

关于南京证券神州鑫利2号集合资产管理计划 资产管理合同、说明书变更的公告

尊敬的投资者：

南京证券神州鑫利2号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于2022年5月17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和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A73302，存续期10年，可展期。

根据《南京证券神州鑫利2号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《合同》），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2号集合资产管理计划资产管理合同及说明书变更对照表》。

按照《合同》约定，管理人现向投资者征询意见，投资者应当在2025年5月12日（含）前回复意见（详见附件2：《南京证券神州鑫利2号集合资产管理计划资产管理合同、说明书变更征询函》）。

本集合计划将进入开放期，根据《合同》约定，投资者不同意此次合同变更的，应在2025年5月12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 2025 年 5 月 13 日生效，自生效日起本公告内容即成为《合同》的组成部分。

南京证券股份有限公司

2025 年 4 月 25 日

附件 1：南京证券神州鑫利 2 号集合资产管理计划资产管理合同及说明书变更对照表

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	
第八条托管人 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	第八条托管人 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

原合同条款	变更后条款
第十一章 资产管理计划的投资	
第三十一条 资产管理计划投资比例超限的处理方式 非因主观因素导致突破前述比例限制的，应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整至符合要求，相关法律法规规定的特殊情形除外。	第三十一条 资产管理计划投资比例超限的处理方式 非因主观因素导致突破前述比例限制的，应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合要求，相关法律法规规定的特殊情形除外。
第三十五条 投资限制 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）；	第三十五条 投资限制 删除第 4 条。
第三十五条 投资限制 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管理人之外的因素致使本计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同的有关规定的，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 个交易日内调整至符合相关要求。	第三十五条 投资限制 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管理人之外的因素致使本计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同的有关规定的，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 个交易日内调整至符合相关要求。

原合同条款	变更后条款
第十四章 利益冲突及关联交易	
第四十二条 利益冲突情形 本集合资产管理计划存在的或可能存在利益冲突情形，包括但不限于： （一）管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者	第四十二条 关联方、关联交易及划分标准 1.关联方按照《企业会计准则》的规定确定，本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。管理人、托管人

承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易； （二）管理人董事、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参与管理人设立的资产管理计划； （三）管理人自有资金参与和退出本计划； （四）法律、行政法规规定或中国证监会认定的其他情形。 第四十三条 利益冲突的处理 委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、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发行的证券或承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易，管理人在交易完成后 5 个工作日内以公告的形式及时、全面、客观地告知投资者和托管人，并按照现行法律法规、自律规则向监管机构及自律组织报告。 第四十四条 若管理人董事、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参与管理人设立的资产管理计划；管理人应当向投资者进行披露，对该计划账户进行监控，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告（如需），投资于证券期货的关联交易还应当当向证券期货交易所报告。	关联方名单以上市公司公告为准。 2.关联交易是指运用资产管理计划财产与资产管理计划关联方之间发生的交易，包括以下情形： （1）资产管理计划通过资产管理计划关联方交易单元进行证券和衍生品交易； （2）资产管理计划投资于资产管理计划关联方的银行存款、同业存单； （3）资产管理计划与资产管理计划关联方作为交易对手进行银行间债券市场的债券（含回购）交易、交易所大宗交易、固定收益交易平台等议价交易； （4）资产管理计划进行回购交易的质押券为资产管理计划关联方发行的债券； （5）资产管理计划投资资产管理计划关联方发行的理财产品或资产管理产品； （6）资产管理计划投资资产管理计划关联方发行的证券或者承销期内承销的证券； （7）法律法规、监管机构规定的其他情形。 3.管理人根据对受托资产或投资者利益的影响程度，将关联交易分为重大关联交易及一般关联交易。 重大关联交易包括：（1）管理人将本计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；（2）管理人将本计划的资产与关联方发生单笔投资或交易事项的金额达到 2000 万元人民币并超过本计划资产净值的 20%；（3）从事其他对资产管理计划或投资者利益有重大影响的关联交易。 一般关联交易包括：（1）资产管理计划通过资产管理计划关联方交易单元进行证券和衍生品交易；（2）资产管理计划投资于资产管理计划关联方的银行存款；（3）除重大关联交易以外的其他关联交易。 法律法规、中国证监会或证券投资基金业协会对关联交易认定以及重大/一般关联交易分类标准另有规定的，本计划从其规定。
--	--

第四十三条 利益冲突的处理方式

管理人建立健全内部控制和风险合规管理制度，采取有效措施，做好充分的信息隔离和利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范、管控可能的利益冲突。从事关联交易应当符合合同约定的投资目标及投资策略，管理人根据系统或人工的方式对每笔投资进行事前监控和审批，判断其是否属于本合同约定的一般关联交易或重大关联交易。根据法律法规、公司内控制度等要求，本计划从事关联交易需向管理人的投资决策委员会提交审议，拟从事重大关联交易的，投资经理需就关联交易决策的缘由和交易价格合理性以及是否存在利益输送等相关情况进行说明，审批通过后方可开展投资。管理人的投资决策委员会可根据关联交易的重要程度进行投资授权，投资经理可在授权范围内开展投资活动。

