

关于申港证券梓金 1 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（五）

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“申港证券梓金 1 号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）于 2022 年 12 月 2 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《申港证券梓金 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、3 条约定：

“1、因监管规则变化以外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。

3、集合计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意，并按上述规定履行资产管理合同变更程序。”

现向投资者征询变更意见，具体如下：

一、变更对照明细表

1、对原合同第一章“前言”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
为规范申港证券梓金1号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）运作，明确《申港证券梓金1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“资产管理合同”）当事人的权利与义务，维护投资者合法权益，依据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》等法律法规、中国证监会、中国证券业协会及中国证券投资基金业协会的有关规定，投资者、管理人、托管人遵循平等自愿、诚实信用、公平原则订立资产管理合同，维护投资者合法权益，不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权	为规范申港证券梓金1号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”或“集合计划”）运作，明确《申港证券梓金1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“资产管理合同”）当事人的权利与义务，依据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》等法律法规、中国证监会、中国证券业协会及中国证券投资基金业协会的有关规定，投资者、管理人、托管人遵循平等自愿、诚实信用、公平原则订立资产管理合同，维护投资者合法权益，不得损害国家利益、社会公共利益和他人合法权益。

益。	
----	--

2、对原合同第四章“当事人及权利义务”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
管理人 名称：申港证券股份有限公司 法定代表人：邵亚良 住所：上海市浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦16/22/23楼 邮政编码：200122 联系人：杨程 联系电话：（021）20639345 传真：（021）20639696	管理人 名称：申港证券股份有限公司 法定代表人：邵亚良 住所：上海市浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦16/22/23楼 通讯地址：上海市浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦19楼 邮政编码：200122 联系人：雷伯特 联系电话：（021）20639470 传真：（021）20639696
（二）管理人的权利和义务 2、管理人的义务包括但不限于： （25）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、中国证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；	（二）管理人的权利和义务 2、管理人的义务包括但不限于： （25）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、中国证券投资基金业协会并通知托管人和投资者（如报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）；
（三）托管人的权利和义务 2、托管人的义务包括但不限于： 	（三）托管人的权利和义务 2、托管人的义务包括但不限于：

(14) 投资于《管理办法》第三十八条第(五)项规定资产时,准确、合理界定安全保管集合计划财产、监督管理人投资运作等职责,并向投资者充分揭示;	(14) 投资于《管理办法》第三十八条第(五)项规定资产时,准确、合理界定安全保管集合计划财产,监督管理人投资运作等职责;
--	--

3、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:
(四) 投资目标、主要投资方向及投资范围、投资比例、产品风险等级 2、主要投资方向及投资范围 本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求,主要投资以下资产: (1) 银行存款(含结构性存款)、同业存单、债券逆回购,以及符合《指导意见》规定的标准化债权类资产,包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的国债、中央银行票据、地方政府债券、政策性金融债、金融债券(含次级债和混合资本债)、政府支持机构债券、企业债券、公司债券【包括公开发行公司债券和非公开发行公司债券;含可转换公司债券(含分离交易可转债)、可交换债券(含公开发行可交换债券和非公开发行可交换债券)】、资产支持票据(ABN)优先级、资产支持证券(ABS)优先级、项目收益债、短期	(四) 投资目标、主要投资方向及投资范围、投资比例、产品风险等级 2、主要投资方向及投资范围 本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求,主要投资以下资产: (1) 银行存款(含结构性存款)、同业存单、债券逆回购,以及符合《指导意见》规定的标准化债权类资产,包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的国债、中央银行票据、地方政府债券、政策性金融债、金融债券(含次级债和混合资本债)、政府支持机构债券、企业债券、公司债券【包括公开发行公司债券和非公开发行公司债券;含可转换公司债券(含分离交易可转债)、可交换债券(含公开发行可交换债券和非公开发行可交换债券)】、资产支持票据(ABN)(不含劣后级)、资产支持证券(ABS)(不含劣后级)、

