

关于长江证券超越理财可转债集合资产管理计划 变更为长江聚利债券型证券投资基金及法律文件变更的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告[2018]39号）等法律法规的规定及中国证券监督管理委员会《关于准予长江证券超越理财可转债集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可[2021]3983号），长江证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“本公司”）作为长江证券超越理财可转债集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）的管理人，经与托管人交通银行股份有限公司协商一致，拟将长江证券超越理财可转债集合资产管理计划变更为长江聚利债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），并按照《长江证券超越理财可转债集合资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）、《长江证券超越理财可转债集合资产管理计划说明书》等法律文件的约定履行法律文件变更程序。

长江证券超越理财可转债集合资产管理计划变更为长江聚利债券型证券投资基金涉及法律文件全文变更，即由原长江证券超越理财可转债集合资产管理计划法律文件变更为长江聚利债券型证券投资基金的法律文件，包括《长江聚利债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《长江聚利债券型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）、《长江聚利债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）等，上述法律文件已同步在本公司网站（www.cjzcg1.com）披露，敬请投资者仔细阅读。

本次长江证券超越理财可转债集合资产管理计划变更为长江聚利债券型证券投资基金涉及的主要变更内容和具体流程说明如下：

一、主要变更

（一）变更产品名称

产品名称由“长江证券超越理财可转债集合资产管理计划”变更为“长江聚利债券型证券投资基金”。

（二）变更产品类型

产品类型由“集合资产管理计划”变更为“债券型证券投资基金”。

（三）增加基金份额类别设置

《基金合同》生效后，投资者继续持有的原集合计划份额自动转换为本基金A类基金份额。本基金增设C类基金份额，A、C两类基金份额的收费模式不同：在投资者申购基金时收取申购费、赎回时收取赎回费用且不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资者申购基金时不收取申购费、赎回时收取赎回费用，并从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。A类、C类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值，不同基金份额类别之间不得相互转换。

（四）调整申购相关条款

1、申购时间安排

长江证券超越理财可转债 集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金
存续期内，三个月封闭期满后每个交易日开放，委托人可在开放日申请参与本计划。	投资人在开放日办理基金份额的申购，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购时除外。基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理申购，具体业务办理时间在相关公告中规定。 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额申购或转换价格为下一开放日基金份额申购或转换的价格。

2、调整申购费设置

长江证券超越理财可转债 集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金																				
<p>本集合计划存续期间委托人的参与按照申购金额规模收取参与费，该费用前端收取（即委托人在参与集合计划时缴纳参与费），具体费率如下：</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th>参与金额 N 万</th> <th>申购费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>N < 100</td> <td>0.60%</td> </tr> <tr> <td>100 ≤ N < 500</td> <td>0.40%</td> </tr> <tr> <td>500 ≤ N < 1000</td> <td>0.20%</td> </tr> <tr> <td>1000 ≤ N</td> <td>1000 元/笔</td> </tr> </tbody> </table>	参与金额 N 万	申购费率	N < 100	0.60%	100 ≤ N < 500	0.40%	500 ≤ N < 1000	0.20%	1000 ≤ N	1000 元/笔	<p>本基金A类基金份额在申购时收取申购费，申购费率随申购金额的增加而递减。C类基金份额不收取申购费用。</p> <p>本基金A类基金份额的申购费用采取前端收费模式，申购费率如下：</p> <table border="1" style="margin-left: auto; margin-right: auto;"> <thead> <tr> <th>申购金额 (M)</th> <th>申购费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>M < 100 万</td> <td>0.60%</td> </tr> <tr> <td>100 万 ≤ M < 500 万</td> <td>0.40%</td> </tr> <tr> <td>500 万 ≤ M < 1000 万</td> <td>0.20%</td> </tr> <tr> <td>M ≥ 1000 万</td> <td>按笔收取，1,000 元/笔</td> </tr> </tbody> </table> <p>投资人如果有多笔申购，A类基金份额的申购费按每笔A类基金份额申购申请单独计算。</p>	申购金额 (M)	申购费率	M < 100 万	0.60%	100 万 ≤ M < 500 万	0.40%	500 万 ≤ M < 1000 万	0.20%	M ≥ 1000 万	按笔收取，1,000 元/笔
参与金额 N 万	申购费率																				
N < 100	0.60%																				
100 ≤ N < 500	0.40%																				
500 ≤ N < 1000	0.20%																				
1000 ≤ N	1000 元/笔																				
申购金额 (M)	申购费率																				
M < 100 万	0.60%																				
100 万 ≤ M < 500 万	0.40%																				
500 万 ≤ M < 1000 万	0.20%																				
M ≥ 1000 万	按笔收取，1,000 元/笔																				

