

关于申港证券睿泽双季盈 5 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（二）

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“申港证券睿泽双季盈 5 号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）于 2023 年 5 月 12 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《申港证券睿泽双季盈 5 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、由于其他原因需要变更资产管理合同的，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。投资者应在征询期间内给出书面或其他约定方式的答复。投资者不同意变更的，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；投资者答复不同意变更且在管理人指定的期限未退出的，管理人有权在指定的期限交易时间届满后将相关份额强制退出本集合计划；征询期限届满未有意见答复且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。若前述指定期限与本集合计划开放期重合，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>集合计划资产、集合计划财产或集合计划资产：指依据有关法律法规和资产管理合同，投资者参与本集合计划的资产净额</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> <p>集合计划资产、集合计划财产或资产管理计划财产：指依据有关法律法规和资产管理合同，投资者参与本集合计划的资产净额</p>

2、对原合同第五章“集合计划的基本情况”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
<p>(十) 预警止损安排</p> <p>根据本集合计划投资策略、潜在的收益波动水平、可能出现的最大回撤幅度等，本集合计划以集合计划单位净值为基础设置预警线及止损线。</p> <p>1、本集合计划的预警安排</p> <p>本集合计划的预警线为【0.9500元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T日）日终，本集合计划单位净值等于或低于预警线的，管理人应在计算出该净值并与托管人核对一致后的一个工作日内进行信息披露。</p>	<p>(十) 预警止损安排</p> <p>根据本集合计划投资策略、潜在的收益波动水平、可能出现的最大回撤幅度等，本集合计划以集合计划单位净值为基础设置预警线及止损线。</p> <p>1、本集合计划的预警安排</p> <p>本集合计划的预警线为【0.9500元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T日）日终，本集合计划单位净值等于或低于预警线，同时当且仅当T-1日本集合计划单位净值高于预警线的情况下，管理人将于T+1日内以管理</p>

<p>2、本集合计划的止损安排</p> <p>本集合计划的止损线为【0.9200元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T日）日终，本集合计划单位净值等于或低于止损线的，本集合计划终止，按照资产管理合同的约定组织清算集合计划资产。</p> <p>托管人根据与管理人的估值核对结果对预警、止损事项进行事后监督，托管人如若发现经核对的单位净值等于或低于预警线或止损线的，应当及时向管理人予以提示。</p>	<p>人网站公告、邮件、短信或者其他管理人和投资者认可的方式进行信息披露，持续等于或低于预警线管理人将不再另行披露。</p> <p>特别示例如下：</p> <p>假设本集合计划2024年8月14日单位净值高于预警线，2024年8月15日单位净值低于预警线，管理人将于2024年8月16日向投资者披露，若该情况持续至2024年8月22日，期间持续低于预警线的情况管理人不再另行披露；若后续运作期间单位净值再次升高回落至预警线，管理人将于T+1日内进行信息披露，持续等于或低于预警线期间不再另行披露，如此往复。特别提醒投资者在集合计划单位净值等于或低于预警线的情况下及时关注单位净值的波动。</p>
	<p>2、本集合计划的止损安排</p> <p>本集合计划的止损线为【0.9200元】。在本集合计划存续期内任何一个交易日（T日）日终，本集合计划单位净值等于或低于止损线的，T+1日本集合计划终止，按照资产管理合同的约定组织清算集合计划资产。</p> <p>托管人根据与管理人的估值核对结果对预警、止损事项进行事后监督，托管人如若发现经核对的单位净值触及上述第1、2条所述情况的，应当及</p>

