

## 关于申港证券优享 10 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

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“申港证券优享 10 号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）于 2023 年 12 月 28 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《申港证券优享 10 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。”

现向投资者征询变更意见，具体如下：

**一、变更对照明细表**

**1、原合同第一章“前言”中约定：**

原表述：	现表述：
<p>为规范申港证券优享10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《申港证券优享10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益。</p>	<p>为规范申港证券优享10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《申港证券优享10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。</p>

**2、原合同第三章“承诺与声明”中约定：**

原表述：	现表述：

<p>(三) 投资者声明</p> <p>2、财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资集合计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。</p> <p>投资者承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构反洗钱规定》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《涉及恐怖活动资产冻结管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。投资者承诺其不属于中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁名单内的企业或个人，不位于被中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁的国家和地区。</p>	<p>(三) 投资者声明</p> <p>2、财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资集合计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。</p> <p>投资者承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构客户尽职调查和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构客户受益所有人识别管理办法》、《金融机构受益所有人差异报告工作指引》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺投资的资金来源和去向不涉及洗钱、恐怖融资和逃税等行为；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，提供真实有效的业务性质与股权或者控制权结构、受益所有人信息等资料；承诺积极履行反洗钱职责，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。投资者承诺其不属于中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁名单内的企业或个人，不位于被中国有权机关、联合国、欧盟或美国制裁的国家和地区。</p>
--	--

3、原合同中第四章“当事人及权利义务”中约定：

原表述：	现表述：
管理人	管理人

<p>联系人：雷伯特 联系电话：（021）20639470</p> <p>托管人 联系人：文茂杰 联系电话：15208675658</p>	<p>联系人：李茵楠 联系电话：（021）20639471</p> <p>托管人 联系人：陈益希 联系电话：021-52629999</p>
<p>（二）管理人的权利和义务</p> <p>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；</p>	<p>（二）管理人的权利和义务</p> <p>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）；</p>

#### 4、原合同中第五章“集合计划的基本情况”中约定：

原表述：	现表述：
<p>（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</p> <p>2、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（含结构性存款等）、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</p>	<p>（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</p> <p>2、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（含结构性存款等）、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</p>

<p>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)等；</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>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)等；</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>
---	---

**5、原合同第十章“集合计划份额的登记”中约定：**

原表述：	现表述：
<p>(二) 本集合计划的登记业务由管理人负责根据相关业务规则办理。</p>	<p>(二) 本集合计划的登记业务由管理人负责根据相关业务规则办理。管理人或其指定机构应及时向托管人提供注册登记信息，托管人据此进行账务处理。由于管理人或其指定机构提供信息不及时、不完整或不准确而导致的后果，由过错方承担责任。</p>

**6、原合同第十一章“集合计划的投资”中约定：**

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>(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（含结构性存款等）、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）等；</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>(1) 银行存款（含结构性存款等）、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）等；</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>2、决策程序</p> <p>管理人执行本集合计划的投资职能。管理人的投资决策程序简述如下：相关资产管理业务投资决策委员会负责审议和确定本集合计划投资范围和投资策略；投资经理负责投资品种选择及投资组合建立；集中交易室</p>	<p>(五) 投资策略</p> <p>2、决策程序</p> <p>管理人执行本集合计划的投资职能。管理人的投资决策程序简述如下：资产管理业务投资决策委员会审议决策产品投资策略及投资授权等事宜；投资经理负责投资品种选择及投资组合建立；集中交易室执行交易；相关履行合</p>

<p>执行交易；相关履行合规风控职能部门独立负责合规管理、风险管理事宜。</p> <p>4、投资策略</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>规风控职能部门独立负责合规管理、风险管理事宜。</p> <p>4、投资策略</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>
--	--

**7、原合同第十四章“利益冲突及关联交易”中约定：**

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>管理人从事的重大关联交易包括但不限于：</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> <p>2、关联交易程序</p> <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</p>	<p>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> <p>2、关联交易程序</p> <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</p>
--	---

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。

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

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，由违约方承担相关责任。

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>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>	
--	--

