

# 关于南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划资产管理合同、说明书变更及开放期的公告

尊敬的投资者：

南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2022 年 7 月 12 日成立，管理人为南京证券股份有限公司，托管人为南京银行股份有限公司，销售机构为南京证券股份有限公司、上海天天基金销售有限公司。本集合计划不分级，产品代码为 A73303，存续期 10 年，可展期。

根据《南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《合同》）的约定，为更好地服务投资者，经管理人、托管人双方书面协商一致，对《合同》及《南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划说明书》的部分内容进行变更，变更内容详见本公告附件 1：《南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划资产管理合同及说明书变更内容》。

按照《合同》约定，管理人现向投资者征询意见，投资者应当在 2024 年 9 月 2 日（含）前回复意见（详见附件 2：《南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划资产管理合同、说明书变更征询函》及其回函）。

管理人将 2024 年 9 月 2 日设立为本集合计划的临时开放期，根据《合同》约定，投资者不同意此次合同变更的，

应在 2024 年 9 月 2 日提出退出本集合计划的申请；投资者未在规定日期内回复意见的，视为投资者同意合同变更。未有意见回复且逾期未退出的以及回复不同意合同变更但逾期未退出的投资者，均视为同意本合同变更。

本次变更将于 2024 年 9 月 3 日生效，自生效日起本公告内容即成为《合同》的组成部分。

本集合计划将于 2024 年 9 月 3 日至 2024 年 9 月 5 日进入开放期，投资者可在开放期内提出参与及锁定期满的退出申请。

南京证券股份有限公司

2024 年 8 月 23 日



附件 1: 南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划  
资产管理合同及说明书变更内容

合同部分:

原合同条款	变更后条款
第四章 当事人及权利义务	
<p>第八条 托管人</p> <p>托管人名称: 南京银行股份有限公司 注册地址: 南京市中山路 288 号 法定代表人: 胡升荣</p>	<p>第八条 托管人</p> <p>托管人名称: 南京银行股份有限公司 注册地址: 南京市建邺区江山大街 88 号 法定代表人: 谢宁</p>

原合同条款	变更后条款
第八章 资产管理计划的参与、退出与转让	
<p>第二十二条 投资者参与和退出资产管理计划的有关事项</p> <p>(二) 参与和退出的开放期和时间</p> <p>2、本计划的开放期:</p> <p>本集合计划开放期为每个月第二周的周一、周二、周三(成立日当月不开放), 如遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法开放的则相应顺延。管理人有权根据情况调整开放期, 具体见届时管理人公告。</p>	<p>第二十二条 投资者参与和退出资产管理计划的有关事项</p> <p>(二) 参与和退出的开放期和时间</p> <p>2、本计划的开放期:</p> <p>本集合计划开放期为每个月第二周的周一、周二、周三、周四(成立日当月不开放), 如遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法开放的则相应顺延。管理人有权根据情况调整开放期, 具体见届时管理人公告。</p>

原合同条款	变更后条款
第十一章 资产管理计划的投资	
<p>第三十五条 投资限制</p> <p>4、本计划组合加权久期不超过 2 年(对于含权债券, 久期按行权计算);</p>	<p>第三十五条 投资限制</p> <p>删除第 4 条。</p>

原合同条款	变更后条款
第十八章 越权交易的界定	
<p>第四十九条</p> <p>(四) 托管人对管理人的投资监督</p> <p>2、对投资限制的监督</p> <p>(4) 本计划组合加权久期不超过 2 年(对于含权债券, 久期按行权计算);</p>	<p>第四十九条</p> <p>(四) 托管人对管理人的投资监督</p> <p>2、对投资限制的监督</p> <p>删除第(4)条。</p>

原合同条款	变更后条款
第十九章 资产管理计划财产的估值和会计核算	
<p>第五十条</p> <p>(三) 单位净值</p> <p>集合计划单位净值是指集合计划资产净值除以当日集合计划份额总数计算得到的</p>	<p>第五十条</p> <p>(三) 单位净值</p> <p>集合计划单位净值是指计算日集合计划资产净值总额除以计算日集合计划总份额后</p>