3、调整申购份额的计算方法

长江证券超越理财可转债 集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金
<p>委托人在存续期的开放日申购本集合计划的资金按申购当天集合计划单位净值折算成集合计划份额。</p> <p>净申购金额 = 申购金额 ÷ (1 + 参与费率)</p> <p>申购费 = 申购金额 - 净申购金额</p> <p>申购份额 = 净申购金额 ÷ 申购当天集合计划单位净值</p> <p>申购份额的计算保留到小数点后两位，小数点两位以后部分四舍五入，由此产生的误差归入集合计划财产。</p>	<p>(1) A 类基金份额的申购</p> <p>本基金A类基金份额的申购费用采用前端收费模式（即申购基金时缴纳申购费），投资者的申购金额包括申购费用和净申购金额，A类申购份额的计算公式如下：</p> <p>净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)</p> <p>（注：对于适用固定金额申购费率的申购，净申购金额 = 申购金额 - 固定申购费用）</p> <p>申购费用 = 申购金额 - 净申购金额</p> <p>申购份额 = 净申购金额 / 申购当日A类基金份额净值</p>

	<p>(2) C 类基金份额的申购</p> <p>C类申购份额的计算公式如下： $\text{申购份额} = \frac{\text{申购金额}}{\text{申购当日C类基金份额净值}}$</p> <p>(3) 申购份额的计算及余额的处理方式 申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p>
--	---

4、调整申购金额限制

<p style="text-align: center;">长江证券超越理财可转债 集合资产管理计划</p>	<p style="text-align: center;">长江聚利债券型证券投资基金</p>
<p>委托人在存续期间可以多次参与本集合计划。首次参与本集合计划的最低金额不得低于50,000元，再次参与本集合计划的最低金额为500元。</p>	<p>投资人通过其他销售机构申购本基金基金份额单笔最低金额为人民币10元（含申购费），追加申购单笔最低金额为1元（含申购费）。各销售机构对本基金最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准，投资人需遵循销售机构的相关规定。</p> <p>通过基金管理人的直销中心（仅限直销柜台）首次申购本基金基金份额的最低金额为人民币50,000元（含申购费），追加申购单笔最低金额为1,000元（含申购费），不设级差限制；通过基金管理人网上直销系统首次申购本基金基金份额的最低金额为人民币1,000元（含申购费），追加申购单笔最低金额为1,000元（含申购费），不</p>

设级差限制。其他销售机构的投资者欲转入基金管理人的直销中心进行交易须受直销中心最低申购金额的限制。

投资人当期分配的基金收益转为基金份额时，不受最低申购金额的限制。基金管理人可根据市场情况，调整本基金首次申购的最低金额和追加申购的最低金额。

投资人可多次申购，对单个投资者累计持有的基金份额不设上限限制，法律法规、中国证监会另有规定或基金合同另有约定的除外。

基金管理人可以设置单日累计申购金额/净申购金额上限、单个账户单日累计申购金额/净申购金额上限、单笔申购金额上限，并依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时，基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要，可采取上述措施对基金规模予以控制。具体见基金管理人相关公告。

基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定申购金额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

（五）调整赎回相关条款

1、赎回时间安排

长江证券超越理财可转债 集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金
存续期内，三个月封闭期满后每个交易日开放，委托人可在开放日申请退出本计划。	<p>投资人在开放日办理基金份额的赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停赎回时除外。</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过三个月开始办理赎回，具体业务办理时间在相关公告中规定。</p> <p>基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出赎回或转换申请且登记机构确认接受的，其基金份额赎回或转换价格为下一开放日基金份额赎回或转换的价格。</p>