**8、原合同第十五章“投资经理的指定与变更”中约定：**

原表述：	现表述：
<p>(一) 投资经理的指定</p> <p>本集合计划投资经理由管理人负责指定。</p> <p>管理人指定本集合计划的投资经理为：冯洁莹、张梦梦，投资经理简介如下：</p> <p>冯洁莹女士，清华大学经济学学士，不存在兼职情况。曾从事海外衍生品的投资交易，以及国内固收类证券及衍生品策略的研究和交易，先后任职于交易、研究、投资等岗位，从业时间超过10年，在产品设计和投资交易领域具有丰富经验。具备基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>张梦梦女士，上海财经大学工商管理硕士，不存在兼职情况。9年证券从业经历，曾就职于德邦基金、万家共赢资管，历任申港证券资管固收部投资助理、投资顾问，具有丰富的固定收益类资产信用研究经验，擅长信用债、ABS等投资品种的精选挖掘。具备基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完</p>	<p>(一) 投资经理的指定</p> <p>本集合计划投资经理由管理人负责指定。</p> <p>管理人指定本集合计划的投资经理为：冯洁莹、张梦梦、杨超，投资经理简介如下：</p> <p>冯洁莹女士，清华大学经济学学士，不存在兼职情况。曾从事海外衍生品的投资交易，以及国内固收类证券及衍生品策略的研究和交易，先后任职于交易、研究、投资等岗位，从业时间超过10年，在产品设计和投资交易领域具有丰富经验。具备基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>张梦梦女士，上海财经大学工商管理硕士，不存在兼职情况。9年证券从业经历，曾就职于德邦基金、万家共赢资管，历任申港证券资管固收部投资助理、投资顾问，具有丰富的固定收益类资产信用研究经验，擅长信用债、ABS等投资品种的精选挖掘。具备基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政</p>

<p>成注册，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p>	<p>杨超，西南财经大学金融数学硕士，不存在兼职情况。多年量化投资策略开发和投资管理经验，曾任职于上海淳杨资产管理公司、国金涌富资产管理公司和西部利得基金管理公司，从事量化研究和投资管理的工作，擅长以量化思维提供资产配置和基金筛选的解决方案。具备基金从业资格并在中国证券投资基金业协会完成注册，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p>
---------------------------------------	---

**9、原合同第十六章“集合计划的财产”中约定：**

<p><b>新增表述（合同序号同步调整）：</b></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按照规定设立。</p>

**10、原合同第十八章“越权交易的界定”中约定：**

原表述：	现表述：
<p>（三）托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、主要投资方向及投资范围</p> <p>（1）银行存款（含结构性存款等）、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</p>	<p>（三）托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、主要投资方向及投资范围</p> <p>（1）银行存款（含结构性存款等）、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</p>

<p>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)等；</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>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)等；</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><b>新增表述：</b></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，托管人不承担责任。</p>	

11、原合同第十九章“交易及交收清算安排”中约定：

原表述：	现表述：
<p>(五) 投资银行存款的特别约定</p> <p>1、本集合计划投资银行存款前，应与存款银行签署投资银行定期存款协议。</p>	<p>(五) 投资银行存款的特别约定</p> <p>1、本集合计划投资银行存款前，应与存款银行签署投资银行存款协议。</p>
<p>(八) 资金前端控制的额度设置及责任承担</p> <p>为有效控制交易结算风险，投资者及管理人知悉并授权托管人向中国证券登记结算有限责任公司报送融资主体相关信息及用于</p>	<p>(八) 资金前端控制的额度设置及责任承担</p> <p>为有效控制交易结算风险，投资者及管理人知悉并授权托管人向中国证券登记结算有限责任公司报送用于交易资金前端控制的相关数</p>

<p>交易资金前端控制的相关数据信息。托管人依据与管理人核对一致的资产管理计划财产估值信息向中国证券登记结算有限责任公司报送上述数据信息。</p>	<p>据信息。托管人依据与管理人核对一致的资产管理计划财产估值信息向中国证券登记结算有限责任公司报送上述数据信息。</p>
---	---

