三十五条 集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形</p> <p>本集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形包括但不限于:</p>

(一) 从事关联交易, 包括重大关联交易和一般关联交易。

关联方按照《企业会计准则》的规定确定。本集合计划关联方指管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司。投资者可通过管理人、托管人官方网站查询管理人、托管人年度报告并查阅本集合计划的关联方。

关联交易是指集合计划与管理人、托管人及其关联方之间发生的金融资产投资交易, 具体包括: 1) 在一级市场买入管理人、托管人及其关联方承销期内承销的证券 (不含资产管理产品); 2) 买入管理人、托管人及其关联方发行的证券 (不含资产管理产品); 3) 认购或申购管理人、托管人及其关联方管理的资产管理产品、资产支持证券; 4) 与管理人及其关联方进行对手方交易; 5) 开展以管理人及其关联方发行的证券为质押品的逆回购交易。

其中重大关联交易指: 1) 投资于管理人及其关联方发行的证券 (不含资产管理产品) 或投资于资产支持证券且其管理人为本集合计划管理人或其关联方, 且单日交易金额合计达到本集合计划资产净值的 5% 以上; 2) 投资于管理人及其关联方承销期内承销的证券 (不含资产管理产品) 或投资于管理人及其关联方承销期内承销的资产支持证券, 且单笔交易金额达到本集合计划资产净值的 10% 以上的一级市场交易。

一般关联交易指除重大关联交易以外的关联交易。

(二) 证券期货经营机构及其子公司有权以自有资金参与、退出本集合计划。

(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均有权参与本集合计划。

(四) 其他可能产生利益冲突的情形。

.....

(一) 从事关联交易, 包括重大关联交易和一般关联交易。

关联方按照《企业会计准则》的规定确定。本集合计划关联方指管理人、托管人、投资顾问及前述机构的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司。本集合计划不聘请投资顾问, 投资者可通过管理人网站、托管人年度报告查阅本集合计划的关联方。

关联交易是指资产管理计划与管理人、托管人、投资顾问及其关联方之间发生的交易, 具体包括: 1) 在一级市场买入管理人关联方、托管人及其关联方、投资顾问及其关联方承销期内承销的证券 (不含资产管理产品); 2) 买入管理人及其关联方、托管人及其关联方、投资顾问及其关联方发行的证券 (不含资产管理产品); 3) 认购或申购管理人及其关联方、托管人及其关联方管理的资产管理产品、资产支持证券; 4) 开展以管理人及其关联方发行的证券为质押品的逆回购交易; 5) 租用管理人关联方的证券交易单元; 6) 与管理人或其关联方进行对手方交易 (含转融通出借、融资融券、场外衍生品等)。

其中重大关联交易指: 1) 投资于管理人及其关联方发行的证券 (不含资产管理产品) 或投资于管理人的关联方管理的资产支持证券, 且单日交易金额合计达到资产管理计划资产净值的 5% 以上; 2) 投资于管理人的关联方承销期内承销的证券 (不含资产管理产品、含资产支持证券), 且单笔交易金额达到资产管理计划资产净值的 10% 以上的一级市场交易; 3) 与管理人及其关联方开展场外衍生品交易时, 单笔交易可能造成的最大损失达到资产管理计划资产净值的 10% 以上。

一般关联交易指除重大关联交易以外的关联交易。

管理人有权根据法律法规、监管部门、管理人内部制度等相关要求更新修改关联交易、重大关联交易、一般关联交易的定义或认定标准, 并通过本合同约定的信息披露方式告知投资者和托管人相关事宜, 无须另行履行合同变更程序。

(二) 证券期货经营机构及其子公司有权以自有资金参与、退出本集合计划。

(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均有权参与本集合计划。

(四) 其他可能产生利益冲突的情形。

.....

第十九节 资产管理计划财产的估值和会计核算

第四十二条 集合计划的估值

.....

(五) 估值程序

日常估值由管理人进行，托管人进行复核。用于披露的资产净值由管理人完成估值后将估值结果交托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核，由管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与本集合计划会计账目的核对同时进行。

第四十二条 集合计划的估值

.....

(五) 估值程序

日常估值由管理人进行，托管人进行复核。用于披露的资产净值由管理人完成估值后将估值结果交托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核，由管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与本集合计划会计账目的核对同时进行。集合计划每份额净值的估值结果精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。各方一致同意，管理人有权设立大额赎回情形下的份额净值精度应急调整机制，在发生大额赎回的情形下，管理人可能临时提高本集合计划的份额净值精度，并将在大额赎回对投资者利益不再产生重大影响时，恢复本合同约定的份额净值精度。如启用份额净值精度应急调整机制，管理人将不再另行公告。法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。

第二十节 资产管理计划的费用与税收

.....

第四十六条 管理费

按前一日集合计划资产净值的 0.30% 年费率计提。

计算方法为：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

.....

第四十九条 业绩报酬

在本集合计划分红确认日、投资者退出确认日和计划终止日，将根据投资者的期间年化收益率 (R)，对期间年化收益率超过 3.80% (即业绩报酬计提基准) 以上的部分按照 60% 的比例收取管理人业绩报酬 (以下简称“业绩报酬”)，但若分红确认日距本集合计划的成立日或上一个计提业绩报酬的分红确认日的间隔期间不足 6 个月的，管理人在本次分红确认日不得提取业绩报酬。

管理人有权根据市场情况调低业绩报酬收取比例或调高业绩报酬计提基准，并及时通过公告形式向投资者披露，无需另行征询投资者的意见，但应当书面告知托管人；但若调高业绩报酬收取比例或调低业绩报酬计提基准，应事先按照资产管理合同的约定履行合同变更程序。业绩报酬计提基准仅用于计算管理人的业绩报酬，不构成管理人、托管人保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

如本集合计划开通份额转让，管理人可在投资者

.....

第四十六条 管理费

按前一日集合计划资产净值的 0.20% 年费率计提。

计算方法为：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

.....

