

关于中信建投可转债 1 号集合资产管理计划合同、说明书第一次变更的公告

中信建投可转债 1 号集合资产管理计划已于 2022 年 11 月 24 日成立。我公司经与托管人中国农业银行股份有限公司北京市分行协商一致，拟对中信建投可转债 1 号集合资产管理计划的合同、说明书进行变更。变更具体内容详见本公告附件《中信建投可转债 1 号集合资产管理计划合同及说明书变更对照表》。

管理人本次公告即向投资者征询意见，敬请投资者关注。投资者须在 2025 年 12 月 15 日（含）前回复意见。投资者不同意变更的，应在公告指定的临时开放期（2025 年 12 月 11 日至 2025 年 12 月 15 日）提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见的，视为投资者同意合同变更。

本次变更将于 2025 年 12 月 16 日开始生效，自生效日起该公告内容即成为合同的组成部分。

中信建投证券股份有限公司

2025 年 12 月 10 日

附件：中信建投可转债 1 号集合资产管理计划合同及说明书变更对照表

本文所述《合同》指《中信建投可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同》；
《说明书》指《中信建投可转债 1 号集合资产管理计划说明书》

变更内容如下：

《合同》部分：

原合同条款	变更后条款
五、资产管理计划的基本情况	五、资产管理计划的基本情况
<p>（四）投资相关</p> <p>1、投资目标</p> <p>本集合计划主要投向可转债、可交换公司债券等资产，投资目标为追求长周期超越中证转债指数的投资回报，产品的波动性介于股票类产品和纯债类产品之间。</p>	<p>（四）投资相关</p> <p>1、投资目标</p> <p>本集合计划在严格控制投资组合风险的前提下，力求实现资产的长期稳定增值。</p>
五、资产管理计划的基本情况	五、资产管理计划的基本情况
<p>（四）投资相关</p> <p>3、投资比例</p> <p>（1）固定收益类资产的投资比例为总资产的 80%-100%；其中，可转债及可交换公司债券合计投资比例不低于净资产的 40%。</p>	<p>（四）投资相关</p> <p>3、投资比例</p> <p>（1）固定收益类资产的投资比例为总资产的 80%-100%。</p>
八、资产管理计划的参与、退出与转让	八、资产管理计划的参与、退出与转让
<p>（二）参与和退出的办理时间</p> <p>1、本集合计划存续期内除开放期外为封闭期，封闭期内不办理集合计划的参与和退出业务。本集合计划自成立之日起每周一、周二和周三开放（如遇非工作日不开放、不顺延）。开放期内投资者可以根据合同约定、管理人公告及销售机构政策办理参与和退出业务。在不改变</p>	<p>（二）参与和退出的办理时间</p> <p>1、本集合计划存续期内除开放期外为封闭期，封闭期内不办理集合计划的参与和退出业务。本集合计划自成立之日起每周一、周二和周四开放（如遇非工作日于本周内顺延，顺延后每周开放不超过三天）。开放期内投资者可以根据合同约定、管理人公告及销售机构政策办理参与和退出业务。在不改变产品开放频率的情况下，管</p>

<p>产品开放频率的情况下，管理人有权公告调整具体开放日期，具体开放日期以管理人公告为准。</p> <p>投资者每笔份额持有时间不得少于360个自然日。对于投资者不符合本合同约定的赎回申请，管理人不予接受。</p>	<p>理人有权公告调整具体开放日期，具体开放日期以管理人公告为准。</p>
<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p>	<p>八、资产管理计划的参与、退出与转让</p>
<p>(六) 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与集合计划</p> <p>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。</p> <p>1、自有资金参与的条件：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，应符合《管理办法》、《运作规定》及中国证监会等监管机构的相关规定。</p> <p>2、自有资金的参与方式和金额：证券期货经营机构及其子公司可在每个开放期、集合计划募集期，选择参与本集合计划，参与金额不得低于资产管理计划最低参与金额。</p> <p>3、自有资金参与的比例：管理人自有资金参与本集合计划的份额不超过集合计划总份额的20%。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合计不得超过集合计划总份额的50%。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。因资产管理计划规模变动等客观因素导</p>	<p>(六) 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与集合计划</p> <p>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。</p> <p>1、自有资金参与的条件：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，应符合《管理办法》、《运作规定》及中国证监会等监管机构的相关规定。</p> <p>2、自有资金的参与方式和金额：证券期货经营机构及其子公司可在每个开放期、集合计划募集期，选择参与本集合计划，参与金额不得低于资产管理计划最低参与金额。</p> <p>3、自有资金参与的比例：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合计不得超过集合计划总份额的50%。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。因资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超限的，证券期货经营机构应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时完成调整。</p> <p>4、自有资金的收益分配：证券期货经营机</p>