融资券及超短期融资券、中期票据（含长期限含权中期票据）、集合票据、集合债券、非公开定向债务融资工具（PPN）、项目收益票据（PRN）； （2）国债期货、凭证类信用风险缓释工具； （3）公开募集证券投资基金（包括债券型基金、货币市场基金、股票型基金、混合型基金、公开募集基础设施证券投资基金、QDII 基金、港股通 ETF）； （4）债券正回购。 法律法规或监管机构允许投资的品种，并且得到投资者书面确认的，经管理人及托管人书面一致同意后，可以将其纳入投资范围。 特别提示： （1）本集合计划投资范围包括债券回购。 （2）本集合计划投资凭证类信用风险缓释工具及结构性存款，挂钩标的为境内标准化债权类资产及境外债券类资产。 3、投资比例 固定收益类资产：占集合计划总资产的比例为 80%-100%。 具体比例按照该固定收益类资产的市值占整个资产管理计划总资产的比例来计算。 本集合计划应当按照所投资资产	项目收益债、短期融资券及超短期融资券、中期票据（含长期限含权中期票据）、集合票据、集合债券、非公开定向债务融资工具（PPN）、项目收益票据（PRN）； （2）国债期货、凭证类信用风险缓释工具； （3）公开募集证券投资基金，包括债券型基金、货币市场基金、股票型基金、混合型基金、公开募集基础设施证券投资基金、QDII 基金、ETF 基金、香港互认基金； （4）债券正回购。 如果本集合计划成立后出现法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他品种，或者管理人根据市场情况认为需要变更集合计划投资范围或者投资比例的，管理人应当先取得投资者同意，同时应与托管人就新增投资品种的清算交收、核算估值等达成一致，再履行资产管理合同变更、备案等法律法规以及监管机构规定、资产管理合同约定的程序。 特别提示： （1）本集合计划投资范围包括债券回购。 （2）本集合计划投资凭证类信用风险缓释工具及结构性存款，挂钩标的为境内标准化债权类资产及境外债券
--	---

管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算该资产管理计划所投资资产的金额或比例。资产管理计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算。 如果本集合计划成立后出现法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他品种，或者管理人根据市场情况认为需要变更集合计划投资范围或者投资比例的，管理人应当先取得投资者同意，同时应与托管人就新增投资品种的清算交收、核算估值等达成一致，再履行资产管理合同变更、备案等法律法规以及监管机构规定、资产管理合同约定的程序。	类资产。 3、投资比例 固定收益类资产：占集合计划总资产的比例为 80%-100%。 具体比例按照该固定收益类资产的市值占整个资产管理计划总资产的比例来计算。 本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算该资产管理计划所投资资产的金额或比例。资产管理计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算。
---	--

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：
(二) 投资范围及比例 1、主要投资方向及投资范围 本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求，主要投资以下资产： (1) 银行存款（含结构性存款）、同业存单、债券逆回购，以及符合《指导意见》规定的标准化债权类资产，包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的国债、中央银行票据、地	(二) 投资范围及比例 1、主要投资方向及投资范围 本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求，主要投资以下资产： (1) 银行存款（含结构性存款）、同业存单、债券逆回购，以及符合《指导意见》规定的标准化债权类资产，包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的国债、中央银行票据、地

方政府债券、政策性金融债、金融债券（含次级债和混合资本债）、政府支持机构债券、企业债券、公司债券【包括公开发行人公司债券和非公开发行人公司债券；含可转换公司债券（含分离交易可转债）、可交换债券（含公开发行人可交换债券和非公开发行人可交换债券）】、资产支持票据（ABN）优先级、资产支持证券（ABS）优先级、项目收益债、短期融资券及超短期融资券、中期票据（含长期限含权中期票据）、集合票据、集合债券、非公开定向债务融资工具（PPN）、项目收益票据（PRN）；

（2）国债期货、凭证类信用风险缓释工具；

（3）公开募集证券投资基金（包括债券型基金、货币市场基金、股票型基金、混合型基金、公开募集基础设施证券投资基金、QDII 基金、港股通 ETF）；

（4）债券正回购。

法律法规或监管机构允许投资的品种，并且得到投资者书面确认的，经管理人及托管人书面一致同意后，可以将其纳入投资范围。

特别提示：

（1）本集合计划投资范围包括债券回购。

（2）本集合计划投资凭证类信用风险缓释工具及结构性存款，挂钩标的

方政府债券、政策性金融债、金融债券（含次级债和混合资本债）、政府支持机构债券、企业债券、公司债券【包括公开发行人公司债券和非公开发行人公司债券；含可转换公司债券（含分离交易可转债）、可交换债券（含公开发行人可交换债券和非公开发行人可交换债券）】、资产支持票据（ABN）（不含劣后级）、资产支持证券（ABS）（不含劣后级）、项目收益债、短期融资券及超短期融资券、中期票据（含长期限含权中期票据）、集合票据、集合债券、非公开定向债务融资工具（PPN）、项目收益票据（PRN）；