第四十九条 业绩报酬

在本集合计划分红确认日、投资者退出确认日和计划终止日，将根据投资者的期间年化收益率 (R)，对期间年化收益率超过 3.30% (即业绩报酬计提基准) 以上的部分按照 50% 的比例收取管理人业绩报酬 (以下简称“业绩报酬”)，但若分红确认日距本集合计划的成立日或上一个计提业绩报酬的分红确认日的间隔期间不足 6 个月的，管理人在本次分红确认日不得提取业绩报酬。

管理人有权根据市场情况调低业绩报酬收取比例或调高业绩报酬计提基准，并及时通过公告形式向投资者披露，无需另行征询投资者的意见，但应当书面告知托管人；但若调高业绩报酬收取比例或调低业绩报酬计提基准，应事先按照资产管理合同的约定履行合同变更程序。业绩报酬计提基准仅用于计算管理人的业绩报酬，不构成管理人、托管人保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

如本集合计划开通份额转让，管理人可在投资者

转出其份额时收取业绩报酬，具体规定以管理人公告为准。

（一）业绩报酬计提原则

1、按投资者每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

2、在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红确认日、投资者退出确认日和计划终止日计提业绩报酬。

3、集合计划分红确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金，在投资者退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。

4、在投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或计划终止时持有份额计算，如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余部分不受影响。

5、如本集合计划在计划终止时有未能流通变现的资产需要延期清算的，为了准确地体现产品最终的投资业绩表现，则管理人在计划终止日应计提的管理人业绩报酬相应顺延至本集合计划全部资产变现后计算，期间业绩表现相应依据在本集合计划全部资产变现后最终清算日当日的份额累计净值与上一次业绩报酬计提基准日的份额累计净值之间的变化，而期间长度则依据上一次业绩报酬计提日至计划终止日之间的间隔天数。

（二）业绩报酬计提方法

业绩报酬计提基准日为本集合计划分红除息日（如有）、投资者退出申请日和计划终止日，业绩报酬计提日为本集合计划分红确认日（如有）、投资者退出确认日和计划终止日，业绩报酬的计提，以上一个发生过业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日（以下简称“上一个业绩报酬计提基准日”）至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准；如投资者该笔份额未发生过业绩报酬计提，募集期参与的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提基准日和上一个业绩报酬计提日，存续期内参与的，以参与申请日为上一个业绩报酬计提基准日，以参与确认为上一个业绩报酬计提日，下同，投资者退出时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔参与份额应收的管理人业绩报酬。

1、期间年化收益率计算

期间年化收益率 $R = [(P1 - P0) / P0x] \times (365 \div T)$

P1=投资者本次业绩报酬计提基准日的份额累计

转出其份额时收取业绩报酬，具体规定以管理人公告为准。

（一）业绩报酬计提原则

1、按投资者每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

2、在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红确认日、投资者退出确认日和计划终止日计提业绩报酬。

3、集合计划分红确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金，在投资者退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。

4、在投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或计划终止时持有份额计算，如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余部分不受影响。

5、如本集合计划在计划终止时有未能流通变现的资产需要延期清算的，为了准确地体现产品最终的投资业绩表现，则管理人在计划终止日应计提的管理人业绩报酬相应顺延至本集合计划全部资产变现后计算，期间业绩表现相应依据在本集合计划全部资产变现后最终清算日当日的份额累计净值与上一次业绩报酬计提基准日的份额累计净值之间的变化，而期间长度则依据上一次业绩报酬计提日至计划终止日之间的间隔天数。

（二）业绩报酬计提方法

业绩报酬计提基准日为本集合计划分红除息日（如有）、投资者退出申请日和计划终止日，业绩报酬计提日为本集合计划分红确认日（如有）、投资者退出确认日和计划终止日，业绩报酬的计提，以上一个发生过业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日（以下简称“上一个业绩报酬计提基准日”）至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准；如投资者该笔份额未发生过业绩报酬计提，募集期参与的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提基准日和上一个业绩报酬计提日，存续期内参与的，以参与申请日为上一个业绩报酬计提基准日，以参与确认为上一个业绩报酬计提日，下同，投资者退出时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔参与份额应收的管理人业绩报酬。