<p>致前述比例被动超限的，证券期货经营机构应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时完成调整。</p> <p>4、自有资金的收益分配：证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额与投资者持有计划份额享有同等参与收益分配的权利。</p> <p>5、自有资金责任承担方式和金额：证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额与其他投资者持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任，不承担附加责任。</p> <p>6、自有资金退出的条件：每个开放日，证券期货经营机构及其子公司可以在开放期退出集合计划份额。</p> <p>7、投资者及托管人在此同意证券期货经营机构及其子公司自有资金可在集合计划募集期参与，管理人在成立后公告参与情况；集合计划存续期间，参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知投资者和托管人并征询意见，投资者不同意的应当在最近的开放日选择退出或不参与集合计划，未退出或选择参与的视为同意，托管人不同意的应当在最近的开放日前以书面形式向管理人反馈意见，未反馈意见即视为同意；在开放期内因投资者退出份额导致自</p>	<p>构及其子公司自有资金参与份额与投资者持有计划份额享有同等参与收益分配的权利。</p> <p>5、自有资金责任承担方式和金额：证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额与其他投资者持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任，不承担附加责任。</p> <p>6、自有资金退出的条件：每个开放日，证券期货经营机构及其子公司可以在开放期退出集合计划份额。</p> <p>7、投资者及托管人在此同意证券期货经营机构及其子公司自有资金可在集合计划募集期参与，管理人在成立后公告参与情况；集合计划存续期间，参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知投资者和托管人并征询意见，投资者不同意的应当在最近的开放日选择退出或不参与集合计划，未退出或选择参与的视为同意，托管人不同意的应当在最近的开放日前以书面形式向管理人反馈意见，未反馈意见即视为同意；在开放期内因投资者退出份额导致自有资金参与比例“被动超限”的（即证券期货经营机构及其子公司自有资金合计超过集合计划总份额的 50%），应及时调整，无需提前五个工作日告知投资者和托管人并取得其同意，但需事后及时告知。证券期货经营机构自有资金参与本集合计划的，持有期限不得低于 6 个月。</p> <p>8、为应对巨额退出，解决流动性风险，或</p>
---	--

<p>有资金参与比例“被动超限”的（即管理人自有资金超过集合计划总份额的 20%或证券期货经营机构及其子公司自有资金合计超过集合计划总份额的 50%），应及时调整，无需提前五个工作日告知投资者和托管人并取得其同意，但需事后及时告知。证券期货经营机构自有资金参与本集合计划的，持有期限不得低于 6 个月。</p> <p>8、为应对巨额退出，解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，但需事后及时告知投资者和托管人。</p> <p>9、风险揭示：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并不代表管理人对本集合计划的风险和收益水平作出任何形式的判断。证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额与其他投资者持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任，并不对同类份额本金或收益提供任何形式的保障。</p> <p>本节证券期货经营机构是指管理人或其母公司（若为证券期货经营机构的）。</p>	<p>者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，但需事后及时告知投资者和托管人。</p> <p>9、风险揭示：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并不代表管理人对本集合计划的风险和收益水平作出任何形式的判断。证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额与其他投资者持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任，并不对同类份额本金或收益提供任何形式的保障。</p> <p>本节证券期货经营机构是指管理人或其母公司（若为证券期货经营机构的）。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资</p>	<p>十一、资产管理计划的投资</p>