	时向管理人予以提示。
--	------------

3、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>(二) 参与和退出的开放日和时间</p> <p>2、开放期</p> <p>(1) 开放频率</p> <p>本集合计划开放频率为每年5月、11月的8日起连续开放5个工作日(遇节假日顺延)，开放期内投资者可办理参与和退出业务。</p> <p>(2) 开放时限</p> <p>本集合计划每个开放期不超过5个工作日，如发生不可抗力或者其他情形(节假日除外)致使本集合计划无法按时开放参与和/或退出业务，或依据资产管理合同需暂停参与和/或退出业务的，开放期顺延至前述情形消除之日的下一个工作日。管理人可以根据实际情况延长或提前结束开放期。</p> <p>(3) 通知方式</p> <p>管理人于每个开放期前至少1个工作日在指定网站发布具体开放期安排的公告。若中国证监会会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易场所交易时间变更或发生其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放期及开放时间进行相应的调整并告知投资者。管理</p>	<p>(二) 参与和退出的开放日和时间</p> <p>2、开放期</p> <p>(1) 开放频率</p> <p>本集合计划开放频率为每年5月、11月的8日起连续开放5个工作日(遇节假日顺延)，开放期内投资者可办理参与和退出业务；每年5月、11月的23日起连续开放3个工作日(遇节假日顺延)，开放期内投资者仅可办理参与业务。</p> <p>(2) 开放时限</p> <p>本集合计划每年5月、11月的8日起连续开放不超过5个工作日，每年5月、11月的23日起连续开放不超过3个工作日，如发生不可抗力或者其他情形(节假日除外)致使本集合计划无法按时开放参与和/或退出业务，或依据资产管理合同需暂停参与和/或退出业务的，开放期顺延至前述情形消除之日的下一个工作日。管理人可以根据实际情况延长或提前结束开放期。</p> <p>(3) 通知方式</p> <p>管理人于首个或变更生效后首个开放期前至少1个工作日在指定网站发</p>

<p>人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。</p>	<p>布具体开放期安排的公告。若中国证监会会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易场所交易时间变更或发生其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放期及开放时间进行相应的调整并告知投资者。管理人在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。</p>
<p>(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>.....</p> <p>2、参与和退出的程序和确认</p> <p>(1) 投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足用于参与的货币资金；若交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请。</p> <p>(2) 投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销。</p> <p>(3) 投资者参与本集合计划，必须足额交款，销售机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到参与申请。投资者于T日提交参与申请后，可于T+2日后到销售网点或以销售机构规定的其他方式查询参与确认情况。确认无效的参与申请，销售机构将退还投资者已交付的参与款项本金，如该投资者为首次参与，就该投资者而言，其签署的资产管理合同自始未生效。</p> <p>(4) 当集合计划规模接近或达到</p>	<p>(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>.....</p> <p>2、参与和退出的程序和确认</p> <p>(1) 除本合同另有约定外，投资者仅可在开放期内提出参与或退出申请。</p> <p>(2) 投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足用于参与的货币资金；若交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请。</p> <p>(3) 投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销。</p> <p>(4) 投资者参与本集合计划，必须足额交款，销售机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到参与申请。投资者于T日提交参与申请后，可于T+2日后到销售网点或以销售机构规定的其他方式查询参与确认情况。确认无效的参与申请，销售机构将退还投资者已交付的参与款项本金，如该投资者为首次参</p>

约定的规模上限（如有）、投资者数量达到上限（200人），或管理人认为有必要时，管理人有权暂停接受参与申请。如果T日参与申请的份额加上已有的参与份额已经超过规模上限（如有）或导致本集合计划投资者数量超过上限（200人），则T+1日对T日参与申请的份额按照“时间优先，金额优先”原则进行确认，根据时间先后顺序对参与资金进行确认，若出现参与时间相同的参与申请，则根据金额由大到小的顺序进行确认，以保证不超过规模上限（如有）和投资者数量上限（200人）。

（5）投资者在提交退出申请时，其在销售机构必须有足够可用的集合计划份额余额，超出余额部分的退出申请将不予成交，仅受理账户实际持有份额的退出申请。销售机构对退出申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到退出申请。销售机构在T日规定时间受理的投资者退出申请，投资者在T+2日后可向销售机构查询退出的成交情况。

（6）若投资者的退出申请确认成功，管理人应指示托管人于T+5日内将退出款项从集合计划托管账户划出。若遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非管理人及托管人所