1、期间年化收益率计算

期间年化收益率 $R = [(P1 - P0) / P0x] \times (365 \div T)$

P1=投资者本次业绩报酬计提基准日的份额累计

<p>净值</p> <p>P_0 =投资者上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值</p> <p>P_{0x} =投资者上一个业绩报酬计提基准日的份额净值</p> <p>T =投资者上一个业绩报酬计提日 (含) 到本次业绩报酬计提日 (不含) 的间隔天数。</p> <p>如本集合计划在计划终止时有未能流通变现的资产需要延期清算的, 为了准确地体现产品最终的投资业绩表现, 则管理人在计划终止日应计提的管理人业绩报酬相应顺延至本集合计划全部资产变现后计算, 投资者本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值相应采用在本集合计划全部资产变现后最终清算日当日的份额累计净值。</p> <p>2、管理人以超额比例的方式提取业绩报酬</p> <p>管理人根据投资者的期间年化收益率对期间年化收益率超过 3.80% 以上部分按照 60% 的比例收取管理人业绩报酬。具体计算方式如下:</p> <table border="1" data-bbox="143 952 778 1205"> <thead> <tr> <th>期间年化收益率</th> <th>收取比例</th> <th>管理人业绩报酬计算公式</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R \leq 3.80\%$</td> <td>0</td> <td>$E=0$</td> </tr> <tr> <td>$3.80\% < R$</td> <td>60%</td> <td>$E=N \times P_{0x} \times (R-3.80\%) \times (T \div 365) \times 60\%$</td> </tr> </tbody> </table> <p>E =该笔参与对应的管理人业绩报酬</p> <p>N =投资者该笔参与在上一个业绩报酬计提日的份额数</p> <p>该业绩报酬金额为包含增值税后的总金额, 即管理人收取的不含税业绩报酬为 $E / (1 + \text{增值税税率})$, 增值税为 $E / (1 + \text{增值税税率}) \times \text{增值税税率}$。如出现尾差, 则以发票金额为准。</p> <p>3、将所有参与笔数的管理人业绩报酬加总, 得到总的管理人业绩报酬 ($\sum E$)。</p> <p>$\sum E = E_1 + E_2 + E_3 + \dots + E_n$</p> <p>其中的 n 为所对应的参与笔数。</p> <p>管理人对业绩报酬进行计算, 托管人按管理人指令划款。</p> <p>.....</p>	期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式	$R \leq 3.80\%$	0	$E=0$	$3.80\% < R$	60%	$E=N \times P_{0x} \times (R-3.80\%) \times (T \div 365) \times 60\%$	<p>净值</p> <p>P_0 =投资者上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值</p> <p>P_{0x} =投资者上一个业绩报酬计提基准日的份额净值</p> <p>T =投资者上一个业绩报酬计提日 (含) 到本次业绩报酬计提日 (不含) 的间隔天数。</p> <p>如本集合计划在计划终止时有未能流通变现的资产需要延期清算的, 为了准确地体现产品最终的投资业绩表现, 则管理人在计划终止日应计提的管理人业绩报酬相应顺延至本集合计划全部资产变现后计算, 投资者本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值相应采用在本集合计划全部资产变现后最终清算日当日的份额累计净值。</p> <p>2、管理人以超额比例的方式提取业绩报酬</p> <p>管理人根据投资者的期间年化收益率对期间年化收益率超过 3.30% 以上部分按照 50% 的比例收取管理人业绩报酬。具体计算方式如下:</p> <table border="1" data-bbox="810 952 1445 1205"> <thead> <tr> <th>期间年化收益率</th> <th>收取比例</th> <th>管理人业绩报酬计算公式</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R \leq 3.30\%$</td> <td>0</td> <td>$E=0$</td> </tr> <tr> <td>$3.30\% < R$</td> <td>50%</td> <td>$E=N \times P_{0x} \times (R-3.30\%) \times (T \div 365) \times 50\%$</td> </tr> </tbody> </table> <p>E =该笔参与对应的管理人业绩报酬</p> <p>N =投资者该笔参与在上一个业绩报酬计提日的份额数</p> <p>该业绩报酬金额为包含增值税后的总金额, 即管理人收取的不含税业绩报酬为 $E / (1 + \text{增值税税率})$, 增值税为 $E / (1 + \text{增值税税率}) \times \text{增值税税率}$。如出现尾差, 则以发票金额为准。</p> <p>3、将所有参与笔数的管理人业绩报酬加总, 得到总的管理人业绩报酬 ($\sum E$)。</p> <p>$\sum E = E_1 + E_2 + E_3 + \dots + E_n$</p> <p>其中的 n 为所对应的参与笔数。</p> <p>管理人对业绩报酬进行计算, 托管人按管理人指令划款。</p> <p>.....</p>	期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式	$R \leq 3.30\%$	0	$E=0$	$3.30\% < R$	50%	$E=N \times P_{0x} \times (R-3.30\%) \times (T \div 365) \times 50\%$
期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式																	
$R \leq 3.80\%$	0	$E=0$																	
$3.80\% < R$	60%	$E=N \times P_{0x} \times (R-3.80\%) \times (T \div 365) \times 60\%$																	
期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式																	
$R \leq 3.30\%$	0	$E=0$																	
$3.30\% < R$	50%	$E=N \times P_{0x} \times (R-3.30\%) \times (T \div 365) \times 50\%$																	
<p>第二十二节 信息披露与报告</p> <p>第五十一条 披露信息的种类、内容、频率和方式</p> <p>.....</p> <p>(三) 披露信息的方式</p> <p>除特别明确约定外, 本合同中约定的管理人向投</p>	<p>第二十二节 信息披露与报告</p> <p>第五十一条 披露信息的种类、内容、频率和方式</p> <p>.....</p> <p>(三) 披露信息的方式</p> <p>除特别明确约定外, 本合同中约定的管理人向投</p>																		