<p>(一) 投资目标</p> <p>本集合计划主要投向可转债、可交换公司债券等资产，投资目标为追求长周期超越中证转债指数的投资回报，产品的波动性介于股票类产品和纯债类产品之间。</p>	<p>(一) 投资目标</p> <p>本集合计划在严格控制投资组合风险的前提下，力求实现资产的长期稳定增值。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资</p>	<p>十一、资产管理计划的投资</p>
<p>(二) 投资范围和主要投资方向</p> <p>2、投资比例</p> <p>(1) 固定收益类资产的投资比例为总资产的 80%-100%；其中，可转债及可交换公司债券合计投资比例不低于净资产的 40%。</p> <p>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导致资产管理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合同约定的投资比例的，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十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p> <p>投资者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及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发行的证券或者承销期内承销的证券，管理人在从事关联交易后，应及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露。从事重大关联交易的，应向中国证监会相关派出机构和证券投</p>	<p>(二) 投资范围和主要投资方向</p> <p>2、投资比例</p> <p>(1) 固定收益类资产的投资比例为总资产的 80%-100%。</p> <p>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导致资产管理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合同约定的投资比例的，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二十个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p>

资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。	
十一、资产管理计划的投资	十一、资产管理计划的投资
<p>（五）投资策略</p> <p>9、净值管理策略</p> <p>本计划设置止损线：0.90。</p> <p>任一交易日（T日）日终本产品每份额净值小于止损线时，管理人应及时对本产品持有的可转债和可交换公司债券执行卖出操作，直至可转债和可交债投资比例不高于本产品净资产的20%。当本计划每份额净值连续3个交易日不低于止损线时，上述限制自动取消。从本计划每份额净值第一次低于0.90止损线之日起至本计划终止日，本计划无需满足“可转债及可交换公司债券合计投资比例不低于净资产的40%”的约定。</p>	<p>（五）投资策略</p> <p>删去：“9、净值管理策略</p> <p>本计划设置止损线：0.90。</p> <p>任一交易日（T日）日终本产品每份额净值小于止损线时，管理人应及时对本产品持有的可转债和可交换公司债券执行卖出操作，直至可转债和可交债投资比例不高于本产品净资产的20%。当本计划每份额净值连续3个交易日不低于止损线时，上述限制自动取消。从本计划每份额净值第一次低于0.90止损线之日起至本计划终止日，本计划无需满足“可转债及可交换公司债券合计投资比例不低于净资产的40%”的约定。”</p>
十四、利益冲突及关联交易	十四、利益冲突及关联交易
<p>（一）资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形，包括但不限于：</p> <p>1、资产管理计划聘请第三方服务机构为管理人关联方（如有）；</p> <p>2、FOF产品投资于管理人及管理人关联方所设立的资产管理产品（如涉及）；</p> <p>3、投资于管理人及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发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>4、资产管理计划运作过程从事重大关联交易；</p>	<p>（一）资产管理计划存在的或者可能存在利益冲突的情形</p> <p>1、资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形，包括但不限于：</p> <p>（1）资产管理计划聘请第三方服务机构为管理人关联方（如有）；</p> <p>（2）资产管理计划运作过程从事关联交易；</p> <p>（3）资产管理计划投资于管理人发行设立</p>

<p>5、其他可能存在利益冲突的情形。</p> <p>（二）出现上述利益冲突情形的，需要遵循投资者利益优先的原则、防范利益冲突，在符合法律法规和监管政策的前提下，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行，并履行信息披露义务。当出现利益冲突情形时及时披露，信息披露方式为管理人公告，公告内容为利益冲突的具体情况。</p> <p>（三）管理人在关联交易事后，应及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露。管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的（不包括前述第（一）条第 1-3 项情形），应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。</p>	<p>或管理人做投资顾问的资产管理产品；</p> <p>（4）其他可能存在利益冲突的情形。</p> <p>2、利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率</p> <p>出现上述利益冲突情形的，需要遵循投资者利益优先的原则处理利益冲突，在符合法律法规和监管政策的前提下，按照市场公平合理价格执行，并履行信息披露义务。当出现利益冲突情形，管理人应当视具体利益冲突情形选择在定期报告或临时公告中进行披露，公告内容为利益冲突的具体情况。</p> <p>（二）资产管理计划从事关联交易的情形</p> <p>资产管理计划从事关联交易的情形包括：</p> <p>1、资产管理产品买卖管理人、托管人、产品投资顾问（如有）及前述主体的控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券。2、资产管理产品开展信用衍生品交易，信用衍生品创设机构或挂钩标的发行人为托管人、投资顾问（如有）及前述主体或管理人的控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司。3、资产管理产品参与管理人担任财务顾问的公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）战略配售业务。4、资产管理产品开展的以管理人控股股东、实际控制人及与其有重大利害关系的公司等关联方（资产管理计划交易对手不能为中信建投</p>
--	--

