

## 关于申港证券梓金 3 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（四）

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 3 号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）于 2023 年 8 月 29 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 3 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、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。

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。”

### 一、变更对照明细表

#### 1、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：
托管人 名称：兴业银行股份有限公司 法定代表人：吕家进 住所：福建省福州市台江区江滨中 大道 398 号兴业银行大厦 通讯地址：上海市浦东新区银城路 167 号 联系人：文茂杰 联系电话：15208675658	托管人 名称：兴业银行股份有限公司 法定代表人：吕家进 住所：福建省福州市台江区江滨中 大道 398 号兴业银行大厦 通讯地址：上海市浦东新区银城路 167 号 联系人：陈益希 联系电话：021-52629999
（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）；

#### 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：
------	------

(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  
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) 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

(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)、  
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) 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

证券投资基金、QDII 基金、港股通 ETF；	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；
-------------------------	--

3、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>(二) 投资范围及比例</p> <p>1、主要投资方向及投资范围</p> <p>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：</p> <p>(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）；</p>	<p>(二) 投资范围及比例</p> <p>1、主要投资方向及投资范围</p> <p>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：</p> <p>(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）、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</p>

<p>(2) 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；</p>	<p>(PRN)；</p> <p>(2) 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；</p>
<p>(五) 投资策略</p> <p>.....</p> <p>4、投资策略</p> <p>.....</p> <p>(5) 期货和衍生品类投资策略： 本集合计划可能运用合同约定的期货和衍生品类资产进行对冲、投机、套利等交易，实现降低波动、增厚收益的目标，具体投资比例及交易对手在法律法规及本合同约定范围内由投资经理筛选、交易询价人员报价，综合市场及监管要求等多方面因素确定。</p>	<p>(五) 投资策略</p> <p>.....</p> <p>4、投资策略</p> <p>.....</p> <p>(5) 期货和衍生品类投资策略： 本集合计划可能运用合同约定的期货和衍生品类资产对冲风险、增厚收益，具体投资比例、挂钩标的及交易对手在法律法规及本合同约定范围内由投资经理筛选、交易询价人员报价，综合市场及监管要求等多方面因素确定。</p>
<p>(六) 投资限制</p> <p>为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>1、债券（不含短期公司债券（是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</p>	<p>(六) 投资限制</p> <p>为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>1、债券（不含短期公司债券（是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</p>

ES  
有  
册  
NE

不参考中债资信评估有限责任公司出具的评级结果；

2、本集合计划总资产不得超过集合计划净资产的 180%；

3、本集合计划投资于同一资产的资金不得超过本集合计划资产净值的 25%，银行活期存款、国债、地方政府债券、央行票据和政策性金融债除外；

4、本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划资产净值的 20%；

5、本集合计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本集合计划资产净值的 10%；

6、本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，该集合计划的总资产不得超过其净资产的 120%，国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；

7、本集合计划投资的可转债和可交换债不得转股或换股；

8、期货的风险度不得超过 90%，期货风险度=期货保证金占用/期货账户全部权益（含保证金占用及可用资金）；

9、不得投资于投资范围之外的投资品种；

10、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

不参考中债资信评估有限责任公司出具的评级结果；

2、本集合计划总资产不得超过集合计划净资产的 180%；

3、本集合计划投资于同一资产的资金不得超过本集合计划资产净值的 25%，银行活期存款、国债、地方政府债券、央行票据和政策性金融债除外；

4、本集合计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本集合计划资产净值的 10%；

5、本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，该集合计划的总资产不得超过其净资产的 120%，国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；

6、本集合计划投资的可转债和可交换债不得转股或换股；

7、期货的风险度不得超过 90%，期货风险度=期货保证金占用/期货账户全部权益（含保证金占用及可用资金）；

8、不得投资于投资范围之外的投资品种；

9、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

<p>(十一) 资产组合的流动性</p> <p>本集合计划在开放期保持适当比例的现金或者其他高流动性金融资产，以保持本集合计划整体流动性充足，其中开放退出期内资产组合中7个工作日可变现资产的价值不低于集合计划资产净值的10%，主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划资产净值的20%，实现资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配。</p>	<p>(十一) 资产组合的流动性</p> <p>本集合计划在开放期保持适当比例的现金或者其他高流动性金融资产，以保持本集合计划整体流动性充足，其中开放退出期内资产组合中7个工作日可变现资产的价值不低于集合计划资产净值的10%，实现资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配。</p>
---	---