<p>投资者进行的通知、通告、告知等都通过管理人网站（www.cs.ecitic.com）向投资者披露，不另行单独通知投资者。</p> <p>.....</p>	<p>投资者进行的通知、通告、告知等都通过管理人网站向投资者披露，不另行单独通知投资者。</p> <p>集合计划每份额净值的估值结果精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，但在发生大额赎回的情形下，管理人可能设立份额净值精度应急调整机制，临时提高本集合计划的份额净值精度。因为技术系统等原因，本集合计划的销售机构可能无法按提高后的份额净值精度进行展示，投资者可以通过管理人网站查阅本集合计划准确的份额净值。</p> <p>.....</p>
<p>第二十三节 风险揭示</p>	
<p>.....</p> <p>(二) 一般风险揭示</p> <p>.....</p> <p>10、合同变更风险</p> <p>.....</p> <p>(4) 调低参与费率、调低退出费率、调低管理费费率、调低托管费率、调低业绩报酬收取比例和调高业绩报酬计提基准，不需要征求投资者意见。管理人有权仅通过公告进行前述调整。</p> <p>.....</p> <p>13、关联交易的风险</p> <p>管理人可能运用资产管理计划财产从事关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、充分关注。同时，托管人关联方名单由托管人提供，可能存在托管人不提供前述名单或提供的名单不完整的情形。投资者可能面临因本计划关联方名单的获取、界定、识别不准确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关重大关联交易，以至于本集合计划从事前述相关重大关联交易未事先再单独征询投资者意见的风险及其他可能的相关风险，也可能存在投资者认知的本计划关联方、一般和重大关联交易的区分标准与管理人采用的名单和标准不完全一致的风险。</p> <p>此外，投资者一旦签署本合同即代表投资者同意管理人从事除重大关联交易以外的一般关联交易，管理人将不会另行逐笔事先征询投资者的意见，因此存在投资者无法事前知悉每笔一般关联交易的风险。同时，管理人从事重大关联交易的，会事先通知全体投资者并征询投资者的意见，但管理人征询的方式、投资者反馈的方式和时限均由管理人确定，可能存在投资者在管理人或销售机构留存的通讯信息（包括但不限于联系电话/手机、通讯地址、住所地、电子邮箱等）不准确、未更新而导致管理人无法及时通知到投</p>	<p>.....</p> <p>(二) 一般风险揭示</p> <p>.....</p> <p>10、合同变更风险</p> <p>.....</p> <p>(4) 调低参与费率、调低管理费费率、调低托管费率、调低业绩报酬收取比例和调高业绩报酬计提基准，不需要征求投资者意见。管理人有权仅通过公告进行前述调整。</p> <p>.....</p> <p>13、关联交易的风险</p> <p>管理人可能运用资产管理计划财产从事关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、充分关注。同时，托管人关联方名单由托管人提供，可能存在托管人不提供前述名单或提供的名单不完整的情形。投资者可能面临因本计划关联方名单的获取、界定、识别不准确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关重大关联交易，以至于本集合计划从事前述相关重大关联交易未事先再单独征询投资者意见的风险及其他可能的相关风险，也可能存在投资者认知的本计划关联方、一般和重大关联交易的区分标准与管理人采用的名单和标准不完全一致的风险。</p> <p>此外，投资者一旦签署本合同即代表投资者同意管理人从事除重大关联交易以外的一般关联交易，管理人将不会另行逐笔事先征询投资者的意见，因此存在投资者无法事前知悉每笔一般关联交易的风险。同时，管理人从事重大关联交易的，会事先通知全体投资者并征询投资者的意见，但管理人征询的方式、投资者反馈的方式和时限均由管理人确定，可能存在投资者在管理人或销售机构留存的通讯信息（包括但不限于联系电话/手机、通讯地址、住所地、电子邮箱等）不准确、未更新而导致管理人无法及时通知到投</p>

<p>资者, 或发生投资者未及时查阅相关信息导致最终未及时反馈意见的风险; 或发生因投资者未按照管理人通知中要求的时间和方式进行反馈、或在反馈中意见表示不明确, 而被视为反馈了同意意见的情形, 从而可能存在进行该笔重大关联交易与投资者主观意愿不相符的风险。</p> <p>.....</p>	<p>资者, 或发生投资者未及时查阅相关信息导致最终未及时反馈意见的风险; 或发生因投资者未按照管理人通知中要求的时间和方式进行反馈、或在反馈中意见表示不明确, 而被视为反馈了同意意见的情形, 从而可能存在进行该笔重大关联交易与投资者主观意愿不相符的风险。</p> <p>同时, 管理人可能通过本合同约定的信息披露方式更新修改关联交易、重大关联交易、一般关联交易的定义或认定标准, 可能存在投资者未及时查阅相关信息导致投资者理解的关联交易事项与实际监控标准不一致的风险。</p> <p>.....</p> <p>(新增) 17、管理人可能设立份额净值精度应急调整机制的风险</p> <p>本集合计划每份额净值的估值结果精确到0.0001元, 小数点后第5位四舍五入, 但在发生大额赎回的情形下, 管理人可能设立份额净值精度应急调整机制, 临时提高本集合计划的份额净值精度。因为技术系统等原因, 本集合计划的销售机构可能无法按提高后的净值精度进行展示, 导致投资者在销售机构与在管理人网站查询的份额净值不同, 进而存在投资者按照销售机构展示的份额净值计算的申购份额、赎回金额与登记结算机构的确认结果不一致的风险, 请投资者对此充分知悉。</p> <p>另外, 如启用份额净值精度应急调整机制 (包括提高或恢复份额净值精度等), 管理人将不再另行公告。可能存在投资者无法提前获知本集合计划份额净值精度调整的相关事宜, 并进而导致本集合计划的份额净值与投资者自行计算的结果不一致的风险。</p> <p>.....</p>
<p>第二十四节 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p>	
<p>第五十七条 合同变更</p> <p>.....</p> <p>2.管理人有权在合同变更征询期对本集合计划设置特殊赎回开放日, 不同意合同变更的投资者, 应在该赎回开放日办理本集合计划的退出事宜, 投资者未退出的视为同意合同变更。在特殊赎回开放日赎回的份额无须承担退出费。本资产管理合同变更生效后, 投资者有权在任何开放日按照本资产管理合同的相关约定申请退出, 但须按合同约定承担退出费。</p> <p>.....</p>	<p>第五十七条 合同变更</p> <p>.....</p> <p>2.管理人有权在合同变更征询期对本集合计划设置特殊赎回开放日, 不同意合同变更的投资者, 应在该赎回开放日办理本集合计划的退出事宜, 投资者未退出的视为同意合同变更。本资产管理合同变更生效后, 投资者有权在任何开放日按照本资产管理合同的相关约定申请退出。</p> <p>.....</p>
<p>原合同其他变更之处:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、原合同中所涉及的“中信证券股份有限公司”均更新为“中信证券资产管理有限公司”; 2、原合同中所涉及的管理人网站网址均更新为“www.citicsam.com”; 	

3、原合同中与此次变更后的内容不一致之处，以此次变更后的内容为准。

附件二:

