

关于申港证券睿泽月添利 1 号集合资产管理计划 资产管理合同变更的协商函（一）

上海银行股份有限公司：

申港证券股份有限公司（以下简称“我司”或“申港证券”）管理的“申港证券睿泽月添利 1 号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）于 2023 年 6 月 21 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，拟变更部分合同条款，并征求贵行意见，根据《申港证券睿泽月添利 1 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十五章“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”之第 1、2 条约定：

“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。”

一、变更对照明细表如下：

1、对原合同第二章“释义”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
<p>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</p>	<p>最低认购金额：指在初始募集期内投资者的最低投资金额，本合同中指人民币 30 万元</p> <p>最低参与金额：指在存续期内投资者的最低投资金额，不低于人民币 30 万元，具体以管理人的公告为准</p>

2、对原合同第八章“集合计划的参与、退出与转让”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
<p>(五) 参与和退出的金额限制</p> <p>1、投资者在集合计划存续期开放日购买集合计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应满足本集合计划初始募集期最低参与金额限制（不含参与费用），已持有集合计划份额的投资者在集合计划存续期开放日追加购买集合计划份额的除外。若参与金额超过上述最低金额，则超出部分金额不设级差，追加参与的最低金额为人民币 1 万元（不含参与费用），超出部分金额不设级差。</p> <p>2、投资者单笔退出的最低份额为</p>	<p>(五) 参与和退出的金额限制</p> <p>1、投资者在集合计划存续期开放日购买集合计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且最低参与金额不低于人民币 30 万元（不含参与费用），已持有集合计划份额的投资者在集合计划存续期开放日追加购买集合计划份额的除外。若参与金额超过最低参与金额或追加参与金额超过最低追加参与金额，超出部分金额不设级差。在符合相关监管规定及合同约定的前提下，管理人可以公告形式对最低参与金额、最低追加参与金额、参与及追加级差金额</p>

<p>10000 份，本集合计划不设退出次数限制。</p> <p>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）。投资者持有的集合计划份额净值低于最低持有金额时，需要退出集合计划的，应当一次性全部退出。若某笔退出导致该投资者持有的资产净值低于最低持有金额时，则该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。</p> <p>4、本集合计划最低参与金额可在法律法规和本合同规定范围内进行调整，具体调整方案详见管理人公告或开放期公告。管理人公告调整最低参与金额的，合格投资者的最低持有金额（人民币 30 万元）不变。</p>	<p>进行设置、调整，具体以管理人公告为准。</p> <p>2、投资者单笔退出的最低份额为 10000 份，本集合计划不设退出次数限制。</p> <p>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）。投资者持有的集合计划份额净值低于最低持有金额时，需要退出集合计划的，应当一次性全部退出。若某笔退出导致该投资者持有的资产净值低于最低持有金额时，则该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。</p>
<p>（六）参与和退出的费用</p> <p>1、参与费率：0.1%。</p> <p>2、退出费率：0%，本集合计划不收取退出费用。</p>	<p>（六）参与和退出的费用</p> <p>1、参与费率：0%，本集合计划不收取参与费用。</p> <p>2、退出费率：0%，本集合计划不收取退出费用。</p>

3、对原合同第十五章“投资经理的指定与变更”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（一）投资经理的指定	（一）投资经理的指定

<p>本集合计划投资经理由管理人负责指定。</p> <p>管理人指定本集合计划的投资经理为：程杨、胡燕杰，投资经理简介如下：</p> <p>程杨先生，北京理工大学工学硕士，不存在兼职情况。曾任职五矿证券固定收益部债券交易员，申港证券资产管理部投资经理助理、交易员、研究员。具有丰富的固定收益市场投资研究经验，擅于自下而上跟踪市场获取信用风险溢价。具备基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>胡燕杰女士，上海交通大学工商管理硕士，不存在兼职情况。6年以上固定收益投资交易经验，历任联讯证券交易员、平安信托投资经理、东海基金投资经理等职。对各层级城投发债主体有较为详尽的研究。具备基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p>	<p>本集合计划投资经理由管理人负责指定。</p> <p>管理人指定本集合计划的投资经理为：冯洁莹、程杨、段奕冰，投资经理简介如下：</p> <p>冯洁莹女士，清华大学经济学学士，不存在兼职情况。曾从事海外衍生品的投资交易，以及国内固收类证券及衍生品策略的研究和交易，先后任职于交易、研究、投资等岗位，从业时间超过10年，在产品设计和投资交易领域具有丰富经验。</p> <p>程杨先生，北京理工大学工学硕士，不存在兼职情况。曾任职五矿证券固定收益部债券交易员，申港证券资产管理部投资经理助理、交易员、研究员。具有丰富的固定收益市场投资研究经验，擅于自下而上跟踪市场获取信用风险溢价。</p> <p>段奕冰女士，东北林业大学管理学硕士。具有9年固定收益市场投资管理从业经历。历任龙江银行股份有限公司金融市场部交易员、投资经理。具有丰富的固定收益市场投资交易经验。</p>
--	--

4、对原合同第十九章“交易及交收清算安排”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
------	------