2、调整赎回费率

长江证券超越理财可转债 集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金												
本集合计划的退出费率为： <table border="1" data-bbox="229 1630 683 1888"><thead><tr><th>持有期限T(天)</th><th>退出费率</th></tr></thead><tbody><tr><td>$T < 182$</td><td>0.4%</td></tr><tr><td>$182 \leq T < 365$天</td><td>0.3%</td></tr><tr><td>$365 \leq T < 547$</td><td>0.2%</td></tr><tr><td>$547 \leq T < 730$</td><td>0.1%</td></tr><tr><td>$730 \leq T$</td><td>0</td></tr></tbody></table>	持有期限T(天)	退出费率	$T < 182$	0.4%	$182 \leq T < 365$ 天	0.3%	$365 \leq T < 547$	0.2%	$547 \leq T < 730$	0.1%	$730 \leq T$	0	赎回费用由赎回本基金各类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归入基金财产的比例不低于25%，未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于7日的基金份额持有人收取的赎回费全额计入基金财产。本基金赎回费用按基金份额
持有期限T(天)	退出费率												
$T < 182$	0.4%												
$182 \leq T < 365$ 天	0.3%												
$365 \leq T < 547$	0.2%												
$547 \leq T < 730$	0.1%												
$730 \leq T$	0												

	持有人持有该部分基金份额的时间分段设定如下：		
	持有时间 (N)	A类基金份额赎回费率	C类基金份额赎回费率
	N<7天	1.50%	1.50%
	7天≤N<30天	0.10%	0.10%
	30天≤N<365天	0.05%	0%
	N≥365天	0%	0%
(注：赎回基金份额持有时间的计算，以该基金份额在登记机构的登记日开始计算)			

3、调整赎回数量限制

长江证券超越理财可转债集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金
<p>委托人可将其持有的部分或全部集合计划份额退出，每次申请退出的最低份额为100份。</p> <p>委托人在某一推广机构保留的集合计划份额最低余额为100份，若某笔退出导致在该推广机构账户余额中集合计划份额不足100份的，余额部分应一同退出。</p>	<p>投资者可将其全部或部分基金份额赎回。基金份额持有人在销售机构赎回时，每笔赎回申请的最低份额为10份（包含10份），投资人全额赎回时不受上述限制。本基金份额持有人单个基金账户的最低份额余额为10份（包含10份）。基金份额持有人赎回时或赎回后单个基金账户保留的基金份额余额不足10份的，在赎回时应全部赎回。如某笔交易类业务（如赎回、基金转换、转托管等）导致单个基金账户的基金份额余额不足10份（包含10份）的，基金管理人有权对该基金份额持有人基金账户持有的基金份额做全部赎回处理，赎回费按照招募说明书的规定正常收取。</p> <p>基金管理人可在法律法规允许的情况下，调整上述规定赎回份额的数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露</p>

	办法》的有关规定在规定媒介上公告。
--	-------------------

4、调整巨额赎回的处理方式

为加强基金流动性管理，根据相关法律法规规定，在《基金合同》的巨额赎回条款中，调整了部分延期赎回的操作要求，并增加对单个基金份额持有人超过基金总份额一定比例以上的赎回申请进行延期办理的相关条款。主要条款对照如下：

长江证券超越理财可转债集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金
<p>出现巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定接受全额退出、部分延期退出或暂停退出。</p> <p>（1）接受全额退出：当管理人认为有能力支付委托人的全部退出申请时，按正常退出程序执行。</p> <p>（2）部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请有困难，或认为支付委托人的退出申请进行的资产变现可能使集合计划资产净值发生较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于前一日集合计划总份额10%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，应当按单个账户退出申请份额占当期全部退出申请份额总量的比例，确定当日办理的退出份额。委托人未能退出部分，除委托人在提交退出申请时明</p>	<p>当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回、部分延期赎回、暂停赎回或延期办理赎回申请。</p> <p>（1）全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。</p> <p>（2）部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对</p>

确作出不参加顺延下一个工作日退出的表示外，自动转为下一个工作日退出处理。延缓办理退出部分按照延缓办理日单位净值，逐日支付退出款项，但暂缓期限不得超过正常支付时间20个工作日，并在管理人网站公告。