	<p>证券及中信建投证券子公司）为交易对手的债券交易（交易所集中竞价交易除外）、正回购交易（交易所集中竞价交易除外）、股票大宗交易、结构化票据交易、场外衍生品交易及标准化信用衍生品交易。5、资产管理产品开展的以资产管理产品托管人及其控股股东、实际控制人及与其有重大利害关系的公司等关联方为交易对手的债券交易（交易所集中竞价交易除外）、正回购交易（交易所集中竞价交易除外）、股票大宗交易、结构化票据交易、场外衍生品交易及标准化信用衍生品交易。6、资产管理产品开展转融通证券出借业务，最终借入方为管理人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司。7、资产管理产品买卖管理人、托管人及前述主体的控股股东、实际控制人或者与前述主体有重大利害关系的公司担任管理人的资产管理产品（含公募基金及公募 REITs）。8、资产管理产品接受资产管理产品关联方发行的证券作为质押券的逆回购交易，包括银行间市场逆回购以及交易所市场协议逆回购等可以明确交易对手的逆回购交易等关联交易情形以及法律法规、基金业协会自律规则规定的其他关联交易情形。</p> <p>1、关联方范围</p> <p>资产管理计划的关联方包括资产管理计划管理人、托管人及其控股股东、实际控制人及与其有重大利害关系的公司，资产管</p>
--	--

	<p>理计划投资顾问（若有）及其控股股东、实际控制人及与其有重大利害关系的公司，法律法规、基金业协会自律规则规定的其他关联方。投资者可以通过管理人、托管人官网查询管理人、托管人的公司年度报告披露的关联方。</p> <p>2、关联交易的内控机制</p> <p>管理人制定了关联交易管理制度，对关联交易的审批、定价、信息披露等事项进行了规范。在关联交易审批方面，资产管理计划从事关联交易的，投资经理需根据公司制度及对应关联交易类型履行相应的内部程序，其中重大关联交易投资经理需单独履行重大关联交易审批程序，管理人根据投资品种及投资比例等适用分级审批机制，分级审批包括投资部门负责人审批、业务线负责人审批、资产管理部负责人审批、私募资产管理业务投资决策委员会审批。</p> <p>3、资产管理计划从事重大关联交易</p> <p>重大关联交易的情形包括：</p> <p>（1）资产管理计划买卖管理人、托管人、投资顾问（如有）及前述主体的控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；</p> <p>（2）资产管理计划开展信用衍生品交易，信用衍生品创设机构或挂钩标的发行人为托管人、产品投资顾问（如有）及前述主体或管理人的控股股东、实际控制人或者</p>
--	---

	<p>与其有重大利害关系的公司；</p> <p>（3）资产管理产品参与管理人担任财务顾问的公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）战略配售业务；</p> <p>（4）资产管理计划开展的以管理人的控股股东、实际控制人及与其有重大利害关系的公司等关联方为交易对手（资产管理计划交易对手不能为中信建投证券及中信建投证券子公司）的债券交易（交易所集中竞价交易除外）、正回购交易（交易所集中竞价交易除外）、股票大宗交易、结构化票据交易、场外衍生品交易及标准化信用衍生品交易，且单笔交易金额达到或超过资产管理计划净资产的【15%】的；</p> <p>（5）资产管理计划开展的以资产管理计划托管人及其控股股东、实际控制人及与其有重大利害关系的公司等关联方为交易对手的债券交易（交易所集中竞价交易除外）、正回购交易（交易所集中竞价交易除外）交易、股票大宗交易、结构化票据交易、场外衍生品交易及标准化信用衍生品交易，且单笔交易金额达到或超过资产管理计划净资产的【15%】的；</p> <p>（6）资产管理产品开展转融通证券出借业务，最终借入方为管理人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司，且单笔交易金额达到或超过资产管理计划净资产的【15%】的；</p> <p>（7）法律法规、基金业协会自律规则规定</p>
--	---