**12、原合同第二十章“集合计划财产的估值和会计核算”中约定：**

原表述：	现表述：
<p>(三) 估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的债券估值方法：</p> <p>(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转债、可交债除外），采用第三方估值机构提供的价格确定公允价值。</p> <p>14、根据相关法律法规，计划资产净值计算和会计核算义务由管理人承担，本集合计划的会计责任方由管理人承担，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照管理人对计划资产净值的计算结果对外予以公布，但托管人有权向监管部门报告。</p>	<p>(三) 估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的债券估值方法：</p> <p>(1) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（上市交易的公开发行可转债、可交债除外），采用第三方估值机构提供的价格确定公允价值。</p> <p>14、根据相关法律法规，计划资产净值计算和会计核算义务由管理人承担，本集合计划的会计责任方由管理人承担，托管人根据法律法规以及本协议约定复核管理人提供的本产品会计核算结果，如双方会计核算结果不一致的、以及出现与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意見，按照管理人对计划资产净值的计算结果对外予以公布，由此造成的后果托管人不承担责任，但托管人有权向监管部门报告。</p>
新增表述：	
<p>(三) 估值方法</p> <p>本集合计划的会计核算应符合《企业会计准则》《资产管理产品相关会计处理规定》等法律法规以及本合同的约定。管理人应当向托管人提供无法从第三方渠道获取的必要会计核算依据。如管理人未及时提供会计核算依据或者提供的会计核算依据不准确的，由此造成的</p>	

后果由过错方承担责任。

13、原合同第二十一章“集合计划的费用与税收”中约定：

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>3、证券交易费用</p> <p>本集合计划应按规定比例在发生投资交易时单独计提并分别支付经手费、证管费、过户费、印花税和证券结算风险基金等，作为各自交易成本直接扣除。交易佣金的费率由管理人本着保护投资者利益的原则，按照法律法规的规定确定。</p> <p>6、与本集合计划存续期相关的费用</p> <p>(1) 银行结算费用、银行账户维护费，在每月费用支付时一次计入集合计划费用。</p> <p>(2) 银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间按日平均摊销或一次性计入费用；如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。</p> <p>(3) 开户费、银行间交易费用、转托管费及份额登记机构收取的相关费用在发生时一次计入集合计划费用。</p> <p>(4) 集合计划成立后的信息披露费用、会计师费、律师费和银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由管理人本着保护投资者利益的原则，按照公允的市场价格</p>	<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>3、证券交易费用</p> <p>(1)本集合计划应按规定比例在发生投资交易时单独计提并分别支付经手费、证管费、过户费、印花税和证券结算风险基金等，作为各自交易成本直接扣除。交易佣金的费率由管理人本着保护投资者利益的原则，按照法律法规的规定确定。</p> <p>(2) 银行间交易费用、转托管费及登记机构收取的相关费用在发生时一次计入计划费用。</p> <p>(3) 银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间按日平均摊销或一次性计入费用；如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次计入计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。</p> <p>6、银行费用（如有）：银行结算费用、银行账户维护费，在费用支付时一次计入集合计划费用。</p> <p>7、集合计划成立后的信息披露费用、会计师费、律师费以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由管理人本着保护投资者</p>

确定，法律法规另有规定时从其规定，并由托管人根据法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。如上述费用能够对应到相应会计期间，可在该会计期间内按直线法摊销。

(5) 与集合计划存续有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。

(6) 按照国家有关规定可以列入集合计划财产的其他费用。

7、上述第3至6项费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额从集合计划资产中支付。

8、银行间费用（如有）：管理人应根据银行间费用相关法律法规及本合同约定，将账户开户、交易佣金、交易结算管理等各项费用列入或摊入当期资产管理计划财产运作费用，经管理人和托管人核对无误后，由管理人授权或通过划款指令进行划付。管理人收到托管人通知后一个月内未授权划付的，由托管人从资产管理计划财产中扣划，无须管理人出具指令。投资者和管理人在此申明已了解资产管理计划财产投资会产生的银行间费用，并确保账户中有足够资金用于银行间费用的支付，如因托管账户中的资金不足以支付银行间费用影响到指令的执行，托管人不承担由此产生的损失和责任。如资产管理计划财产未起始运作，由管理

利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，并由托管人根据法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。如上述费用能够对应到相应会计期间，可在该会计期间内按直线法摊销。

8、与集合计划存续有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销。

9、按照国家有关规定可以列入集合计划财产的其他费用。

10、上述第3至9项费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额从集合计划资产中支付。

11、管理人应根据相关法律法规及本合同约定，将账户开户、交易结算管理等各项费用列入或摊入当期集合计划财产运作费用，经管理人和托管人核对无误后，由管理人授权后划付。投资者和管理人在此申明已了解集合计划财产投资会产生的费用，并确保账户中有足够资金用于费用的支付，如因托管账户中的资金不足以支付费用影响到指令的执行，托管人不承担由此产生的损失和责任，托管人不承担垫付费用义务。