(3) 暂停退出：本集合计划连续发生巨额退出时，管理人可以按照本说明书和资产管理合同的规定，暂停接受退出申请，但是暂停期限不得超过20个工作日。

于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

(3) 暂停赎回：连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。

(4) 延期办理赎回申请：若本基金发生巨额赎回且单个基金份额持有人的赎回申请超过前一开放日基金总份额10%以上的，基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或认为因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动，可以延期办理赎回申请：

1) 对于该基金份额持有人当日赎回申

	<p>请超过前一开放日基金总份额10%以上的部分，基金管理人可以延期办理赎回申请。基金份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销；选择延期赎回的，当日未获受理的赎回申请将与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，基金份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>2) 对于该基金份额持有人当日赎回申请未超过上述比例的部分，基金管理人可以根据前述全额赎回或部分延期赎回的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。</p>
--	--

(六) 调整投资相关条款

根据本基金产品设计及公募基金相关法律法规规定，调整产品投资范围，删除股票型基金、混合型基金等各类证券投资基金、权证、股指期货等投资标的，细化债券类和权益类的具体投资标的类型，新增地方政府债、次级债、超短期融资券、国债期货、同业存单。

根据本基金产品设计、投资逻辑及公募基金相关法律法规规定，调整产品投资策略、投资限制，新增业绩比较基准，明确风险收益特征。

调整项目	长江证券超越理财可转债集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金
------	---------------------	---------------

<p>投资目标</p>	<p>本集合计划主要通过对流动性好的债券类资产，尤其是可转债的深入分析和价值投资，在控制投资风险前提下，为委托人追求绝对收益，实现委托资产的长期稳定增值。</p>	<p>本基金主要投资于债券，关注可转换债券的投资机会，同时适度参与权益类品种投资，在合理控制风险并保持资产流动性的基础上，力争为投资者创造资产的长期稳定增值。</p>
<p>投资范围</p>	<p>本集合计划投资范围为中国证监会允许集合计划投资的金融产品：权益类金融产品，包括股票（含一级市场申购）、股票型基金、混合型基金、权证；固定收益类金融产品，包括国债、金融债（含政策性金融债）、公司债、企业债、可转换债券（含可分离债、可交换债）、短期融资券、央行票据、资产支持证券、债券型基金、分级基金优先级、债券逆回购和中期票据等银行间交易商协会注册发行的债券融资工具等；中国金融期货交易所上市的股指期货；现金和现金等价物，包括银行存款、一年以内到期的政府债券和央行票据、期限在7天以内（含7天）的债券逆回购、货币市场基金、现金等；以及中国证监会允许投资的其他金融工具。本集合计划可参与证券回购，但参与证券回购融入资金余额不得超过本计划资产净值的40%，中国证监会另有规定的除外。</p>	<p>本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、地方政府债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>

<p>资产配置比例</p>	<p>(1) 权益类金融产品占集合计划资产净值的比例为0-20%;</p> <p>(2) 固定收益类金融产品占集合计划资产总值的比例为0-95%，其中可转债占固定收益类金融产品的市值比例不低于30%;</p> <p>(3) 持有的期货合约占用的期货交易保证金占集合计划资产净值的比例为0-10%；每个交易日日终在扣除期货合约占用的期货交易保证金后，现金和现金等价物不低于集合资产净值的5%;</p> <p>(4) 现金和现金等价物占集合计划资产净值比例不低于5%;</p> <p>(5) 证券回购融入资金余额占集合计划资产净值的比例为：0-40%。因集合计划规模或市场变化等客观因素导致投资组合暂时未能达到上述约定比例的要求，管理人应在可调整之日起十个工作日内进行调整。若投资组合中的投资标的因停牌、限售或处于非开放期等原因而未能在十个工作日内进行调整的，则在该标的复牌、解除限售或开放之日起十个工作日内进行调整。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资期权的，资产管理人经托管人书面同意并公告后，可以将其</p>	<p>本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>当法律法规的相关规定变更时，基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。</p>
---------------	---	---