	<p>的其他重大关联交易。</p> <p>资产管理计划从事重大关联交易的，管理人应事先就该笔重大关联交易取得投资者同意。资产管理计划从事重大关联交易前，管理人应通过公告、邮件、电话、短信一种或多种方式事先向投资者征求意见，若投资者不同意该笔重大关联交易，投资者应按照管理人通知要求的方式在通知限定日期内按指定的形式向管理人明确反馈不同意的意见，如投资者未按照管理人通知的方式明确反馈不同意的意见或在管理人通知限定期限内未回复意见，均视同投资者同意该笔重大关联交易。重大关联交易后管理人应及时告知托管人。</p> <p>4、资产管理计划从事一般关联交易</p> <p>一般关联交易的情形包括：</p> <p>（1）资产管理产品买卖管理人、托管人及前述主体的控股股东、实际控制人或者与前述主体有重大利害关系的公司担任管理人的资产管理产品（含公募基金及公募REITs）；</p> <p>（2）资产管理计划接受资产管理计划关联方发行的证券作为质押券的逆回购交易，包括银行间市场逆回购，以及交易所市场协议逆回购等可以明确交易对手的逆回购交易；</p> <p>（3）资产管理计划开展的以管理人的控股股东、实际控制人及与其有重大利害关系的公司等关联方为交易对手（不能为中信</p>
--	---

	<p>建投证券及中信建投证券子公司)的债券交易(交易所集中竞价交易除外)、正回购交易(交易所集中竞价交易除外)、股票大宗交易、结构化票据交易、场外衍生品交易及标准化信用衍生品交易,且单笔交易金额低于资产管理计划净资产的【15%】的;</p> <p>(4)资产管理计划开展的以托管人及其控股股东、实际控制人及与其有重大利害关系的公司等关联方为交易对手的债券交易(交易所集中竞价交易除外)、正回购交易(交易所集中竞价交易除外)、股票大宗交易、结构化票据交易、场外衍生品交易及标准化信用衍生品交易,且单笔交易金额低于资产管理计划净资产的【15%】的;</p> <p>(5)资产管理计划开展转融通出借业务,最终借入方为管理人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司,且单笔交易金额低于资产管理计划净资产的【15%】的;</p> <p>(6)法律法规、自律规则及资产管理合同规定的除重大关联交易以外的其他关联交易。</p> <p>投资者在此同意并授权管理人可以在本资产管理计划下从事一般关联交易,投资者参与本资产管理计划即代表投资者已充分理解并同意管理人在本资产管理计划下从事一般关联交易,管理人在本资产管理计划运作过程中从事一般关联交易时,视作</p>
--	--

	<p>已事先统一取得投资者同意，不再逐笔征求投资者意见。</p> <p>5、资产管理计划从事关联交易的，管理人将根据资产管理计划发生的关联交易情形选择在定期报告或临时公告中对关联交易进行披露，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>6、因管理人对关联交易管理制度进行修订，导致修订后关联交易管理制度中资产管理计划关联方、关联交易涉及范围、重大关联交易标准、一般关联交易标准与本合同约定不一致的，管理人通过在管理人官网公告告知投资者和托管人相关事宜，修改后的关联交易管理标准自公告之日起施行；中国证监会及相关派出机构、基金业协会对资产管理计划关联方、关联交易涉及范围、重大关联交易标准和一般关联交易标准的规定或要求与本合同或管理人官网公告的关联交易内控标准不一致的，按中国证监会及相关派出机构、基金业协会最新规定或要求执行。上述调整事项无需另行征求托管人、投资者意见。</p> <p>（三）管理人在关联交易事后，应及时、全面、客观地向投资者和托管人进行披露。管理人运用受托管理资产从事关联交易的，应事先取得投资者同意（投资者参与本资产管理计划即代表管理人已就本资产管理计划进行一般关联交易事先取得投资者同意，后续管理人在本资产管理计划下进行一般关联交易时，视作已事先统一取得投资者同意，不再逐笔征求投资者意见），事后告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p>
--	---