4、对原合同第十四章“利益冲突及关联交易”中的表述作如下变更：

原表述：	现表述：
<p>(二) 关联交易</p> <p>1、关联交易定义</p> <p>本集合计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p> <p>(1) 买卖本集合计划关联方发行证券或承销期内承销的证券（含资产支持证券）；</p> <p>(2) 通过本集合计划关联方（管理人除外）席位及交易单元进行产品交易；</p> <p>(3) 向本集合计划关联方（管理人、托管人除外）支付报酬；</p> <p>(4) 投资于本集合计划关联方所管理的资产管理产品；</p> <p>(5) 与关联方开展证券等交易，交易对手方、质押券涉及关联方。</p>	<p>(二) 关联交易</p> <p>1、关联交易定义</p> <p>本集合计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p> <p>(1) 买卖本集合计划关联方发行证券或承销期内承销的证券（含资产支持证券）；</p> <p>(2) 通过本集合计划关联方（管理人除外）席位及交易单元进行产品交易；</p> <p>(3) 向本集合计划关联方（管理人、托管人、投资顾问除外）支付报酬；</p> <p>(4) 投资于本集合计划关联方管理的其他资产管理计划；</p> <p>(5) 与本集合计划关联方开展证券等交易，交易对手方、质押券涉及本</p>

<p>管理人从事的重大关联交易包括但不限于：</p> <p>(1) 本集合计划与一个关联方之间单笔交易金额达到 3000 万元以上且占本集合计划资产净值 5%以上的交易；</p> <p>(2) 管理人管理的多个资产管理计划与一个关联方之间年度累计交易金额达到 8000 万元以上且占该多个资产管理计划资产净值 10%以上的交易；</p> <p>(3) 本集合计划投资其关联方发行证券或承销期内承销的证券（含资产支持证券）。</p> <p>除上述提到的重大关联交易外，其他关联交易视为一般关联交易。</p> <p>如法律法规、监管规定以及管理人内部管理制度发生变化的，管理人将适时调整上述定义和区分标准，并以公告的形式进行披露及遵照执行。</p> <h2>2、关联交易程序</h2> <p>管理人进行关联交易，应当符合本合同约定的投资目标及策略，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益，并区分一般和重大关联交易进行分级管理，履行不同的交易决策及信息披露程序。</p> <p>投资者在此同意并授权管理人可以从事一般关联交易，根据管理人的内部制度由相关内控部门进行审批，交易完成后管理人在定期报告中向投资者</p>	<p>集合计划关联方。</p> <p>管理人从事的重大关联交易包括但不限于：</p> <p>(1) 本集合计划与单个关联方之间单日交易金额合计达到1亿元以上且占本集合计划资产净值 10%以上的交易；</p> <p>(2) 本集合计划投资其关联方发行证券或承销期内承销的证券（含资产支持证券）。</p> <p>涉及投资于本集合计划关联方管理的其他资产管理计划的交易金额按照认购/申购等增加持仓的单边方向计算。除上述提到的重大关联交易外，其他关联交易视为一般关联交易。</p> <h2>2、关联交易程序</h2> <p>管理人进行关联交易，应当符合本合同约定的投资目标及策略，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益，并区分一般和重大关联交易进行分级管理，履行不同的交易决策及信息披露程序。</p> <p>投资者在此同意并授权管理人可以从事一般关联交易，根据管理人的内部制度由相关内控部门进行审批，交易完成后管理人在定期报告中向投资者统一进行披露，并告知托管人及向监管机构报告。管理人从事重大关联交易的，应通过逐笔征求意见或者公告确认</p>
---	---

统一进行披露，并告知托管人及向监管机构报告。管理人从事重大关联交易的，应通过逐笔征求意见或者公告确认等方式取得投资者同意，管理人将保障不同意投资者的退出权利，不同意管理人从事重大关联交易的投资者可在管理人指定的开放期内退出，未在管理人指定的开放期退出其持有全部份额及开放期参与的投资者视为同意管理人从事重大关联交易。重大关联交易根据管理人的内部制度提交资产管理业务投资决策委员会进行审批，交易完成后管理人在临时报告和定期报告中向投资者披露，并告知托管人及向监管机构报告。（如信披与报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）

如法律法规、监管规定以及管理人内部管理制度发生变化的，管理人将适时调整上述内部审批机制，并以公告的形式进行披露及遵照执行。

### 3、关联方认定

关联方按照《企业会计准则》及证券公司相关规定确定。本集合计划关联方包括管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方。管理人关联方名单详见管理人指定网站公告。托管人关联方名单以托管人官网（<https://www.cib.com.cn/>）最新披露名单为准。