	<p>纳入本计划的投资范围。如法律法规或中国证监会另有规定的，则从其规定。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人经托管人书面同意并在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>	
<p>投资限制</p>	<p>(1) 投资限制</p> <p>为维护集合计划委托人的合法权益，本集合计划不得从事《管理办法》、《实施细则》、资产管理合同限制的投资行为，包括但不限于：</p> <p>1) 将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；</p> <p>2) 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；</p> <p>3) 将集合计划投资于一家公司发行的证券（基金除外）超过该证券发行总量的10%；</p> <p>4) 将集合计划投资于一只基金的市值超过集合计划资产净值的20%；</p> <p>5) 集合计划投资于任何一只基金，超过该基金规模的30%；（基金规模以最新公布的年报或季报数据为准）；</p>	<p>(1) 组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>1) 本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%；</p> <p>2) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；</p> <p>4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制；</p> <p>5) 本基金参与国债期货交易时，需遵守下列投资限制：</p>

<p>6) 每个交易日日终持有的股指期货多头合约价值超过集合计划资产净值的10%; 空头合约价值超过集合计划资产净值的20%;</p> <p>7) 集合计划申购新股, 申报的金额超过集合计划的现金总额, 或申报的数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;</p> <p>8) 证券法规规定和集合资产管理合同约定禁止从事的其他投资。</p> <p>(2) 禁止行为</p> <p>本集合计划的管理人、托管人及代销机构不得从事《管理办法》、《实施细则》、资产管理合同及其他有关法律法规规定的禁止行为, 包括但不限于:</p> <p>1) 向客户作出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺;</p> <p>2) 挪用集合计划资产;</p> <p>3) 将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途;</p> <p>4) 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资;</p> <p>5) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营;</p> <p>6) 募集资金超过计划说明书约定的规模;</p>	<p>①本基金在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约价值, 不得超过基金资产净值的15%;</p> <p>②本基金在任何交易日日终, 持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%;</p> <p>③本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值, 合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;</p> <p>④本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;</p> <p>6) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例, 不得超过基金资产净值的10%;</p> <p>7) 本基金持有的全部资产支持证券, 其市值不得超过基金资产净值的20%;</p> <p>8) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例, 不得超过该资产支持证券规模的10%;</p> <p>9) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券, 不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;</p>
--	--

<p>7) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额;</p> <p>8) 使用集合计划资产进行不必要的交易;</p> <p>9) 内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为;</p> <p>10) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>	<p>10) 本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;</p> <p>11) 本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放式基金)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;</p> <p>12) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>13) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为</p>
--	--

		<p>交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>14) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>15) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>16) 本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；</p> <p>17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除上述第2)、10)、12)、13)项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并或基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合</p>
--	--	---

		<p>比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。</p> <p>如果法律法规及监管政策等对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，如适用于本基金，本基金可相应调整投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。</p> <p>(2) 禁止行为</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：</p> <ol style="list-style-type: none">1) 承销证券；2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；3) 从事承担无限责任的投资；4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；5) 向其基金管理人、基金托管人出资；6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活
--	--	---

		<p>动；</p> <p>7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。</p> <p>如法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准，不需经基金份额持有人大会审议。</p>
关联交易	<p>委托人同意，本集合计划可投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，交易完成后，管理人将以公告的形式告知托管人和委托人，同时向证券交易所报告。</p>	<p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，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。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p>
业绩比较基准	<p>无</p>	<p>中证综合债指数收益率*85%+沪深300指数收益率*10%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）*5%</p>

（七）调整估值方法

根据变更后的投资范围以及公募基金相关法律法规要求，相应修改了估值方法，并明确本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值。计算公式为：

计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日该类基金份额余额总数。

（八）调整基金费用

根据变更后的产品份额设置，C类基金份额的销售服务费。同时，删除了原集合计划管理人的业绩报酬。主要条款对照如下：

基金费用	长江证券超越理财可转债集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金
管理费	管理人管理费按前一日集合计划资产净值的0.8%年费率计提。	本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提。
托管费	托管人托管费按前一日集合计划资产净值的0.2%年费率计提。	本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。
销售服务费	无	本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.30%年费率计提。本基金销售服务费将专门用于本基金C类基金份额的销售与基金份额持有人服务。