与，就该投资者而言，其签署的资产管理合同自始未生效。

（5）当集合计划规模接近或达到约定的规模上限（如有）、投资者数量达到上限（200人），或管理人认为有必要时，管理人有权暂停接受参与申请。如果T日参与申请的份额加上已有的参与份额已经超过规模上限（如有）或导致本集合计划投资者数量超过上限（200人），则T+1日对T日参与申请的份额按照“时间优先，金额优先”原则进行确认，根据时间先后顺序对参与资金进行确认，若出现参与时间相同的参与申请，则根据金额由大到小的顺序进行确认，以保证不超过规模上限（如有）和投资者数量上限（200人）。

（6）投资者在提交退出申请时，其在销售机构必须有足够可用的集合计划份额余额，超出余额部分的退出申请将不予成交，仅受理账户实际持有份额的退出申请。销售机构对退出申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到退出申请。销售机构在T日规定时间受理的投资者退出申请，投资者在T+2日后可向销售机构查询退出的成交情况。

（7）若投资者的退出申请确认成功，管理人应指示托管人于T+5日内将退出款项从集合计划托管账户划出。若

<p>能控制的因素影响业务处理流程时，退出款项顺延至上述情况消除后的下一个工作日划出。由于投资者原因造成退出款项和收益不能及时划入交易账户及由此造成的损失，由投资者承担。发生巨额退出情况时，按资产管理合同相关规定处理。</p>	<p>遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，退出款项顺延至上述情况消除后的下一个工作日划出。由于投资者原因造成退出款项和收益不能及时划入交易账户及由此造成的损失，由投资者承担。发生巨额退出情况时，按资产管理合同相关规定处理。</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 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，其主动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（30 万元）。投资者主动退出</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，</p>

<p>后持有的集合计划份额净值低于约定的最低持有金额时，需要退出集合计划的，应当一次性全部退出。否则，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>其主动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）。投资者主动退出后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。否则，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>(七) 参与份额和退出金额的计算方式</p> <p>1、参与份额的计算方式</p> <p><u>净参与金额=参与金额/（1+参与费率）</u></p> <p><u>参与费用=参与金额-净参与金额</u></p> <p><u>参与份额=净参与金额÷实际参与申请日集合计划份额净值</u></p> <p>参与份额的计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。</p> <p>2、退出金额的计算方式</p> <p><u>退出费用=退出份额×实际退出申请日集合计划份额净值×退出费率</u></p> <p><u>退出金额=退出份额×实际退出申请日集合计划份额净值-退出费用-业绩报酬（如有）</u></p>	<p>(七) 参与份额和退出金额的计算方式</p> <p>1、参与份额的计算方式</p> <p><u>净参与金额=参与金额/（1+参与费率）</u></p> <p><u>参与费用=参与金额-净参与金额</u></p> <p><u>参与份额=净参与金额÷参与申请日集合计划份额净值</u></p> <p>参与份额的计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔参与时，按上述公式进行逐笔计算。</p> <p>2、退出金额的计算方式</p> <p><u>退出费用=退出份额×退出申请日集合计划份额净值×退出费率</u></p> <p><u>退出金额=退出份额×退出申请日集合计划份额净值-退出费用-业绩报酬（如有）</u></p>

<p>退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。</p> <p>违约退出情形下的退出金额的计算方式由资产管理合同另行约定。</p>	<p>退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。</p>
<p>(九) 巨额退出的认定及处理方式</p> <p>5、管理人可根据市场变化或集合计划运作情况对巨额退出或者连续巨额退出的认定标准进行调整。管理人应当提前1个工作日在指定网站公告调整方案。调整方案经过管理人指定网站公告后即生效，无需就该调整方案征求投资者意见。</p>	<p>(九) 巨额退出的认定及处理方式</p> <p>5、管理人可根据市场变化或集合计划运作情况对巨额退出或者连续巨额退出的认定标准进行调整。管理人应当提前1个工作日在指定网站公告调整方案，履行告知投资者义务，调整方案生效时间以管理人指定网站公告为准。</p>
<p>(十二) 违约退出</p> <p>1、违约退出情形</p> <p>违约退出适用于投资者身患重疾、突发意外等急需使用资金的情形。申请违约退出的投资者需提供情形说明及相关佐证材料，如投资者提供的说明及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，管理人有权拒绝办理投资者的违约退出申请。</p> <p>2、违约退出的费用及违约退出金额的计算方式</p> <p>(1) 违约退出费率为：0.05%。</p> <p>(2) 违约退出金额的计算方式</p>	<p>(十二) 违约退出</p> <p>1、违约退出情形</p> <p>违约退出适用于投资者身患重疾、突发意外等急需使用资金的情形。申请违约退出的投资者需提供情形说明及相关佐证材料，如投资者提供的说明及材料不真实、不准确或不完整，存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，管理人有权拒绝办理投资者的违约退出申请。</p> <p>2、违约退出的费用及违约退出金额的计算方式</p> <p>(1) 违约退出费率为：0.05%。</p> <p>(2) 违约退出金额的计算方式</p>