<p>6、为有效控制交易结算风险，投资者及管理人知悉并授权托管人向中国证券登记结算有限责任公司报送融资主体相关信息及用于交易资金前端控制的相关数据信息。托管人依据与管理人核对一致的信托财产估值信息向中国证券登记结算有限责任公司报送上述数据信息。托管人按照规则报送了资金前端控制额度后，管理人因超额度导致的交易失败所造成的损失由管理人承担。</p>	<p>(六) 为有效控制交易结算风险，投资者及管理人知悉并授权托管人向中国证券登记结算有限责任公司报送融资主体相关信息及用于交易资金前端控制的相关数据信息。托管人依据与管理人核对一致的资产管理计划财产估值信息向中国证券登记结算有限责任公司报送上述数据信息。</p> <p>自设额度为管理人自行申报的低于最高额度的额度，自设额度应低于最高额度。</p> <p>因资金前端控制业务规则而无法完成某笔或某些交易，由此造成的损益由集合计划财产承担。</p>
---	--

5、对原合同第二十一章“集合计划的费用与税收”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
<p>(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</p> <p>.....</p> <p>2、管理人的管理费</p> <p>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：</p> $H = E \times 0.5\% \div \text{当年实际天数}$	<p>(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</p> <p>.....</p> <p>2、管理人的管理费</p> <p>本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.4%年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.4\% \div \text{当年实际天数}$
<p>(三) 管理人的业绩报酬</p> <p>.....</p>	<p>(三) 管理人的业绩报酬</p> <p>.....</p>

<p>2、业绩报酬的计算方法及计提比例</p> <p>.....</p> <p>其中：</p> <p>1、I 为管理人应提的业绩报酬；</p> <p>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；</p> <p>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）；</p> <p>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【4%】。</p>	<p>2、业绩报酬的计算方法及计提比例</p> <p>.....</p> <p>其中：</p> <p>(1) I 为管理人应提的业绩报酬；</p> <p>(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；</p> <p>(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）；</p> <p>(4)r 为管理人业绩报酬计提的计提基准，具体以管理人在其指定网站发布销售公告、开放期公告或业绩报酬计提基准变更公告等公告为准。</p>
---	--

6、对原合同第二十四章“风险揭示”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>.....</p> <p>21、前端控制风险</p> <p>根据交易所、中登公司的相关规定，交易所、中登公司根据最高额度和自设额度对管理人的关联交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管</p>	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>.....</p> <p>21、前端控制风险</p> <p>根据交易所、中登公司的相关规定，交易所、中登公司根据最高额度和自设额度对管理人的关联交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管</p>

<p>理，并对管理人实施前端控制，其中，最高额度为按照交易所、中登公司对于最高额度的定义计算的额度，自设额度为管理人自行申报的低于最高额度的额度，自设额度应低于最高额度。如果本集合计划或管理人管理的其他资产管理计划下的某笔交易导致管理人关联交易单元全天净买入申报金额达到或超过自设额度的，交易所将拒绝接受该笔交易及该关联交易单元后续的竞价交易买入申报，本集合计划的相关投资交易将无法成功申报。尽管管理人可在规定时间内通过托管人向中登公司申请盘中紧急调整最高额度或自设额度，但调整能否成功取决于申请是否在规定时间内、中登公司及交易所是否同意等诸多因素，并且调整完成需要一段时间，仍然存在无法及时完成投资的风险。上述原因可能导致管理人无法完成投资，从而影响投资收益、给信托财产造成损失。因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的，交易所、中登公司可以采取调整额度、暂停实施资金前端控制、限制交易单元交易权限等处置措施。资金前端控制异常情况交易所、中登公司采取的相应措施可能影响管</p>	<p>理，并对管理人实施前端控制，其中，最高额度为按照交易所、中登公司对于最高额度的定义计算的额度，自设额度为管理人自行申报的低于最高额度的额度，自设额度应低于最高额度。</p> <p>(1) 如果本集合计划或管理人管理的其他资产管理计划下的某笔交易导致管理人关联交易单元全天净买入申报金额达到或超过自设额度的，交易所将拒绝接受该笔交易及该关联交易单元后续的竞价交易买入申报，本集合计划的相关投资交易将无法成功申报。尽管管理人可在规定时间内通过托管人向中登公司申请盘中紧急调整最高额度或自设额度，但调整能否成功取决于申请是否在规定时间内、中登公司及交易所是否同意等诸多因素，并且调整完成需要一段时间，仍然存在无法及时完成投资的风险。上述原因可能导致管理人无法完成投资，从而影响投资收益、给资产管理计划财产造成损失。</p> <p>(2) 因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的，交易所、中登公司可以采取调整额度、暂停实施资金前端控制、限制交易单元交易权限等处置措施。资金前端控制异常情况交易所、</p>
--	--

<p>理人的投资，影响信托财产的投资收益、给信托财产造成损失。</p>	<p>中登公司采取的相应措施可能影响管理人的投资，影响资产管理计划财产的投资收益、给资产管理计划财产造成损失。</p> <p>(3) 如因管理人、托管人操作失误，合计资产总额发生变动导致最高额度未能及时变更等，影响产品正常交易、无法有效进行风险控制等风险。</p>
-------------------------------------	--

以上变更内容《申港证券睿泽月添利 1 号集合资产管理计划说明书》、《申港证券睿泽月添利 1 号集合资产管理计划风险揭示书》所涉内容将同步进行变更。

以上事宜，请贵行确认。本函自管理人加盖公章或合同专用章并托管人盖章回执后生效。


 申港证券股份有限公司 (盖章)
 签署日期： 年 月 日

回 执

我行已知悉，并同意你司在《关于申港证券睿泽月添利1号集合资产管理计划资产管理合同变更的协商函（一）》中所提及的相关合同条款的变更。

上海银行股份有限公司（盖章）

签署日期：2024年7月11日