业绩报酬	管理人在本集合计划分红日、份额退出日和计划终止日计提业绩报酬。业绩报酬以计提份额Q持有期间年化收益率R为基准计算。	无
------	---	---

基金运作过程中可能发生的其他费用详见本基金的《招募说明书》“基金费用与税收”部分。

(九) 调整收益分配原则

根据公募基金相关法律法规规定调整收益分配规则，主要条款对照如下：

长江证券超越理财可转债集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金
<p>(1)每份集合计划份额享有同等分配权。</p> <p>(2)集合计划资产收益分配基准日的单位净值减去单位份额分红金额后不能低于集合计划份额面值。</p> <p>(3)集合计划在具备分红条件的情况下每会计年度至少分红一次，每次分配比例不低于本集合计划当期收益分配基准日可供分配利润的60%。集合计划可供分配利润指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。</p> <p>(4)收益分配基准日到红利发放日的时间不超过15个工作日。若集合计划成立日至该会计年度结束日的时间少于3个月，则该年度可不分红。</p> <p>(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>	<p>(1) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；选择红利再投资的，基金份额的现金红利将按除息后的基金份额净值折算成相应类别的基金份额，红利再投资的A类基金份额免收申购费；</p> <p>(2) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>(3) 由于本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能</p>

	<p>有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；</p> <p>(4)法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。</p> <p>在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人在履行适当程序后，可对上述基金收益分配政策进行调整，不需召开基金份额持有人大会。法律法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配政策进行调整。</p>
--	---

(十) 调整信息披露条款

根据公募基金相关法律法规要求，对本基金公开披露的信息内容进行调整，主要条款对照如下：

长江证券超越理财可转债 集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金
<p>(1) 定期公告与报告</p> <p>1) 单位净值 集合计划成立后，集合计划管理人应在每个工作日公布前一工作日的集合计划单位净值、单位累计净值。</p> <p>2) 季度报告 集合计划管理人应向委托人提供准确、完整的资产管理报告，对报告期内集合计划资产的投资策略、资产组合、业绩表现、份额变动以及报告期内集合计划参与股指期货交易的持仓情况、损益情况等情况做</p>	<p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>(1) 基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要</p> <p>1) 《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。</p> <p>2) 基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金</p>

<p>出详细的说明，并充分说明投资股指期货对集合计划总体风险的影响和是否符合既定的投资目的；托管人应向委托人提供准确、完整的资产托管报告，对报告期内管理人在投资运作、净值计算、费用开支等问题是否符合法律、法规、集合计划说明书及合同的规定做出详细的说明。</p> <p>上述报告应于每季度截止日后15个工作日内通过管理人网站通告，并按照监管机构要求报备。</p> <p>3) 年度报告</p> <p>集合计划管理人应向委托人提供准确、完整的资产管理年度报告及集合计划审计报告，对报告期内集合计划资产的业绩表现、收益分配、投资策略、内部监察、投资组合、会计报表以及报告期内集合计划参与股指期货交易的持仓情况、损益情况等做出详细的说明，并充分说明投资股指期货对集合计划总体风险的影响和是否符合既定的投资目的，并按照监管机构要求备案；托管人应向委托人提供准确、完整的资产托管年度报告，除对报告期内管理人在投资运作、净值计算、费用开支等问题是否符合法律、法规、集合计划说明书及合同的规定</p>	<p>份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在指定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。</p> <p>3) 基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p> <p>4) 基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在指定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。</p> <p>经中国证监会批准同意原集合计划变更为本基金后，基金管理人将基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在指定报刊上，将基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在指定网站上，并</p>
--	---