<p>二十、资产管理计划的费用与税收</p> <p>(二)费率、计提标准、计提方式与支付方式</p> <p>1、管理费</p> <p>本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提。管理费的年费率为0.8%。计算方法如下：</p> $H=E \times \text{年管理费率} \div 365$ <p>H为每日应计提的集合计划管理费</p> <p>E为前一日集合计划资产净值</p> <p>集合计划管理费每日计提，逐日累计至每季度季末，按季度支付。管理人于每个季度结束后的次月首日起（含）15个工作日内向托管人发送集合计划管理费划付指令，托管人复核后于5个工作日内从集合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，支付日期自动顺延。</p>	<p>二十、资产管理计划的费用与税收</p> <p>(二)费率、计提标准、计提方式与支付方式</p> <p>1、管理费</p> <p>本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提。管理费的年费率为0.3%。计算方法如下：</p> $H=E \times \text{年管理费率} \div 365$ <p>H为每日应计提的集合计划管理费</p> <p>E为前一日集合计划资产净值</p> <p>集合计划管理费每日计提，逐日累计至每季度季末，按季度支付。管理人于每个季度结束后的次月首日起（含）15个工作日内向托管人发送集合计划管理费划付指令，托管人复核后于5个工作日内从集合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，支付日期自动顺延。</p>
<p>二十、资产管理计划的费用与税收</p> <p>(四)管理人的业绩报酬</p> <p>集合计划在分红时、投资者赎回退出时和集合计划终止清算时进行业绩报酬的计提。</p> <p>业绩报酬从集合计划份额持有人赎回资金、分红资金或清算资产中扣除，当集合计划份额期间年化收益率超过业绩报酬计提基准时，管理人可以计提业绩报酬。本集合计划对期间年化收益率在6%到8%（含）的部分按照40%的比例收取业绩报酬，对期间年化收益率超过8%的部</p>	<p>二十、资产管理计划的费用与税收</p> <p>(四)管理人的业绩报酬</p> <p>集合计划在分红时、投资者赎回退出时和集合计划终止清算时进行业绩报酬的计提。</p> <p>业绩报酬从集合计划份额持有人赎回资金、分红资金或清算资产中扣除，当集合计划份额期间年化收益率超过业绩报酬计提基准时，管理人可以计提业绩报酬。本集合计划对期间年化收益率在6%到8%（含）的部分按照10%的比例收取业绩报酬，对期间年化收益率超过8%的部分按照20%的比例收取业绩报酬。</p>

<p>分按照 60%的比例收取业绩报酬。</p> <p>1、业绩报酬的计提原则</p> <p>在集合计划份额持有人赎回和本集合计划终止时，业绩报酬分别按集合计划份额持有人赎回份额和集合计划终止时持有份额计算。如赎回份额为一笔参与份额的一部分，则将该部分赎回份额直接进行核算；若持有人在赎回前多次参与，则赎回时对份额采取“先进先出”的原则进行计算。当集合计划分红时，单笔业绩报酬计提金额不超过分红金额。当集合计划终止清算时，所有投资者视同全部赎回，都按规定计提业绩报酬。</p> <p>2、业绩报酬计算公式</p> $PF_i = \sum_{j=1}^n PF_{ij}$ $PF_{ij} = \begin{cases} 0, & \text{当 } R \leq 6\% \\ [R - 6\%] \times 40\% \times \frac{HWM'_{ij} \times T_{ij}}{365} \times F_{ij}, & \text{当 } 6\% < R \leq 8\% \\ [8\% - 6\%] \times 40\% \times \frac{HWM'_{ij} \times T_{ij}}{365} \times F_{ij} + [R - 8\%] \times 60\% \times \frac{HWM'_{ij} \times T_{ij}}{365} \times F_{ij}, & \text{当 } 8\% < R \end{cases}$	<p>1、业绩报酬的计提原则</p> <p>在集合计划份额持有人赎回和本集合计划终止时，业绩报酬分别按集合计划份额持有人赎回份额和集合计划终止时持有份额计算。如赎回份额为一笔参与份额的一部分，则将该部分赎回份额直接进行核算；若持有人在赎回前多次参与，则赎回时对份额采取“先进先出”的原则进行计算。当集合计划分红时，单笔业绩报酬计提金额不超过分红金额。当集合计划终止清算时，所有投资者视同全部赎回，都按规定计提业绩报酬。</p> <p>2、业绩报酬计算公式</p> $PF_i = \sum_{j=1}^n PF_{ij}$ <p>① $PF_{ij} = 0$，当 $R \leq 6\%$</p> <p>② $PF_{ij} =$</p> $[R - 6\%] \times 10\% \times \frac{HWM'_{ij} \times T_{ij}}{365} \times F_{ij},$ <p>当 $6\% < R \leq 8\%$</p> <p>③ $PF_{ij} =$</p> $[8\% - 6\%] \times 10\% \times \frac{HWM'_{ij} \times T_{ij}}{365} \times F_{ij} +$ $[R - 8\%] \times 20\% \times \frac{HWM'_{ij} \times T_{ij}}{365} \times F_{ij},$ <p>当 $8\% < R$</p>
<p>二十三、风险揭示</p>	<p>二十三、风险揭示</p>
	<p>增加：</p> <p>1、从事重大关联交易、一般关联交易所涉</p>