第四十四条 利益冲突的披露方式、披露内容以及披露频率

1.投资者在此同意并授权管理人可以从事一般关联交易。若涉及前述一般关联交易情形的，管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，事后在管理人网站通过临时报告或定期报告等形式告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

2.管理人从事重大关联交易的，通过管理人网站公告、电子邮件（联系邮箱为：njzqzgxp02@njzq.cn，前述邮箱如有变更，管理人将选择通过管理人网站公告、电子邮件、电话或短信等任意方式告知投资者，无需履行合同变更）、电话或短信等任意方式向全体投资者征询意见。若投资者不同意该笔重大关联交易的，应当按照管理人征询通知中要求的方式以及限定期限内及时向管理人明确反馈不同意的意见。如果投资者未按照管理人征询通知中要求的方式或限定的时限内进行反馈，或在反馈中意见表示不明确的，则均视为投资者同意管理人进行该笔重大关

	联交易。在获得全体投资者同意后，管理人可以从事该笔重大关联交易，管理人应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，在交易完成后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。
--	---

原合同条款	变更后条款
第十七章 投资指令的发送、确认和执行	
第四十八条 （三）指令的发送、确认和执行程序 2、对投资限制的监督 管理人以传真、电子邮件方式或托管人和管理人确认的其他方式发送指令。集合计划托管人传真号为：【021-54662130】；集合计划托管人的电子邮箱为：【njtg@njcbtg.com】；集合计划管理人的传真号为：025-84552965、025-84552981，集合计划管理人的电子邮箱为liuchenwei@njzq.cn。	第四十八条 （三）指令的发送、确认和执行程序 2、对投资限制的监督 管理人以传真、电子邮件方式或托管人和管理人确认的其他方式发送指令。集合计划托管人传真号为：【021-54662130】；集合计划托管人的电子邮箱为：【njtg@njcb.com.cn】；集合计划管理人的传真号为：025-84552965、025-84552981，集合计划管理人的电子邮箱为liuchenwei@njzq.cn。

原合同条款	变更后条款
第十八章 越权交易的界定	
第四十九条 (三)被动超标 1、由于包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、组合规模变动等管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。发生上述情形时，管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的【15】个交易日内进行调整，以满足法律法规及投资政策的要求。法律法规另有规定的从其规定。	第四十九条 （三）被动超标 1、由于包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、组合规模变动等管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。发生上述情形时，管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的20个交易日内进行调整，以满足法律法规及投资政策的要求。法律法规另有规定的从其规定。
第四十九条 （四）托管人对管理人的投资监督 2、对投资限制的监督 （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）；	第四十九条 （四）托管人对管理人的投资监督 2、对投资限制的监督 删除第（4）条。
第四十九条 （四）托管人对管理人的投资监督 2、对投资限制的监督	第四十九条 （四）托管人对管理人的投资监督 2、对投资限制的监督

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管理人之外的因素致使本计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同的有关规定的，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 个交易日内调整至符合相关要求。	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管理人之外的因素致使本计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同的有关规定的，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 个交易日内调整至符合相关要求。
---	---

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	
第五十条 （三）单位净值 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。	第五十条 （三）单位净值 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。
第五十条 （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，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；	第五十条 （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；
第五十条 （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	第五十条 （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

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。	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。
第五十条 （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。	第五十条 （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定公允价值。

原合同条款	变更后条款
第二十三章 风险揭示	
第六十六条 （十九）其它风险 10、关联交易风险 关联交易风险是指在资产管理计划运作过程中，存在因管理人管理交易认定标准、关联交易定价、关联交易审批程序而引起的风险。根据本合同的约定，本集合计划运作过程中管理人可以将计划的资产投资于管理人、托管人及其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发行的证券或承销期内承销的证券，或从事其他重大关联交易，因此可能存在利益输送、内幕交易、操纵市场的风险，提请委托人知悉并充分关注，委托人签订《资产管理合同》即代表委托人认可同意上述关联交易并自愿	第六十六条 （十九）其它风险 10、从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险 管理人根据对受托资产或投资者利益的影响程度，将关联交易分为重大关联交易及一般关联交易。 对于重大关联交易，本计划可以在事先取得投资者同意的前提下开展。虽然管理人将依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则按照市场公允定价进行公平交易，但仍可能存在对计划资产产生重大影响风险。 投资者已同意并授权管理人可从事一般关联交易。一般关联交易的相关投资存在一定风险，管理人承诺关联交易应按照市场通

承担相关风险；	行的方式和条件进行，投资者认可此等一般关联交易情形的存在并自愿承担相关投资风险；
---------	--

说明书部分：

《南京证券神州鑫利 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 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 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 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 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 2 号集合资产管理计划资产管理合同及说明书变更对照表》。

请投资者在 2025 年 5 月 12 日(含)前回复意见。(传真至 025-84552981 或发送邮件至 njzqzgxp02@njzq.cn)

投资者不同意此次合同变更的,应在 2025 年 5 月 12 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。



《南京证券神州鑫利 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 2 号集合资产管理计划资产管理合同及说明书变更对照表》中所提及的相关条款变更。

投资者（签字或盖章）：

2025 年 月 日