（2）国债期货、凭证类信用风险缓释工具；

（3）公开募集证券投资基金，包括债券型基金、货币市场基金、股票型基金、混合型基金、公开募集基础设施证券投资基金、QDII 基金、ETF 基金、香港互认基金；

（4）债券正回购。

如果本集合计划成立后出现法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他品种，或者管理人根据市场情况认为需要变更集合计划投资范围或者投资比例的，管理人应当先取得投资者同意，同时应与托管人就新增投资品种的清算交收、核算估值等达成一致，再

为境内标准化债权类资产及境外债券类资产。 2、投资比例 固定收益类资产：占集合计划总资产的比例为 80%-100%。 具体比例按照该固定收益类资产的市值占整个资产管理计划总资产的比例来计算。 本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算该资产管理产品所投资资产的金额或比例。本集合计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算。 如果本集合计划成立后出现法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他品种，或者管理人根据市场情况认为需要变更集合计划投资范围或者投资比例的，管理人应当先取得投资者同意，同时应与托管人就新增投资品种的清算交收、核算估值等达成一致，再履行资产管理合同变更、备案等法律法规以及监管机构规定、资产管理合同约定的程序。	履行资产管理合同变更、备案等法律法规以及监管机构规定、资产管理合同约定的程序。 特别提示： (1) 本集合计划投资范围包括债券回购。 (2) 本集合计划投资凭证类信用风险缓释工具及结构性存款，挂钩标的为境内标准化债权类资产及境外债券类资产。 2、投资比例 固定收益类资产：占集合计划总资产的比例为 80%-100%。 具体比例按照该固定收益类资产的市值占整个资产管理计划总资产的比例来计算。 本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算该资产管理产品所投资资产的金额或比例。本集合计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算。
(五) 投资策略 3、投资管理的方法和标准 	(五) 投资策略 3、投资管理的方法和标准

(3) 制定投资策略与资产配置比例 投资经理综合考虑政治、经济及资本市场状况等因素，根据投资目标、原则、限制和研究建议，拟定投资策略，包括整体资产配置策略（期限结构和资产结构）、具体资产配置方案等，报资产管理业务投资决策委员会审批通过。 4、投资策略 (2) 期限结构策略：在确定债券资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，对债券市场收益率期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，预测收益率期限结构的变化方式，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等，以达到预期投资收益最大化的目的。 (3) 利差交易策略：对不同类型债券品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债和其他固定收益类资产的利差和变化趋势，制定利差交易策略，以获取不同固定收益类属之间利差变化所带来的投资收益。	(3) 制定投资策略与资产配置比例 投资经理综合考虑政治、经济及资本市场状况等因素，根据投资目标、原则、限制和研究建议，拟定投资策略，包括整体资产配置策略（期限结构和资产结构）、具体资产配置方案等。 4、投资策略 (2) 期限结构策略：在确定债券资产组合平均久期的基础上，根据利率期限结构的特点，对债券市场收益率期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，预测收益率期限结构的变化方式，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立最优化的债券投资组合，例如子弹组合、哑铃组合或阶梯组合等。 (3) 利差交易策略：对不同类型债券品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的利率债、金融债和其他固定收益类资产的利差和变化趋势，制定利差交易策略，以获取不同固定收益类属之间利差变化所带来的投资收益。
(六) 投资限制 为维护投资者的合法权益，本集合	(六) 投资限制 为维护投资者的合法权益，本集合

计划的投资限制为： 1、债券（不含短期公司债券（指债券期限不超过一年的公司债券）、短期融资券、超短期融资券）的债项评级需为AA级及以上，短期公司债券、短期融资券、超短期融资券的债项评级需为A-1级，如债券无债项评级的，发行人主体评级或债券担保人评级需为AA级及以上。主体评级和担保人评级均不参考中债资信评估有限责任公司出具的评级结果；	计划的投资限制为： 1、债券（不含短期公司债券（指债券期限不超过一年的公司债券）、短期融资券、超短期融资券）的债项评级需为AA级及以上，短期公司债券、短期融资券、超短期融资券的债项评级需为A-1级。如债券无债项评级的，发行人主体评级或债券担保人评级需为AA级及以上。主体评级和担保人评级均不参考中债资信评估有限责任公司出具的评级结果；
---	---