中信证券信信向荣 3 号集合资产管理计划说明书

变更条款对照表

变更前	变更后		
一、资产管理计划的当事人			
<p>管理人: 名称: 中信证券股份有限公司 住所: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座 法定代表人: 张佑君 通讯地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 联系电话: 95548 转 5 公司网址: www.cs.ecitic.com 中信证券股份有限公司成立于 1995 年 10 月, 2003 年在上海证券交易所挂牌上市交易, 2011 年在香港联合交易所挂牌上市交易, 是中国第一家 A+H 股上市的证券公司。公司收入和净利润连续十多年保持行业第一; 净资本、净资产和总资产等规模优势显著; 各项业务保持市场领先地位, 在国内市场积累了广泛的声誉和品牌优势。公司多年来获得亚洲货币、英国金融时报、福布斯、沪深证券交易所等境内外机构颁发的各类奖项。</p>	<p>管理人: 名称: 中信证券资产管理有限公司 住所: 北京市丰台区金丽南路 3 号院 2 号楼 1 至 16 层 01 内六层 1-288 室 法定代表人: 杨冰 通讯地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 16 层 联系电话: 95548 转 5 中信证券资产管理有限公司成立于 2023 年 3 月 1 日, 主要从事证券资产管理业务, 致力于以专业的投研力量、完整的产品体系、周到的客户服务为投资者创造价值, 为支持经济转型发展和满足人民群众财富管理需求提供高质量的综合资产管理服务。</p>		
六、资产管理计划的参与、退出			
<p>集合计划的参与、退出: (二) 参与和退出的开放日和时间 1、开放期: 本集合计划成立后, 每个星期三为开放日 (如遇非工作日则顺延至该日之后最近一个工作日), 投资者可以在开放期办理参与、退出业务 (管理人通告暂停参与、退出时除外)。 (六) 参与和退出的费用 退出费用由投资者另行承担, 并全额计入集合计划财产。 本集合计划退出费率按照集合计划份额持有期限的不同设置不同的退出费率, 具体退出费率如下表所示:</p> <table border="1"><thead><tr><th>连续持有时间 (N)</th><th>退出费率</th></tr></thead></table>	连续持有时间 (N)	退出费率	<p>集合计划的参与、退出: (二) 参与和退出的开放日和时间 1、开放期: 本集合计划成立后, 每个星期二、三、四为开放日 (如遇非工作日则顺延至该日之后最近一个工作日), 投资者可以在开放期办理参与、退出业务 (管理人通告暂停参与、退出时除外)。 (六) 参与和退出的费用 退出费用由投资者另行承担, 并全额计入集合计划财产。 本集合计划的退出费率为零。</p>
连续持有时间 (N)	退出费率		

<table border="1"> <tr> <td>N < 180 天</td> <td>1%</td> </tr> <tr> <td>N ≥ 180 天</td> <td>0%</td> </tr> </table>	N < 180 天	1%	N ≥ 180 天	0%		
N < 180 天	1%					
N ≥ 180 天	0%					
<p>管理人有权在履行合同变更手续后调高本集合计划的参与费率或退出费率，但管理人调低参与费率或退出费率的，无需另行征询投资者的意见、履行合同变更程序，仅通过管理人网站提前公告即可。</p> <p>根据《集合资产管理合同》第五十七条（一）款进行合同变更时，本集合计划对在特殊赎回开放日赎回的份额不收取退出费。</p>						
<p>七、资产管理计划的投资</p>						
<p>投资范围及比例</p> <p>2、投资比例</p> <p>(4) 本集合计划参与债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>投资策略</p> <p>1、决策程序</p> <p>(1) 自上而下的资产配置。 管理人资产管理业务投资决策委员会基于资产管理部的研究支持，决定投资组合中各类资产的分配比例、重点投资范围以及重大投资决策，赋予投资经理在一定时间范围内实施投资行为的幅度空间。</p> <p>研究支持包括：依托管理人内外部研究资源，资产管理部通过对宏观经济政策研究以及数量模型分析，把握宏观经济与证券市场波动的趋势，在对各种投资策略进行研究评估后，定期拟定资产配置建议和拟采取的投资策略，一并递交投资决策委员会讨论确定。</p> <p>(2) 自下而上的资产选择。 投资经理在既定的资产配置比例和投资策略安排下，借助资产管理部研究团队、管理人内外部研究资源和集合计划的收益-风险特征，在备选库的范围内，结合自身对证券市场和上市公司的分析判断，决定具体的投资品种、规模并决定买卖时机。</p> <p>研究支持主要包括：投资策略的收益风险评估，整合研究资源，定期编制和维护备选库，及时向投资经理提供具体的趋势变化分析。</p>		<p>投资范围及比例</p> <p>2、投资比例</p> <p>(4) 本集合计划参与债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>投资策略</p> <p>1、决策程序</p> <p>(1) 自上而下的资产配置。 管理人投资决策委员会基于研究支持，决定投资组合中各类资产的分配比例、重点投资范围以及重大投资决策，赋予投资经理在一定时间范围内实施投资行为的幅度空间。</p> <p>研究支持包括：依托管理人内外部研究资源，管理人通过对宏观经济政策研究以及数量模型分析，把握宏观经济与证券市场波动的趋势，在对各种投资策略进行研究评估后，定期拟定资产配置建议和拟采取的投资策略，一并递交投资决策委员会讨论确定。</p> <p>(2) 自下而上的资产选择。 投资经理在既定的资产配置比例和投资策略安排下，借助管理人研究团队、管理人内外部研究资源和集合计划的收益-风险特征，在备选库的范围内，结合自身对证券市场和上市公司的分析判断，决定具体的投资品种、规模并决定买卖时机。</p> <p>研究支持主要包括：投资策略的收益风险评估，整合研究资源，定期编制和维护备选库，及时向投资经理提供具体的趋势变化分析。</p>				
<p>八、利益冲突及关联交易</p>						

集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形:

本集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形包括但不限于:

(一) 从事关联交易, 包括重大关联交易和一般关联交易。

关联方按照《企业会计准则》的规定确定。本集合计划关联方指管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司。投资者可通过管理人、托管人官方网站查询管理人、托管人年度报告并查阅本集合计划的关联方。

关联交易是指集合计划与管理人、托管人及其关联方之间发生的金融资产投资交易, 具体包括: 1) 在一级市场买入管理人、托管人及其关联方承销期内承销的证券 (不含资产管理产品); 2) 买入管理人、托管人及其关联方发行的证券 (不含资产管理产品); 3) 认购或申购管理人、托管人及其关联方管理的资产管理产品、资产支持证券; 4) 与管理人及其关联方进行对手方交易; 5) 开展以管理人及其关联方发行的证券为质押品的逆回购交易。

