

关于申港证券睿泽周享 2 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（一）

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“申港证券睿泽周享 2 号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）于 2024 年 3 月 8 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，经与托管人书面协商一致，拟变更部分合同条款。现根据《申港证券睿泽周享 2 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、若资产管理合同需要变更，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。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。

2、因监管规则变化，需要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。”



一、变更对照明细表

1、对原合同第十六章“集合计划的财产”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（五）投资定期存款的银行账户的开立和管理 集合计划财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，其预留印鉴经各方商议后预留。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户。”如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，托管人保管证实书正本或者复印件。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本集合计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。	（五）投资定期存款的银行账户的开立和管理 计划财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴应包含托管人指定印章。本着便于计划财产的安全保管和日常监督核查的原则，存款行应尽量选择托管人经办行所在地的分支机构。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下条款或意思表示：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管资金账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户。”如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，原则上由托管人保管证实书正本。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处

	理方法由管理人和托管人双方协商解决。
--	--------------------

2、对原合同第十九章“交易及清算交收安排”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（二）投资证券后的清算交收安排 1、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务： （1）托管人、管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本款规定的内容。管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定，并遵守托管人为履行特别结算参与人的义务所制定的业务规则与规定。 （2）托管人代理资产管理计划与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由托管人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于管理人原因造成托管人无法正常完成结算业务，托管人发现后应立即通知管理人，由管理人负责解决，由此造成托管人无法按时向中国证券登记公司支付证券清算款的责任以及由此给托管人所托管的其他财产造成的损失由管理人承担。 （3）管理人签署本合同/协议，即	（二）投资证券后的清算交收安排 1、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务： 托管人、管理人应共同遵守双方签署的《托管银行证券资金结算协议》及后续对该协议的补充更新内容。

视为同意管理人在构成资金交收违约且未能按时指定相关证券作为交收履约担保物时，托管人可自行向结算公司申请由结算公司协助冻结管理人证券账户内相应证券，无需管理人另行出具书面确认文件。

(4) 托管人遵照中登公司上海分公司和中登公司深圳分公司备付金、保证金管理办法有关规定，确定和调整该资产管理计划财产最低结算备付金、证券结算保证金限额，管理人应存放于中登公司的最低备付金、结算保证金日末余额不得低于托管人根据中登公司上海和深圳分公司备付金、保证金管理办法规定的限额。托管人根据中登公司上海和深圳分公司规定向资产管理计划财产支付利息。

(5) 根据中登公司托管人集中清算规则，如资产管理计划财产 T 日进行了中登公司深圳分公司 T+1DVP 卖出交易，管理人不能将该笔资金作为 T+1 日的可用头寸，即该笔资金在 T+1 日不可用也不可提，该笔资金在 T+2 日才能划拨至托管账户。

(6) 根据中国证券登记结算有限责任公司的规定，结算备付金账户内的最低备付金、交易保证金账户内的资金按月调整按季结息，因此，资产管理合同终止时，资产管理计划可能有尚存放

于结算公司的最低备付金、交易保证金以及结算公司尚未支付的利息等款项。对上述款项，托管人将于结算公司支付该等款项时扣除相应银行汇划费用后划付至资产管理计划清算报告中指定的收款账户。资产管理合同终止后，中登根据结算规则，调增计划的结算备付以及交易保证金，管理人应配合托管人，向托管人及时划付调增款项，以便托管人履行交收职责。 （7）管理人知晓并确认，管理人管理资产中用于融资回购的债券将作为托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若管理人债券回购交收违约，结算公司依法对质押券进行处置。管理人应就债券回购交收违约后结算公司对质押券的处置以及投资者或受托人所应承担的委托债券投资风险，预先书面告知投资者或受托人，并由投资者或受托人签字确认。	
---	--

3、对原合同第十九章“交易及清算交收安排”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（五）投资银行存款的特别约定 1、本集合计划投资银行存款前，应与存款银行签署投资银行定期存款协议。 2、本集合计划投资银行存款，必	（五）投资银行存款的特别约定 1、本集合计划投资银行存款前，应与存款银行签署投资银行定期存款协议。 2、本集合计划投资银行存款，必