<p>违约退出费用=（违约退出份额×实际违约退出申请日集合计划份额净值-退出费（如有）-业绩报酬（如有））×违约退出费率</p> <p>违约退出金额=违约退出份额×实际违约退出申请日集合计划份额净值-违约退出费用-退出费（如有）-业绩报酬（如有）</p> <p>违约退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔违约退出时，按上述公式进行逐笔计算。</p> <p>违约退出费用全额归入集合计划财产。</p>	<p>违约退出费用=（违约退出份额×违约退出申请日集合计划份额净值-退出费（如有）-业绩报酬（如有））×违约退出费率</p> <p>违约退出金额=违约退出份额×违约退出申请日集合计划份额净值-违约退出费用-退出费（如有）-业绩报酬（如有）</p> <p>违约退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔违约退出时，按上述公式进行逐笔计算。</p> <p>违约退出费用全额归入集合计划财产。</p>
<p>（十五）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划</p> <p>.....</p> <p>2、自有资金参与的方式和金额</p> <p>在本集合计划初始募集期和存续期内，证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与本集合计划，参与金额不得低于本集合计划初始募集期最低参与金额限制（不含参与费用）。</p> <p>3、自有资金参与和退出</p> <p>证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该集合计划总份额的50%。管理人以自有资金参与本集合计划的份额不</p>	<p>（十五）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划</p> <p>.....</p> <p>2、自有资金参与的方式和金额</p> <p>在本集合计划初始募集期和存续期内，证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金认购或参与本集合计划，认购、参与金额不得低于本集合计划最低认购金额（不含认购费用）、最低参与金额限制（不含参与费用）。</p> <p>3、自有资金参与和退出</p> <p>证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划的份额不得超过该集合计划总份额的50%。中国证</p>

得超过该集合计划总份额的 20%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。	监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。
--	--------------------------------

4、对原合同第十一章“集合计划的投资”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
<p>(五) 投资策略</p> <p>.....</p> <p>3、投资管理的方法和标准</p> <p>.....</p> <p>(4) 进行投资组合管理</p> <p>投资经理对投资组合进行密切的日间监控及流动性影响分析，提出流动性优化方案；在授权范围内，根据各投资品种的资产配置比例，确定具体的投资品种、数量、价位、策略等，构建、优化和调整投资组合，进行投资组合的日常管理以及完善和加强交易对手管理。</p>	<p>(五) 投资策略</p> <p>.....</p> <p>3、投资管理的方法和标准</p> <p>.....</p> <p>(4) 进行投资组合管理</p> <p>投资经理对投资组合进行密切的日间监控及流动性管理；在授权范围内，根据各投资品种的资产配置比例，确定具体的投资品种、数量、价位、策略等，构建、优化和调整投资组合，进行投资组合的日常管理。</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>(三) 管理人的业绩报酬</p> <p>1、业绩报酬的计提原则及提取频率</p> <p>(1) 本集合计划将在两种情况下计提业绩报酬：</p> <p>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；</p>	<p>(三) 管理人的业绩报酬</p> <p>1、业绩报酬的计提原则及提取频率</p> <p>(1) 本集合计划将在两种情况下计提业绩报酬：</p> <p>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；</p>

<p>(2) 按份额持有人每笔参与份额分别计提业绩报酬；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p> <p>2、业绩报酬的计算方法及计提比例</p> <p>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 60% 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。</p> <p>年化收益率的计算公式如下：</p>	<p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>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</p>
--	--