其中重大关联交易指: 1) 投资于管理人及其关联方发行的证券 (不含资产管理产品) 或投资于资产支持证券且其管理人为本集合计划管理人或其关联方, 且单日交易金额合计达到本集合计划资产净值的 5% 以上; 2) 投资于管理人及其关联方承销期内承销的证券 (不含资产管理产品) 或投资于管理人及其关联方承销期内承销的资产支持证券, 且单笔交易金额达到本集合计划资产净值的 10% 以上的一级市场交易。

一般关联交易指除重大关联交易以外的关联交易。

(二) 证券期货经营机构及其子公司有权以自有资金参与、退出本集合计划。

(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均有权参与本集合计划。

(四) 其他可能产生利益冲突的情形。

……

集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形:

本集合计划存在的或可能存在的利益冲突情形包括但不限于:

(一) 从事关联交易, 包括重大关联交易和一般关联交易。

关联方按照《企业会计准则》的规定确定。本集合计划关联方指管理人、托管人、投资顾问及前述机构的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司。本集合计划不聘请投资顾问, 投资者可通过管理人网站、托管人年度报告查阅本集合计划的关联方。

关联交易是指资产管理计划与管理人、托管人、投资顾问及其关联方之间发生的交易, 具体包括: 1) 在一级市场买入管理人关联方、托管人及其关联方、投资顾问及其关联方承销期内承销的证券 (不含资产管理产品); 2) 买入管理人及其关联方、托管人及其关联方、投资顾问及其关联方发行的证券 (不含资产管理产品); 3) 认购或申购管理人及其关联方、托管人及其关联方管理的资产管理产品、资产支持证券; 4) 开展以管理人及其关联方发行的证券为质押品的逆回购交易; 5) 租用管理人关联方的证券交易单元; 6) 与管理人或其关联方进行的手续方交易 (含转融通出借、融资融券、场外衍生品等)。

其中重大关联交易指: 1) 投资于管理人及其关联方发行的证券 (不含资产管理产品) 或投资于管理人的关联方管理的资产支持证券, 且单日交易金额合计达到资产管理计划资产净值的 5% 以上; 2) 投资于管理人的关联方承销期内承销的证券 (不含资产管理产品、含资产支持证券), 且单笔交易金额达到资产管理计划资产净值的 10% 以上的一级市场交易; 3) 与管理人及其关联方开展场外衍生品交易时, 单笔交易可能造成的最大损失达到资产管理计划资产净值的 10% 以上。

一般关联交易指除重大关联交易以外的关联交易。

管理人有权根据法律法规、监管部门、管理人内部制度等相关要求更新修改关联交易、重大关联交易、一般关联交易的定义或认定标准, 并通过《集合资产管理合同》约定的信息披露方式告知投资者和托管人相关事宜, 无须另行履行合同变更程序。

(二) 证券期货经营机构及其子公司有权以自有资金参与、退出本集合计划。

(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均有权参与本

集合计划。
(四) 其他可能产生利益冲突的情形。
.....

九、资产管理计划的费用

参与、退出费:

- 1、参与费 (认购/申购费率) : 0%;
- 2、退出费: 按照集合计划份额持有期限的不同设置不同的退出费率, 具体退出费率如下表所示:

连续持有时间 (N)	退出费率
N < 180 天	1%
N ≥ 180 天	0

.....

管理费:

按前一日集合计划资产净值的 0.30% 年费率计提。

计算方法为:

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

.....

业绩报酬:

在本集合计划分红确认日、投资者退出确认日和计划终止日, 将根据投资者的期间年化收益率 (R), 对期间年化收益率超过 3.80% (即业绩报酬计提基准) 以上的部分按照 60% 的比例收取管理人业绩报酬 (以下简称“业绩报酬”), 但若分红确认日距本集合计划的成立日或上一个计提业绩报酬的分红确认日的间隔期间不足 6 个月的, 管理人在本次分红确认日不得提取业绩报酬。

管理人有权根据市场情况调低业绩报酬收取比例或调高业绩报酬计提基准, 并及时通过公告形式向投资者披露, 无需另行征询投资者的意见, 但应当书面告知托管人; 但若调高业绩报酬收取比例或调低业绩报酬计提基准, 应事先按照资产管理合同的约定履行合同变更程序。业绩报酬计提基准仅用于计算管理人的业绩报酬, 不构成管理人、托管人保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

如本集合计划开通份额转让, 管理人可在投资者转出其份额时收取业绩报酬, 具体规定以管理人公告为准。

(一) 业绩报酬计提原则

1、按投资者每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

2、在符合业绩报酬计提条件时, 在本集合计划分红确认日、投资者退出确认日和计划终止日计提业绩报酬。

参与、退出费:

- 1、参与费 (认购/申购费率) : 0%;
 - 2、退出费: 0%;
-

管理费:

按前一日集合计划资产净值的 0.20% 年费率计提。

计算方法为:

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

.....