等方式取得投资者同意，管理人将保障不同意投资者的退出权利，不同意管理人从事重大关联交易的投资者可在管理人指定的开放期内退出，未在管理人指定的开放期退出其持有全部份额及开放期参与的投资者视为同意管理人从事重大关联交易。重大关联交易根据管理人的内部制度提交资产管理业务投资决策委员会进行审批，交易完成后管理人在临时报告和定期报告中向投资者披露，并告知托管人及向监管机构报告。（如信披与报备相关监管规定有变更，将按最新规定执行）

### 3、关联方认定

关联方按照《企业会计准则》及证券公司相关规定确定。本集合计划关联方包括管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方。管理人关联方名单详见管理人指定网站公告。托管人关联方名单以托管人官网（<https://www.cib.com.cn/>）最新披露名单为准。

管理人、托管人根据自身及对方提供的关联方名单进行关联交易监控，托管人根据自身及管理人提供的名单对本集合计划的关联证券交易进行监督，仅对买卖关联方发行的或者承销期内承销的证券进行关联交易监督。双方均应事前将其关联方名单或关联方披露

<p>管理人、托管人根据自身及对方提供的关联方名单进行关联交易监控，托管人根据自身及管理人提供的名单对本集合计划的关联证券交易进行监督，仅对买卖关联方发行的或者承销期内承销的证券进行关联交易监督。双方均应事前将其关联方名单或关联方披露途径明确告知相对方，并在相关信息更新时及时通知相对方。因一方未及时提供关联方名单或提供渠道不能查询最新关联方信息导致另一方监控不及时的，由违约方承担相关责任。</p>	<p>途径明确告知相对方，并在相关信息更新时及时通知相对方。因一方未及时提供关联方名单或提供渠道不能查询最新关联方信息导致另一方监控不及时的，由违约方承担相关责任。</p> <p>如法律法规、监管规定以及管理人内部管理制度发生变化的，管理人将适时调整上述关联交易定义、关联交易程序及关联方认定，并以公告的形式进行披露及遵照执行。</p>
--	--

5、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：
<p>(六) 其他账户的开立和管理</p> <p>因集合计划投资需要开立的其他账户应根据有关法律法规的规定开立，新账户按有关规则管理并使用。</p>	<p>(六) 期货投资账户的开立和管理</p> <p>管理人、托管人应当按照相关规定开立期货资金账户，在期货交易所获取交易编码。期货资金账户名称及交易编码对应名称应当按照有关规定设立。</p> <p>(七) 其他账户的开立和管理</p> <p>因集合计划投资需要开立的其他账户应根据有关法律法规的规定开立，新账户按有关规则管理并使用。</p>

6、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：
<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>.....</p>	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>.....</p>

<p>1、主要投资方向及投资范围</p> <p>(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）；</p> <p>(2) 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；</p> <p>.....</p> <p>3、投资限制</p> <p>(1) 债券（不含短期公司债券（是指债券期限不超过一年的公司债券）、</p>	<p>1、主要投资方向及投资范围</p> <p>(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）（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）；</p> <p>(2) 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；</p> <p>.....</p> <p>3、投资限制</p>
--	--

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;

(2)本集合计划总资产不得超过集合计划净资产的180%;

(3)本集合计划投资于同一资产的资金不得超过本集合计划资产净值的25%,银行活期存款、国债、地方政府债券、央行票据和政策性金融债除外;

(4)本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划资产净值的20%;

(5)本集合计划开放退出期内,其资产组合中7个工作日可变现资产的价值,不低于本集合计划资产净值的10%;

(6)本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产50%的,该集合计划的总资产不得超过其净资产的120%,国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外;

(1)债券(不含短期公司债券(是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;

(2)本集合计划总资产不得超过集合计划净资产的180%;

(3)本集合计划投资于同一资产的资金不得超过本集合计划资产净值的25%,银行活期存款、国债、地方政府债券、央行票据和政策性金融债除外;

(4)本集合计划开放退出期内,其资产组合中7个工作日可变现资产的价值,不低于本集合计划资产净值的10%;

(5)本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产50%的,该集合计划的总资产不得超过其净资产的120%,国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外;

(6)本集合计划投资的可转债和可交换债不得转股或换股;