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

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
$R > r$	60%	$I = [(R - r) \times 60\%] \times A \times D$

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

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 60% 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

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，约定为【4.4%】。

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，业绩报酬的计算工作由管理人完成，托管人根据管理人指令进行划款。

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)
$R \leq r$	60%	$I = [(R - r) \times 60\%] \times A \times D$
$R > r$	60%	$I = [(R - r) \times 60\%] \times A \times D$

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

	<p>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> <p>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（ΣI）：</p> $\Sigma I = \text{MAX}(I_1 + I_2 + I_3 + \dots + I_n, 0)$ <p>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。</p> <p>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。</p> <p>因业绩报酬计算涉及注册登记数据，业绩报酬的计算工作由管理人完成，托管人根据管理人指令进行划款。</p>
--	--

6、对原合同第二十三章“信息披露与报告”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
------	------

<p>(二) 临时报告</p> <p>集合计划存续期间,发生资产管理合同约定或可能对集合计划持续运行、投资者利益、集合计划资产净值产生重大影响的事项,管理人应当在事项发生之日起5日内以指定网站公告方式向投资者披露,并按照相关规定及时报告。临时报告的情形包括但不限于:</p> <p>.....</p> <p>4、集合计划T日收市后单位净值小于等于集合计划预警线(管理人应在计算出该净值并与托管人核对一致后的一个工作日内进行披露预警);</p>	<p>(二) 临时报告</p> <p>集合计划存续期间,发生资产管理合同约定或可能对集合计划持续运行、投资者利益、集合计划资产净值产生重大影响的事项,管理人应当在事项发生之日起5日内以指定网站公告方式向投资者披露(除第4条情形外),并按照相关规定及时报告。临时报告的情形包括但不限于:</p> <p>.....</p> <p>4、集合计划存续期内任何一个交易日(T日)日终,集合计划单位净值等于或低于预警线,同时当且仅当T-1日本集合计划单位净值高于预警线(管理人将于T+1日内以管理人网站公告、邮件、短信或者其他管理人和投资者认可的方式进行信息披露,持续等于或低于预警线管理人将不再另行披露);</p>
---	--

7、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>7、投资标的风险</p> <p>.....</p> <p>(2) 非公开发行公司债及非公开定向债务融资工具(PPN)的投资风险</p> <p>非公开发行公司债及PPN相较于普通债券具有“相对更高收益”、“相对更高信用风险”、“相对更低流动性”</p>	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>.....</p> <p>7、投资标的风险</p> <p>.....</p> <p>(2) 非公开发行公司债及非公开定向债务融资工具(PPN)的投资风险</p> <p>非公开发行公司债及PPN相较于普通债券具有“相对更高收益”、“相对更高信用风险”、“相对更低流动性”</p>

<p>等特征，投资非公开发行公司债及 PPN 的风险主要体现在以下两个方面：</p> <p>①信用风险</p> <p>非公开发行公司债及 PPN 的发行门槛要低于普通债券。以非公开发行公司债为例，对发行人净资产和盈利能力等没有硬性要求，由承销商对发行人的偿债能力和资金用途进行把握；非公开发行公司债的各种要素，诸如发行金额、利率、期限等，均由发行人、承销商和投资者自行协商确定，约定各方权利义务关系。</p> <p>相较普通债券，非公开发行公司的信用等级较低，违约率高于较高信用等级的债券，具有一定的信用风险。</p> <p>②流动性风险</p>	<p>等特征，投资非公开发行公司债及 PPN 的风险主要体现在以下两个方面：</p> <p>①信用风险</p> <p>非公开发行公司债及 PPN 的发行门槛要低于普通债券。以非公开发行公司债为例，对发行人净资产和盈利能力等没有硬性要求，由承销商对发行人的偿债能力和资金用途进行把握；非公开发行公司债的各种要素，诸如发行金额、利率、期限等，均由发行人、承销商和投资者自行协商确定，约定各方权利义务关系。</p> <p>相较普通债券，非公开发行公司债及 PPN 的信用等级较低，违约率高于较高信用等级的债券，具有一定的信用风险。</p> <p>②流动性风险</p>
<p>非公开发行公司债对于投资者适当性管理要求较高，对于持有人数设置上限，在债券到期之前只能在有限的投资者之间进行转让。在上述要求下，非公开发行公司债具有一定的流动性风险。</p>	<p>非公开发行公司债及 PPN 对于投资者适当性管理要求较高，对于持有人数设置上限，在债券到期之前只能在有限的投资者之间进行转让。在上述要求下，非公开发行公司债及 PPN 具有一定的流动性风险。</p>