业绩报酬

在本集合计划分红确认日、投资者退出确认日和计划终止日, 将根据投资者的期间年化收益率 (R), 对期间年化收益率超过 3.30% (即业绩报酬计提基准) 以上的部分按照 50% 的比例收取管理人业绩报酬 (以下简称“业绩报酬”), 但若分红确认日距本集合计划的成立日或上一个计提业绩报酬的分红确认日的间隔期间不足 6 个月的, 管理人在本次分红确认日不得提取业绩报酬。

管理人有权根据市场情况调低业绩报酬收取比例或调高业绩报酬计提基准, 并及时通过公告形式向投资者披露, 无需另行征询投资者的意见, 但应当书面告知托管人; 但若调高业绩报酬收取比例或调低业绩报酬计提基准, 应事先按照资产管理合同的约定履行合同变更程序。业绩报酬计提基准仅用于计算管理人的业绩报酬, 不构成管理人、托管人保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

如本集合计划开通份额转让, 管理人可在投资者转出其份额时收取业绩报酬, 具体规定以管理人公告为准。

(一) 业绩报酬计提原则

1、按投资者每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

2、在符合业绩报酬计提条件时, 在本集合计划分红确认日、投资者退出确认日和计划终止日计提业绩报酬。

3、集合计划分红确认日提取业绩报酬的, 业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金。在投资者退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的, 业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。

3、集合计划分红确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金。在投资者退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。

4、在投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余部分不受影响。

5、如本集合计划在计划终止时有未能流通变现的资产需要延期清算的，为了准确地体现产品最终的投资业绩表现，则管理人在计划终止日应计提的管理人业绩报酬相应顺延至本集合计划全部资产变现后计算，期间业绩表现相应依据在本集合计划全部资产变现后最终清算日当日的份额累计净值与上一次业绩报酬计提基准日的份额累计净值之间的变化，而期间长度则依据上一次业绩报酬计提日至计划终止日之间的间隔天数。

(二) 业绩报酬计提方法

业绩报酬计提基准日为本集合计划分红除息日（如有）、投资者退出申请日和计划终止日。业绩报酬计提日为本集合计划分红确认日（如有）、投资者退出确认日和计划终止日。业绩报酬的计提，以上一个发生过业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日（以下简称“上一个业绩报酬计提基准日”）至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准；如投资者该笔份额未发生过业绩报酬计提，募集期参与的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提基准日和上一个业绩报酬计提日，存续期内参与的，以参与申请日为上一个业绩报酬计提基准日，以参与确认为上一个业绩报酬计提日，下同。投资者退出时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔参与份额应收的管理人业绩报酬。

1、期间年化收益率计算

期间年化收益率 $R = [(P1 - P0) / P0x] \times (365 \div T)$

$P1$ = 投资者本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值

$P0$ = 投资者上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值

$P0x$ = 投资者上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值

T = 投资者上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的间隔天数。

如本集合计划在计划终止时有未能流通变现的

4、在投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余部分不受影响。

5、如本集合计划在计划终止时有未能流通变现的资产需要延期清算的，为了准确地体现产品最终的投资业绩表现，则管理人在计划终止日应计提的管理人业绩报酬相应顺延至本集合计划全部资产变现后计算，期间业绩表现相应依据在本集合计划全部资产变现后最终清算日当日的份额累计净值与上一次业绩报酬计提基准日的份额累计净值之间的变化，而期间长度则依据上一次业绩报酬计提日至计划终止日之间的间隔天数。

(二) 业绩报酬计提方法

业绩报酬计提基准日为本集合计划分红除息日（如有）、投资者退出申请日和计划终止日。业绩报酬计提日为本集合计划分红确认日（如有）、投资者退出确认日和计划终止日。业绩报酬的计提，以上一个发生过业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日（以下简称“上一个业绩报酬计提基准日”）至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准；如投资者该笔份额未发生过业绩报酬计提，募集期参与的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提基准日和上一个业绩报酬计提日，存续期内参与的，以参与申请日为上一个业绩报酬计提基准日，以参与确认为上一个业绩报酬计提日，下同。投资者退出时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔参与份额应收的管理人业绩报酬。

1、期间年化收益率计算

期间年化收益率 $R = [(P1 - P0) / P0x] \times (365 \div T)$

$P1$ = 投资者本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值

$P0$ = 投资者上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值

$P0x$ = 投资者上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值

T = 投资者上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的间隔天数。

如本集合计划在计划终止时有未能流通变现的资产需要延期清算的，为了准确地体现产品最终的投资业绩表现，则管理人在计划终止日应计提的管理人业绩报酬相应顺延至本集合计划全部资产变现后计算，投资者本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值

资产需要延期清算的,为了准确地体现产品最终的投资业绩表现,则管理人在计划终止日应计提的管理人业绩报酬相应顺延至本集合计划全部资产变现后计算,投资者本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值相应采用在本集合计划全部资产变现后最终清算日当日的份额累计净值。

2、管理人以超额比例的方式提取业绩报酬

管理人根据投资者的期间年化收益率对期间年化收益率超过 3.80%以上部分按照 60%的比例收取管理人业绩报酬。具体计算方式如下:

期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式
$R \leq 3.80\%$	0	$E=0$
$3.80\% < R$	60%	$E=N \times P0x \times (R-3.80\%) \times (T \div 365) \times 60\%$

E =该笔参与对应的管理人业绩报酬

N =投资者该笔参与在上一个业绩报酬计提日的份额数

该业绩报酬金额为包含增值税后的总金额,即管理人收取的不含税业绩报酬为 $E / (1 + \text{增值税税率})$, 增值税为 $E / (1 + \text{增值税税率}) \times \text{增值税税率}$ 。如出现尾差,则以发票金额为准。

3、将所有参与笔数的管理人业绩报酬加总,得到总的管理人业绩报酬 ($\sum E$)。

$$\sum E = E1 + E2 + E3 + \dots + En$$

其中的 n 为所对应的参与笔数。

管理人对业绩报酬进行计算,托管人按管理人指令划款。

.....

相应采用在本集合计划全部资产变现后最终清算日当日的份额累计净值。

2、管理人以超额比例的方式提取业绩报酬

管理人根据投资者的期间年化收益率对期间年化收益率超过 3.30%以上部分按照 50%的比例收取管理人业绩报酬。具体计算方式如下:

期间年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式
$R \leq 3.30\%$	0	$E=0$
$3.30\% < R$	50%	$E=N \times P0x \times (R-3.30\%) \times (T \div 365) \times 50\%$

E =该笔参与对应的管理人业绩报酬

N =投资者该笔参与在上一个业绩报酬计提日的份额数

该业绩报酬金额为包含增值税后的总金额,即管理人收取的不含税业绩报酬为 $E / (1 + \text{增值税税率})$, 增值税为 $E / (1 + \text{增值税税率}) \times \text{增值税税率}$ 。如出现尾差,则以发票金额为准。

3、将所有参与笔数的管理人业绩报酬加总,得到总的管理人业绩报酬 ($\sum E$)。

$$\sum E = E1 + E2 + E3 + \dots + En$$

其中的 n 为所对应的参与笔数。

管理人对业绩报酬进行计算,托管人按管理人指令划款。

.....