	<p>风险</p> <p>一般关联交易风险：投资者参与本集合计划即代表投资者已同意管理人在本资产管理计划下进行本合同约定的一般关联交易，管理人在本资产管理计划运作过程中进行一般关联交易时，视作已取得投资者同意，不再逐笔征求投资者意见。虽然管理人制定了关联交易管理制度，通过内控机制对关联交易进行了规范，资产管理人也将积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因资产管理人运用受托财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响投资者的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。资产管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响受托财产的投资收益。</p> <p>重大关联交易风险：资产管理计划从事重大关联交易的，管理人将事先就该笔关联交易取得投资者同意。资产管理计划从事重大关联交易前，管理人将通过公告、邮件、电话、短信一种或多种方式事先向投资者征求意见，全体投资者同意后资产管理计划可以进行该笔重大关联交易，虽然管理人制定了关联交易管理制度，通过内</p>
--	---

	<p>控机制对关联交易进行了规范，资产管理人也将积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因资产管理人运用受托财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响投资者的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。资产管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响受托财产的投资收益。在管理人就资产管理计划从事重大关联交易征求投资者意见时，若全体投资者中有部分投资者明确回复不同意该笔重大关联交易，其他同意该笔重大关联交易的投资者将面临由于部分投资者不同意、资产管理计划无法进行该笔重大关联交易的风险。</p> <p>关联交易标准变更风险：若中国证监会及相关派出机构、基金业协会、管理人对资产管理计划的关联交易相关标准发生调整的，投资者可能面临资产管理计划关联方、关联交易涉及范围、一般关联交易、重大关联交易标准等发生变更的风险。管理人将按中国证监会及相关派出机构、基金业协会最新规定或管理人官网公告的关联交易相关标准执行，上述调整事项无需另行征求托管人、投资者意见。可能存在投资</p>
--	---

	<p>者未及时查阅相关信息导致投资者理解的关联交易事项与本资产管理计划实际管理标准不一致的风险。</p> <p>2、管理人自有资金参与风险：管理人自有资金可能在募集期参与、在存续期内参与或退出本计划。投资者签署本合同即为同意管理人自有资金可在募集期参与；存续期管理人自有资金参与、退出的，提前五个工作日告知并征询投资者意见；投资者不同意的应当在最近的开放日选择退出或不参与集合计划，未退出或选择参与的视为同意；在开放期内因投资者退出份额导致管理人自有资金参与比例“被动超限”的，管理人无需另行征询投资者意见，将在调整后进行披露。管理人自有资金参与份额与其他投资者持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任，并不对同类份额本金或收益提供任何形式的保障。投资者知悉并接受管理人自有资金参与退出的相关风险。</p>
--	--

《说明书》部分：

《中信建投可转债 1 号集合资产管理计划说明书》参照合同变更进行相应变更。