8、对原合同第二十八章“资产管理合同的效力”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
<p>（一）资产管理合同签署的方式</p> <p>资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函、网站公告征求意见等形式对本合同的有效修订和</p>	<p>（一）资产管理合同签署的方式</p> <p>资产管理合同（包含以签署补充协议、发送变更征求意见函、网站公告征求意见等形式对本合同的有效修订和</p>

补充)可采用电子或纸质方式签订,中国证券投资基金业协会另有规定的从其规定。管理人、托管人作为资产管理合同签署方,已接受资产管理合同项下的全部条款。投资者作为资产管理合同一方,以纸质版合同签名或电子方式签署资产管理合同即表明投资者完全接受资产管理合同项下的全部条款。采用电子方式时,投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定。三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起,投资者以电子方式签订资产管理合同、风险揭示书或其他文书的,视为签署资产管理合同、风险揭示书或其他文书,与在纸质资产管理合同、纸质风险揭示书或其他纸质文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力,无须另行签署纸质资产管理合同、纸质风险揭示书或其他纸质文书。

补充)可采用电子或纸质方式签订,中国证券投资基金业协会另有规定的从其规定。管理人、托管人作为资产管理合同签署方,已接受资产管理合同项下的全部条款。投资者作为资产管理合同一方,以纸质版合同签名或电子方式签署资产管理合同即表明投资者完全接受资产管理合同项下的全部条款。采用电子方式时,投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定。三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起,投资者以电子方式签订资产管理合同(包含以签署补充协议、发送变更征求意见函等形式对本合同的有效修订和补充)、风险揭示书或其他文书的,视为签署资产管理合同(包含以签署补充协议、发送变更征求意见函等形式对本合同的有效修订和补充)、风险揭示书或其他文书,与在纸质资产管理合同、纸质风险揭示书或其他纸质文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力,无须另行签署纸质资产管理合同、纸质风险揭示书或其他纸质文书。

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:

自合同变更相关安排的公告发布之日起,请投资者至我司或自行打印或通过

销售机构指定的销售渠道以电子或纸质签署等有效途径填写《申港证券睿泽双季盈5号集合资产管理计划合同变更征询的回函》（以下简称“回函”）并务必于2024年11月7日（含）前将回函意见通过邮寄、电子签章等方式告知管理人。同时，对于本次回函，做如下说明：

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7日（含）止，投资者回函必须在上述时间内完成。

2、若投资者回函意见为“同意”，即视为同意合同变更相关内容，若投资者的回函意见与其退出申请不一致，则以退出申请为准。

3、若投资者回函意见为“不同意”，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；投资者回函意见为“不同意”但未申请退出其持有的全部本集合计划份额的，管理人将在指定的期限交易时间届满后（即2024年 月 日）将其持有的全部本集合计划份额强制一次性退出。

4、若投资者未在征询期间回复意见且未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的，视为同意本次合同变更。

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，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，可咨询申港证券股份有限公司。

邮寄回函地址：

地址：上海浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦19楼

联系人：雷伯特

联系电话：021-20639470



SHENGGANG SECURITIES CO., LTD.

申港证券睿泽双季盈 5 号集合资产管理计划

合同变更征询的回函

请投资者根据《关于申港证券睿泽双季盈 5 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（二）》作出意见表示：同意合同变更之投资者，请于“同意”栏填写“同意”并签字或盖章；不同意合同变更之投资者，请于“不同意”栏填写“不同意”并签字或盖章。

申港证券睿泽双季盈5号集合资产管理计划合同变更征询的回函	
意见	投资者反馈
同意	
不同意	
签字或盖章： 年 月 日	