须采用管理人和托管人认可的方式办理。 3、管理人投资银行存款或办理存款支取时，应提前书面通知托管人，以便托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。	须采用管理人和托管人认可的方式办理。 3、管理人投资银行存款或办理存款支取时，应提前书面通知托管人，以便托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。 4、因投资需要在托管银行以外的其他银行开立活期账户进行存款投资的，管理人、托管人和存款行需在投资前另行签署三方协议。
---	---

4、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：
(二) 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	(二) 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) 投资者分多笔参与本集合计划的，按投资者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，并以收益分配金额为上限；

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

(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。

(6) 如投资者在持有本集合计划份额期间存在多个业绩报酬计提基准周期的，则管理人以每个业绩报酬计提基准周期各自对应的年化收益率计算业绩报酬金额，并按照实际值累加计算，作为管理人可实际计提的业绩报酬金额。

业绩报酬计提基准周期：①每笔份额上一个业绩报酬计提日（如不存在，则为份额确认日）至第 1 个业绩报酬计提基准变更生效日；②第 1 个业绩报酬计提基准变更生效日至第 2 个业绩报酬计提基准变更生效日；③第 2 个业绩报酬计提基准变更生效日至第 n 个业绩报酬计提基准变更生效日；④第 n 个业绩报酬计提基准变更生效日至下一个业绩报酬计提日（终止清算时，业绩报酬计提日为集合计划清算日），依此类推。

2、业绩报酬的计算方法及计提比

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，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。

管理人有权根据市场情况及集合

例

在业绩报酬计提日，管理人计算每一个业绩报酬计提基准周期的年化收益率 R ，并针对 R 减去对应业绩报酬计提基准周期的计提基准 (r) 的结果按照 50% 的比例计算该周期的业绩报酬。投资者该笔参与份额在每个业绩报酬计提基准周期内的业绩报酬金额进行累加计算，作为管理人可实际计提的业绩报酬，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。如投资者该笔参与份额在全部的业绩报酬计提基准周期内经累加后的业绩报酬金额小于或等于 0 的，则不收取该投资者该笔份额业绩报酬。

每一个业绩报酬计提基准周期内的年化收益率的计算公式如下：

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

R 为期间年化收益率。

P_1^* 为投资者每个业绩报酬计提基准周期期末日前一日的累计净值。

P_0^* 为投资者每个业绩报酬计提基准周期期初日前一日的累计净值。

P_0 投资者每个业绩报酬计提基准周期期初日前一日的单位净值。

D 为每个业绩报酬计提基准周期期初日到期末日的年限(终止清算计提业

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，业绩报酬的计算由管理人完成。

绩报酬时，D为每个业绩报酬计提基准周期期初日到集合计划终止日的年限）。

每一个业绩报酬计提基准周期的管理人业绩报酬计算公式如下：

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

其中：

I为单笔份额对应的单个业绩报酬计提基准周期内的管理人业绩报酬；

A为投资者每个业绩报酬计提基准周期的期初日的资产净值总额；

D为每个业绩报酬计提基准周期期初日到期末日的年限（清盘计提业绩报酬时，D为业绩报酬计提基准周期期初日到集合计划终止日的年限）；

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。

将该笔份额持有期内不同业绩报酬计提基准周期内的管理人业绩报酬加总，得到该笔份额的管理人可实际计提的业绩报酬（ $\sum I$ ）：

	$\Sigma I = \text{MAX}(I_1 + I_2 + I_3 + \dots + I_n, 0)$ 其中的n为每笔份额所对应的不同业绩报酬计提基准周期的数量。 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，业绩报酬的计算由管理人完成。
--	--

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：

1、本次合同变更期间（即征询期间）为：自合同变更相关安排的公告发布之日起到2024年11月4日（含）止。

2、投资者不同意本次合同变更的，应当在管理人指定的期限内申请退出其持有的全部本集合计划份额，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。

3、投资者在管理人指定的期限内未申请退出其持有的全部本集合计划份额的，视为投资者同意本次合同变更。

本次合同变更自管理人公告中指定的资产管理合同变更生效日起生效，否则将另行通知，对合同各方均具有法律效力。

感谢您的支持与配合！如有疑问，可咨询中港证券股份有限公司。