5、对原合同第十八章“越权交易的界定”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
（三）托管人对管理人投资运作的监督 1、主要投资方向及投资范围 （1）银行存款（含结构性存款）、同业存单、债券逆回购，以及符合《指导意见》规定的标准化债权类资产，包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的国债、中央银行票据、地方政府债券、政策性金融债、金融债券（含次级债和混合资本债）、政府支持机构债券、企业债券、公司债券【包括公开发行公司债券和非公开发行公司债券；含可转换公司债券（含分离交易可	（三）托管人对管理人投资运作的监督 1、主要投资方向及投资范围 （1）银行存款（含结构性存款）、同业存单、债券逆回购，以及符合《指导意见》规定的标准化债权类资产，包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的国债、中央银行票据、地方政府债券、政策性金融债、金融债券（含次级债和混合资本债）、政府支持机构债券、企业债券、公司债券【包括公开发行公司债券和非公开发行公司债券；含可转换公司债券（含分离交易可

转债)、可交换债券(含公开发行可交换债券和非公开发行可交换债券)】、资产支持票据(ABN)优先级、资产支持证券(ABS)优先级、项目收益债、短期融资券及超短期融资券、中期票据(含长期限含权中期票据)、集合票据、集合债券、非公开定向债务融资工具(PPN)、项目收益票据(PRN); (2) 国债期货、凭证类信用风险缓释工具; (3) 公开募集证券投资基金(包括债券型基金、货币市场基金、股票型基金、混合型基金、公开募集基础设施证券投资基金、QDII 基金、港股通 ETF); (4) 债券正回购。 法律法规或监管机构允许投资的品种,并且得到投资者书面确认的,经管理人及托管人书面一致同意后,可以将其纳入投资范围。 2、投资比例 固定收益类资产:占集合计划总资产的比例为 80%-100%。 具体比例按照该固定收益类资产的市值占整个资产管理计划总资产的比例来计算。 本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率,及时更新计算该资产管理计划所投资资产的金额或比例。资产管理计划投资于其他	转债)、可交换债券(含公开发行可交换债券和非公开发行可交换债券)】、资产支持票据(ABN)(不含劣后级)、资产支持证券(ABS)(不含劣后级)、项目收益债、短期融资券及超短期融资券、中期票据(含长期限含权中期票据)、集合票据、集合债券、非公开定向债务融资工具(PPN)、项目收益票据(PRN); (2) 国债期货、凭证类信用风险缓释工具; (3) 公开募集证券投资基金,包括债券型基金、货币市场基金、股票型基金、混合型基金、公开募集基础设施证券投资基金、QDII 基金、ETF 基金、香港互认基金; (4) 债券正回购。 如果本集合计划成立后出现法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他品种,或者管理人根据市场情况认为需要变更集合计划投资范围或者投资比例的,管理人应当先取得投资者同意,同时应与托管人就新增投资品种的清算交收、核算估值等达成一致,再履行资产管理合同变更、备案等法律法规以及监管机构规定、资产管理合同约定的程序。 2、投资比例 固定收益类资产:占集合计划总资产
--	---