信信向荣 3 号原说明书其他变更之处:

- 1、原说明书中所涉及的“中信证券股份有限公司”均更新为“中信证券资产管理有限公司”;
- 2、原说明书中所涉及的管理人网站网址均更新为“www.citicsam.com”;
- 3、原说明书中与此次变更后的内容不一致之处,以此次变更后的内容为准。

附件三:

中信证券信向荣3号集合资产管理计划风险揭示书

变更条款对照表

变更前	变更后
二、风险揭示	
..... (二) 一般风险揭示 10、合同变更风险 (4) 调低参与费率、调低退出费率、调低管理费费率、调低托管费率、调低业绩报酬收取比例和调高业绩报酬计提基准,不需要征求投资者意见,管理人有权仅通过公告进行前述调整。 13、关联交易的风险 管理人可能运用资产管理计划财产从事关联交易,相关投资存在一定风险,提请投资者知悉、充分关注。同时,托管人关联方名单由托管人提供,可能存在托管人不提供前述名单或提供的名单不完整的情形。投资者可能面临因本计划关联方名单的获取、界定、识别不准确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关重大关联交易,以至于本集合计划从事前述相关重大关联交易未事先再单独征询投资者意见的风险及其他可能的相关风险,也可能存在投资者认知的本计划关联方、一般和重大关联交易的区分标准与管理人采用的名单和标准不完全一致的风险。 此外,投资者一旦签署《集合资产管理合同》即代表投资者同意管理人从事除重大关联交易以外的一般关联交易,管理人将不会另行逐笔事先征询投资者的意见,因此存在投资者无法事前知悉每笔一般关联交易的风险。同时,管理人从事重大关联交易的,会事先通知全体投资者并征询投资者的意见,但管理人征询的方式、投资者反馈的方式和时限均由管理人确定,可能存在投资者在管理人或销售机构留存的通讯信息(包括但不限于联系电话/手机、通讯地址、住所地、电子邮箱等)不准确、未更新而导致管理人无法及时通知到投资者,或发生投资者未及时查阅相关信息导致最终未及时反馈意见的风险;或发生因投资者未按照管理人通知中要求的时间和方式进行反 (二) 一般风险揭示 10、合同变更风险 (4) 调低参与费率、调低退出费率、调低管理费费率、调低托管费率,不需要征求投资者意见,管理人有权仅通过公告进行前述调整。 13、关联交易的风险 管理人可能运用资产管理计划财产从事关联交易,相关投资存在一定风险,提请投资者知悉、充分关注。同时,托管人关联方名单由托管人提供,可能存在托管人不提供前述名单或提供的名单不完整的情形。投资者可能面临因本计划关联方名单的获取、界定、识别不准确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关重大关联交易,以至于本集合计划从事前述相关重大关联交易未事先再单独征询投资者意见的风险及其他可能的相关风险,也可能存在投资者认知的本计划关联方、一般和重大关联交易的区分标准与管理人采用的名单和标准不完全一致的风险。 此外,投资者一旦签署《集合资产管理合同》即代表投资者同意管理人从事除重大关联交易以外的一般关联交易,管理人将不会另行逐笔事先征询投资者的意见,因此存在投资者无法事前知悉每笔一般关联交易的风险。同时,管理人从事重大关联交易的,会事先通知全体投资者并征询投资者的意见,但管理人征询的方式、投资者反馈的方式和时限均由管理人确定,可能存在投资者在管理人或销售机构留存的通讯信息(包括但不限于联系电话/手机、通讯地址、住所地、电子邮箱等)不准确、未更新而导致管理人无法及时通知到投资者,或发生投资者未及时查阅相关信息导致最终未及时反馈意见的风险;或发生因投资者未按照管理人通知中要求的时间和方式进行反

馈、或在反馈中意见表示不明确，而被视为反馈了同意意见的情形，从而可能存在进行该笔重大关联交易与投资者主观意愿不相符的风险。

.....

意见的情形，从而可能存在进行该笔重大关联交易与投资者主观意愿不相符的风险。

同时，管理人可能通过《集合资产管理合同》约定的信息披露方式更新修改关联交易、重大关联交易、一般关联交易的定义或认定标准，可能存在投资者未及时查阅相关信息导致投资者理解的关联交易事项与实际监控标准不一致的风险。

.....

(新增) 17、管理人可能设立份额净值精度应急调整机制的风险

本集合计划每份额净值的估值结果精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入，但在发生大额赎回的情形下，管理人可能设立份额净值精度应急调整机制，临时提高本集合计划的份额净值精度。因为技术系统等原因，本集合计划的销售机构可能无法按提高后的净值精度进行展示，导致投资者在销售机构与在管理人网站查询的份额净值不同，进而存在投资者按照销售机构展示的份额净值计算的申购份额、赎回金额与登记结算机构的确认结果不一致的风险，请投资者对此充分知悉。

另外，如启用份额净值精度应急调整机制（包括提高或恢复份额净值精度等），管理人将不再另行公告，可能存在投资者无法提前获知本集合计划份额净值精度调整的相关事宜，并进而导致本集合计划的份额净值与投资者自行计算的结果不一致的风险。

.....

原风险揭示书其他变更之处：

- 1、原风险揭示书中所涉及的“中信证券股份有限公司”均更新为“中信证券资产管理有限公司”；
- 2、原风险揭示书中所涉及的管理人网站网址均更新为“www.citicsam.com”；
- 3、原风险揭示书中与此次变更后的内容不一致之处，以此次变更后的内容为准。