<p>每集合计划份额的价值。单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p>	<p>的价值。单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。管理人可以设立巨额退出情形下的净值精度应急调整机制，即管理人可视赎回情况在一定时间内临时提高本计划的份额净值精度，具体精确到 0.00000001 元，小数点后第九位四舍五入，届时管理人将不再另行公告。国家另有规定的，从其规定。</p>
<p>(七) 估值方法 1、固定收益类品种的估值方法 A、交易所市场交易的固定收益品种的估值 b 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，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；</p>	<p>(七) 估值方法 1、固定收益类品种的估值方法 A、交易所市场交易的固定收益品种的估值 b 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用第三方估值机构提供的价格数据，第三方估值机构采用中央国债登记结算公司（以下简称“中央结算公司”）。在第三方估值机构未提供估值价格的情况下，采用估值技术确定公允价值；</p>
<p>(七) 估值方法 1、固定收益类品种的估值方法 B、银行间市场交易的固定收益品种，选取中央国债登记结算有限责任公司提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。</p>	<p>(七) 估值方法 1、固定收益类品种的估值方法 B、银行间市场交易的固定收益品种，选取中央国债登记结算有限责任公司提供的相应品种当日的估值净价进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用估值技术确定公允价值。</p>
<p>(七) 估值方法 2、基金估值方法 A、在证券交易所交易、登记的上市流通封闭式基金、ETF 基金、场内登记的 LOF 基金等，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。在场外交易、登记的开放式基金（含场外登记的 LOF 基金）按前一日基金份额净值估值；如果估值日分红除权确认，则按前一日基金份额净值减单位分红额后的差额估值。估值日未公布前一日基金份额净值的，以最近公布的基金份额净值估值；在基金首次公布份额净值之前按照购入成本估值。</p>	<p>(七) 估值方法 2、基金估值方法 A、在证券交易所交易、登记的上市流通封闭式基金、ETF 基金、场内登记的 LOF 基金等，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。在场外交易、登记的开放式基金（含场外登记的 LOF 基金）按前一日基金份额净值估值；如果估值日分红除权确认，则按前一日基金份额净值减单位分红额后的差额估值。估值日未公布前一日基金份额净值的，以最近公布的基金份额净值估值；在基金首次公布份额净值之前按估值技术确认。</p>

原合同条款	变更后条款
-------	-------

第二十章 集合计划费用与税收	
<p>第五十三条 集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>(三) 业绩报酬计提基准及业绩报酬</p> <p>1、业绩报酬计提基准</p>	<p>第五十三条 集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>(三) 业绩报酬计提基准及业绩报酬</p> <p>1、业绩报酬计提基准</p> <p>增加以下内容：</p> <p>“投资者持有期间如本计划的业绩报酬计提基准或业绩报酬计提比例发生调整的，则每笔参与份额按照调整前后分段计算对应的年化收益率和业绩报酬，并将每段业绩报酬累加后作为每笔参与份额本次应提取的业绩报酬。业绩报酬计提分段计算起始日为业绩报酬计提基准或业绩报酬计提比例发生调整的生效日。”</p>

原合同条款	变更后条款
第二十一章 资产管理计划的收益分配	
<p>第五十九条 收益分配的执行方式</p> <p>本集合计划分红方式为现金分红。管理人将现金红利款划往销售机构账户，再由销售机构划入投资者账户，现金红利款自款项从集合计划托管账户划出之日起7个工作日内到达投资者账户，收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。投资者同意遵守登记结算机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制定的规则）。</p> <p>现金分红形成的集合计划分红金额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额计入集合计划资产的损益。</p>	<p>第五十九条 收益分配的执行方式</p> <p>本集合计划的收益分配方式为红利再投资。红利再投资形式的分红资金按分红除权日的本集合计划每份额净值（免收参与费用）转成本集合计划份额。集合计划份额计算要保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入本集合计划资产的损益。对红利再投资分红资金转为本集合计划的份额，在投资者申请退出时不受份额锁定期限制。</p> <p>如果分红转份额后使本集合计划在其存续期内资产规模接近或者超过存续期规模上限时，管理人将按照比例配售的方式对每个投资者分红转份额的数量进行确认，未转份额的部分按照现金形式进行分红。计算方法如下：</p> <p>单个投资者分红转份额的数量=本集合计划可以接受的新增转份额数量×单个投资者所持有的计划份额数量/要求分红转份额的投资者所持有的计划份额总数。</p>

说明书部分：

《南京证券神州鑫利6个月滚动持有期2号集合资产管理计划说明书》参照合同变更内容进行相应变更。

附件 2:

南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划

资产管理合同、说明书变更征询函

尊敬的投资者:

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》以及《南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称《合同》),为满足相关规定以及更好地服务投资者,经管理人、托管人双方书面协商一致,对《合同》及《南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划说明书》的部分内容进行变更,变更内容详见《关于南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划资产管理合同、说明书变更的公告》附件 1:《南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划资产管理合同及说明书变更内容》。

请投资者在 2024 年 9 月 2 日(含)前回复意见。(传真至 025-84552981 或发送邮件至 [njzqgx02@njzq.cn](mailto:njqzgx02@njzq.cn))

投资者不同意此次合同变更的,应在本 2024 年 9 月 2 日提出退出本集合计划的申请;投资者未在规定日期内回复意见的,视为投资者同意合同变更。未有意愿回复且逾期未退出的以及回复不同意合同变更但逾期未退出的投资者,均视为同意本合同变更。

于此开放期办理参与业务的投资者,管理人默认投资者已知悉本次变更的相关内容,并同意本次合同变更,管理人将依据变更生效后新合同进行资产管理业务。



《南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划  
资产管理合同、说明书变更征询函》的回函

管理人：

本人/本机构已知悉， 同意/ 不同意 你司在《南京证券神州鑫利 6 个月滚动持有期 2 号集合资产管理计划资产管理合同及说明书变更内容》中所提及的相关条款变更。

投资者（签字或盖章）：

2024 年 月 日