资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算。	产的比例为 80%-100%。
上述投资比例和投资限制，如涉及穿透核查或穿透合并计算的，管理人应当根据所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时通过邮件方式（托管人的邮箱地址为 custody@nbcbl.cn；custody-audit@nbcbl.cn）向托管人提供本集合计划所投资其他资产管理产品的估值表和净值数据等核查信息，托管人仅根据管理人提供的数据进行复核，并根据管理人提供的数据及时进行投资监督。管理人应确保对所提供数据材料的真实性、准确性以及完整性负责。由于底层数据材料的提供频率、脱敏处理、可披露程度等原因导致托管人实际监督范围受限的，由此造成的后果由管理人承担。如本集合计划所投资其他资产管理产品披露组合的频率发生变化的，由托管人及管理人协商一致后进行调整。涉及证券投资基金穿透监控的，以最近 1 个季度证券投资基金定期披露的报告为准。	具体比例按照该固定收益类资产的市值占整个资产管理计划总资产的比例来计算。
	本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算该资产管理计划所投资资产的金额或比例。资产管理计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算。
如果本集合计划成立后出现法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他品种，或者管理人根据市场情况认为需要变更集合计划投资范围或者投资比例的，管理人应当先取得投资者	上述投资比例和投资限制，如涉及穿透核查或穿透合并计算的，管理人应当根据所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时通过邮件方式（托管人的邮箱地址为 custody@nbcbl.cn；custody-audit@nbcbl.cn。管理人邮箱地址：shgsec_zgrisk@shgsec.com）向托管人提供本集合计划所投资其他资产管理产品的估值表和净值数据等核查信息，托管人仅根据管理人提供的数据进行复核，并根据管理人提供的数据及时进行投资监督。管理人应确保对所提供数据材料的真实性、准确性以及完整性负责。由于底层数据材料的提供频率、脱敏处理、可披露程度等原因导致托管人实际监督范围受限的，由此造成的后果由管理人承担。如本集合计划所投资其他资产管理产品披露组合的频

同意，同时应与托管人就新增投资品种的清算交收、核算估值等达成一致，再履行资产管理合同变更、备案等法律法规以及监管机构规定、资产管理合同约定的程序。 3、投资限制 (1) 债券（不含短期公司债券（指债券期限不超过一年的公司债券）、短期融资券、超短期融资券）的债项评级需为 AA 级及以上，短期公司债券、短期融资券、超短期融资券的债项评级需为 A-1 级，如债券无债项评级的，发行人主体评级或债券担保人评级需为 AA 级及以上。主体评级和担保人评级均不参考中债资信评估有限责任公司出具的评级结果。	率发生变化的，由托管人及管理人协商一致后进行调整。涉及证券投资基金穿透监控的，以最近 1 个季度证券投资基金定期披露的报告为准。 3、投资限制 (1) 债券（不含短期公司债券（指债券期限不超过一年的公司债券）、短期融资券、超短期融资券）的债项评级需为 AA 级及以上，短期公司债券、短期融资券、超短期融资券的债项评级需为 A-1 级。如债券无债项评级的，发行人主体评级或债券担保人评级需为 AA 级及以上。主体评级和担保人评级均不参考中债资信评估有限责任公司出具的评级结果。
---	--

6、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：
(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 2、管理人的管理费 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： $H = E \times 0.5\% \div \text{当年实际天数}$	(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 2、管理人的管理费 本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.6%年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.6\% \div \text{当年实际天数}$
(三) 管理人的业绩报酬 1、业绩报酬的计提原则及提取频	(三) 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; (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	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; (4) 份额持有人退出或本集合计划终止清算时,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清算时持有份额计算。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 <u>业绩报酬计提基准日为本集合计划分红除息日(如有)、投资者退出申</u>
---	--

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。

请日和集合计划清算日。业绩报酬计提日为本集合计划分红确认日(如有)、投资者退出确认日和集合计划清算日。

业绩报酬的计提,管理人计算上一个业绩报酬计提基准日(若上一个业绩报酬计提基准日不存在则初始募集期内参与的,以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提基准日;存续期参与的,以参与申请日为上一个业绩报酬计提基准日,下同)到本次业绩报酬计提基准日的年化收益率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。

期间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^* 为投资者本次业绩报酬计提基准日的累计单位净值。

P_0^* 为投资者上一个业绩报酬计提基准日的累计单位净值。

P_0 为投资者上一个业绩报酬计提基准日的单位净值。

D为投资者上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的的年限(若上

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单位净值。

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单位净值。

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)
$R \leq r$	0%	$I = [(R - r) \times 60\%] \times A \times D$
$R > r$	60%	$I = [(R - r) \times 60\%] \times A \times D$

其中：

I 为单笔份额对应的单个业绩报酬

一个业绩报酬计提日不存在则初始募集期内参与的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日；存续期参与的，以参与确认日为上一个业绩报酬计提日，下同）。

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)
$R \leq r$	0%	$I = 0$
$R > r$	60%	$I = [(R - r) \times 60\%] \times A \times D$