<p>(7) 本集合计划投资的可转债和可交换债不得转股或换股；</p> <p>(8) 期货的风险度不得超过 90%，期货风险度=期货保证金占用/期货账户全部权益（含保证金占用及可用资金），托管人按照本集合计划季度报告和年度报告披露频率对此条指标进行监督；</p> <p>(9) 不得投资于投资范围之外的投资品种；</p> <p>(10) 法律法规或监管部门规定的其他投资限制。</p>	<p>(7) 期货的风险度不得超过 90%，期货风险度=期货保证金占用/期货账户全部权益（含保证金占用及可用资金），托管人按照本集合计划季度报告和年度报告披露频率对此条指标进行监督；</p> <p>(8) 不得投资于投资范围之外的投资品种；</p> <p>(9) 法律法规或监管部门规定的其他投资限制。</p>
<p>(八) 投资监督事项涉及穿透核查或穿透计算的，管理人应当定期向托管人提供穿透所需的相关材料、数据及计算底稿，托管人凭管理人提供的材料进行事后核查监督，托管人核查监督的及时性、准确性受限于管理人提供信息的频率和信息的完整性、准确性，最终投资责任在管理人。</p>	<p>(八) 投资监督事项涉及穿透核查或穿透计算的，管理人应当定期向托管人提供穿透所需的相关材料、数据及计算底稿，托管人凭管理人提供的材料进行事后核查监督，托管人核查监督的及时性、准确性受限于管理人提供信息的频率和信息的完整性、准确性，最终投资责任在管理人。</p> <p>(九) 如需托管人对关联交易进行监督的，管理人应于合同生效前提供关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。托管人仅根据自身及管理人提供的名单对集合计划买卖关联方发行的或者承销期内承销的证券进行关联交易监督。若管理人没有及时提供关联方信息，导致托管人无法及时对关联方证券进行监督，托管人不承</p>

担责任。

7、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>(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</p> <p>.....</p> <p>2、管理人的管理费</p> <p>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:</p> $H = E \times 0.5\% \div \text{当年实际天数}$	<p>(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</p> <p>.....</p> <p>2、管理人的管理费</p> <p>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:</p> $H = E \times 0.6\% \div \text{当年实际天数}$
<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)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</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)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</p>

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。因投资者退出集合计划时，管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

(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

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

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

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 (如为负值则不计提该周期对应的业绩报酬)。投资者该笔参与份额在每一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

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;

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%	$I=0$
$R > r$	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计提基准周期内的管理人业绩报酬；

A 为投资者该笔份额于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

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

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（ $\Sigma I$ ）：

$$\Sigma I = I_1 + I_2 + I_3 + \dots + I_n$$

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，业绩报酬的计算工作由管理人完  
成，托管人无需复核，托管人根据管  
理人指令进行划款。

### 3、业绩报酬支付

由管理人在业绩报酬计提完成后 5  
个工作日内向托管人发送业绩报酬划  
付指令，托管人于收到划付指令后从集

据，业绩报酬的计算由管理人完成，托  
管人无需复核，托管人根据管理人指令  
进行划款。

### 3、业绩报酬支付

每次业绩报酬计提结束后，由管理  
人向托管人发送业绩报酬划付指令，托  
管人收到指令后从资产管理计划资产  
中一次性支付给管理人。若遇法定节假  
日、休息日或不可抗力致使无法按时支  
付的，顺延至最近可支付日支付。

合计划资产中将计提的业绩报酬一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

8、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、投资标的的风险</p> <p>.....</p> <p>(7) 国债期货的投资风险</p> <p>.....</p> <p>④第三方风险</p> <p>A. 对手方风险</p> <p>管理人运用集合计划资产投资于期货合约，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的经纪商，但不能杜绝因所选择的经纪商在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致集合计划资产遭受损失。另外，管理人在银行间市场进行交易，也会因为银行间交易对手违约等发生对手方风险。</p> <p>.....</p> <p>(12) 跨境投资的风险</p> <p>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</p>	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>.....</p> <p>7、投资标的的风险</p> <p>.....</p> <p>(7) 国债期货的投资风险</p> <p>.....</p> <p>④第三方风险</p> <p>A. 对手方风险</p> <p>管理人运用集合计划资产投资于期货合约，会尽力选择资信状况优良、风险控制能力强的经纪商，但不能杜绝因所选择的经纪商在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致集合计划资产遭受损失。</p> <p>.....</p> <p>(12) 投资香港互认基金的特有风险</p> <p>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</p>

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。

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。如果相关政策发生变化，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、

	<p>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。</p>
<p><b>13、业绩报酬计提基准的风险</b></p> <p>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。</p>	<p><b>13、业绩报酬计提的风险</b></p> <p>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。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。</p>

以上变更内容《申港证券梓金3号集合资产管理计划说明书》、《申港证券梓金3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《申港证券梓金3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8月15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8月15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8月15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



## 申港证券梓金3号集合资产管理计划

### 合同变更征询的回函

请投资者根据《关于申港证券梓金3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（四）》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。

申港证券梓金3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	



申港证券  
SHANGHAI  
SECURITIES  
&  
FINANCIAL  
TRADING  
LIMITED