<p>人在收到托管人的缴费通知后完成支付，托管人不承担垫付费用义务。</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；</p> <p>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>(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；</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><u>业绩报酬计提基准日为本集合计划分红除息日（如有）、投资者退出申请日和集合</u></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，若年化收益率 R 小于或等于 r1，则管理人不提取业绩报酬；若年化收益率 R 大于 r1 小于等于 r2，则管理人对超出部分按 20%的比例提取业绩报酬；若年化收益率 R 大于 r2，则管理人对超出部分累进提取业绩报酬，将会对低于收益率的区间分别计算并进行累加（具体公式见下文）。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：

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

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

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)
$R \leq r_1$	0%	0
$r_1 < R \leq r_2$	20%	$I = [(R - r_1) \times 20\%] \times A \times D$
$R > r_2$	60%	$I = [(R - r_2) \times 60\% + (r_2 - r_1) \times 20\%] \times A \times D$

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 为投资者每个业绩报酬计提基准周期的期初日的资产净值总额；

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

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（ $\Sigma I$ ）：

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

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。

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。特定情形下，该计算方式可能发生投资者总收益为负，管理人亦可提取业绩报酬的情况。

因涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核由管理人完成，托管人根据管理人的划款指令进行划款，托管人不复核业绩报酬的计算。因业绩报酬计算错误造成的后果由过错方承担责任。

### 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。

<p><b>3、业绩报酬支付</b></p> <p>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。</p> <p><b>4、业绩报酬计提基准确定依据及说明</b></p> <p>本集合计划设置的业绩报酬计提基准主要是管理人基于集合计划的投资组合，并考虑管理成本、合理利润等相关费用后确定。管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划资产本金不受损失，也不保证最低收益。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。</p>	
--	--

**14、原合同第二十二章“集合计划的收益分配”中约定：**

<p><b>新增表述：</b></p>
<p><b>（三）收益分配方案的确定与通知</b></p> <p>管理人应当及时、准确、完整地向托管人提供复核管理人收益分配方案所需的相关数据或材料，如因管理人未提供、未及时或未准确提供上述材料给托管人，导致托管人无法履行或无法按时履行相应复核职责的，由此造成的后果由管理人承担相应责任。</p>

**15、原合同第二十四章“风险揭示”中约定：**

<b>原表述：</b>	<b>现表述：</b>
<b>（二）一般风险揭示</b>	<b>（二）一般风险揭示</b>

<p>7、投资标的风险</p> <p>(7) 国债期货的投资风险</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>13、业绩报酬计提基准的风险</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>7、投资标的风险</p> <p>(7) 国债期货的投资风险</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>13、业绩报酬计提基准的风险</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。收益分配时计提业绩报酬的，集合计划可供分配利润为截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数，而每笔份额的业绩报酬主要取决于该笔份额的期间年化收益率【计算方式详见第二十一章第(三)节“管理人的业绩报酬”】，业绩报酬与可供分配利润及收益分配金额的计算基数并不一致。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</p>
---	--

	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。
--	--

新增表述 (合同序号同步调整):

(二) 一般风险揭示

7、投资标的风险

(13) 投资香港互认基金的特定风险

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。

16、原合同第二十七章“争议的处理”中约定:

原表述:	现表述:
管理人全称: 申港证券股份有限公司 2、电子邮箱送达地址: yangcheng@shgsec.com; zcgl@shgsec.com	管理人全称: 申港证券股份有限公司 2、电子邮箱送达地址: liyinnan@shgsec.com; zcgl@shgsec.com

## 17、原合同第二十八章“资产管理合同的效力”中约定：

原表述：	现表述：
资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人的，资产管理合同自投资者、管理人和托管人加盖公章（或合同专用章）以及各方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，资产管理合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章（或合同专用章）以及双方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立。	资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人的，资产管理合同自投资者、管理人和托管人加盖公章（或业务专用章）以及各方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，资产管理合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章（或业务专用章）以及双方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立。

以上变更内容《申港证券优享 10 号集合资产管理计划说明书》、《申港证券优享 10 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《申港证券优享 10 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 2026 年 6 月 12 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至 2026 年 6 月 12 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 2026 年 6 月 12 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。

**特别提醒：**

**2026 年 6 月 12 日：投资者提出的退出申请可不受锁定期限制。**

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：李茵楠

联系电话：021-20639471



## 申港证券优享 10 号集合资产管理计划

### 合同变更征询的回函

请投资者根据《关于申港证券优享 10 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》（编号：20260515-SGYX10-ZXH-01）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。

申港证券优享10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	