其中：

I 为单笔份额对应的管理人业绩报酬；

A 为投资者该笔份额于上一个业绩报酬计提基准日的资产净值总额；

D 为投资者上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限；

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。

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

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（ ΣI ）：

$$\Sigma I = \text{MAX}(I_1 + I_2 + I_3 + \dots + I_n, 0)$$

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

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。

如业绩报酬计提基准或比例发生变更，则管理人将对每笔份额按相应的业绩报酬计提基准或比例分段计算并加总，作为该笔份额的管理人业绩报酬。

因业绩报酬计算涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人计算。

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，业绩报酬由管理人计算。	
---	--

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：
（二）一般风险揭示 7、投资标的风险 （12）跨境投资的风险 由于境外投资受到各个国家/地区宏观经济运行情况货币政策、财政政策、产业政策、税法、汇率、交易规则、结算、托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使投资标的中挂钩的境外标的资产面临潜在风险。此外，境外投资的成本、境外市场的波动性也可能高于国内市场，存在一定的市场风险。	（二）一般风险揭示 7、投资标的风险 （12）投资香港互认基金的特有风险 ①境外市场风险：由于香港互认基金可能以境外市场为主要投资方向，境外市场投资受到所投资市场宏观经济运行情况、货币政策、财政政策、产业政策、税法、汇率、交易规则、结算、托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使基金资产面临潜在风险，进而可能对投资者的收益产生影响。 ②汇率风险：本集合计划投资于香港互认基金，如果基金部分或全部的相关投资非以人民币计价，基金资产在不同币种之间兑换后的价格可能受相关汇率波动影响，从而影响到基金的收益，进而可能会对投资者的投资收益产

	生影响。 ③法律风险：香港互认基金需要遵守香港的法律法规。如果相关法律法规发生变化，或者基金在遵守法律法规方面出现问题，可能会对基金的运作产生影响。 ④政策风险：香港互认基金的运作和销售受到中国内地和香港两地政策的影响。如果政策发生变化，可能会对基金的运作产生影响。 ⑤双边税务风险：由于香港互认基金涉及到内地和香港两地的税务，因此可能存在双边税务风险。例如，内地或香港的税务政策发生变化，或者两地的税务政策存在冲突，可能会对投资者的投资收益产生影响。 （13）跨境投资的风险 由于境外投资受到各个国家/地区宏观经济运行情况货币政策、财政政策、产业政策、税法、汇率、交易规则、结算、托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使投资标的中挂钩的境外标的资产面临潜在风险。此外，境外投资的成本、境外市场的波动性也可能高于国内市场，存在一定的市场风险。
13、业绩报酬计提基准的风险 本集合计划的业绩报酬计提基准	13、业绩报酬计提的风险 本集合计划的业绩报酬计提基准

仅为本集合计划管理人提取业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人和销售机构保证资产管理计划财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。本集合计划业绩报酬计提基准发生变更时由管理人通过公告形式告知投资者（包括届时现存的投资者）及托管人。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，应当根据资产管理合同约定在开放期退出其全部持有的集合计划份额。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。	仅为本集合计划管理人提取业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人和销售机构保证资产管理计划财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。本集合计划业绩报酬计提基准发生变更时由管理人通过公告形式告知投资者（包括届时现存的投资者）及托管人。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，应当根据资产管理合同约定在开放期退出其全部持有的集合计划份额。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。期间年化收益率的计算周期和业绩报酬计算中年限的计算周期不完全匹配，从而影响业绩报酬计算结果，可能对投资者的利益产生不利影响。
--	--

以上变更内容《申港证券睿泽梓金 1 号集合资产管理计划说明书》、《申港证券睿泽梓金 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。

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《申港证券睿泽梓金 1 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 2025 年 6 月 16 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 2025 年 6 月 16 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 2025 年 6 月 16 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申请退出其持有的全部集合计划份额的，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



申港证券睿泽梓金 1 号集合资产管理计划

合同变更征询的回函

请投资者根据《关于申港证券睿泽梓金 1 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（五）》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”或签章确认，并于落款处签字或盖章；不同意合同变更之投资者，请于“不同意”栏填写“不同意”或签章确认，并于落款处签字或盖章。

申港证券睿泽梓金1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	