<p>做出详细的说明外，还应复核检查资产管理年度报告中的财务指标、业绩表现、收益分配、会计报表、投资组合以及参与股指期货交易的有关情况等内容是否真实、准确、完整。</p> <p>年度报告及年度审计意见在集合计划管理人的指定网站披露。</p> <p>上述报告及年度审计报告应于每个会计年度截止日后3个月内通过管理人网站通告, 并按照监管机构要求报备。</p> <p>(2) 临时公告与报告</p> <p>本集合计划在运作过程中发生下列可能对投资者权益产生重大影响的事项之一时, 管理人必须按照法律、法规及中国证监会的有关规定及时报告。</p> <p>1) 证券的发行公司出现重大事件, 导致集合计划所持有的该公司发行的证券不能按正常估值方法进行估值, 在管理人根据有关法律法规的规定进行调整后, 调整金额影响到集合计划资产净值的情形;</p> <p>2) 管理人将集合计划资产用于网上申购本公司担任保荐人、主承销商的新股或其他首次发行证券, 以及投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关关联方关系的公司发行的</p>	<p>将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点; 基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。</p> <p>(2) 《基金合同》生效公告</p> <p>基金管理人应当在收到中国证监会确认文件后, 在规定媒介上登载原集合计划的变更公告及《基金合同》生效公告。</p> <p>(3) 基金净值信息</p> <p>《基金合同》生效后, 在开始办理基金份额申购或者赎回前, 基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额的基金份额净值和各类基金份额的基金份额累计净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后, 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日, 通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点, 披露开放日各类基金份额的基金份额净值和各类基金份额的基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日, 在规定网站披露半年度和年度最后一日各类基金份额的基金份额净值和各类基金份额的基金份额累计净值。</p> <p>(4) 基金份额申购、赎回价格</p> <p>基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额</p>
--	--

<p>证券等重大关联事项；</p> <p>3) 涉及本集合计划的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>4) 导致集合计划终止的情况发生；</p> <p>5) 集合计划管理人的董事长、总经理等高级管理人员、投资主办人发生变动；</p> <p>6) 集合计划开始办理申购、退出业务；</p> <p>7) 集合计划发生巨额退出并延期支付；</p> <p>8) 暂停办理集合计划的申购、退出；</p> <p>9) 暂停申购、退出后重新开放集合计划的申购、退出；</p> <p>10) 集合计划分红；</p> <p>11) 其他可能影响委托人权益的重大事项。</p> <p>在集合计划存续期间，管理人将根据法律、法规和中国证监会的有关规定，定期或不定期向按照监管机构要求报告本集合计划的运作情况。</p> <p>(3) 对账单服务</p> <p>本集合计划每年度向上一年度有交易记录或年末仍有集合计划份额的委托人寄送对账单，对账单的寄送形式为邮寄、电子邮件方式或其他方式。委托人需保证在推广机构保留的邮寄地址、电子邮箱或其他联</p>	<p>申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。</p> <p>(5) 基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p>
---	---

<p>系方式正确有效。因委托人未保留邮寄地址、电子邮箱、其他联系方式或所保留的信息无效，导致无法收到对账单时，管理人不承担任何责任。</p> <p>对账单的内容包括委托人持有集合计划份额的数量和净值，期间参与和退出明细以及收益分配情况等。</p>	<p>基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。</p> <p>(6) 临时报告</p> <p>本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在2日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <ol style="list-style-type: none">1) 基金份额持有人大会的召开及决定的事项；2) 《基金合同》终止、基金清算；3) 转换基金运作方式、基金合并；4) 更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；5) 基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；6) 基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；7) 基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；8) 基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；9) 基金管理人的董事在最近12个月内变
---	--

	<p>更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十；</p> <p>10) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；</p> <p>11) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；</p> <p>12) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；</p> <p>13) 基金收益分配事项；</p> <p>14) 基金管理费、基金托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</p> <p>15) 任一类基金份额净值计价错误达该类基金份额净值百分之零点五；</p> <p>16) 本基金开始办理申购、赎回；</p> <p>17) 本基金发生巨额赎回并延期办理；</p> <p>18) 本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；</p> <p>19) 本基金暂停接受申购、赎回申请或</p>
--	---

重新接受申购、赎回申请；

20) 调整基金份额类别；

21) 发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

22) 基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

23) 基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定及基金合同约定的其他事项。

(7) 澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

(8) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

(9) 清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织清算小组对基金财产进行清算并作

出清算报告。清算报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计，并由律师事务所出具法律意见书。清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

（10）投资资产支持证券的信息披露
基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。

（11）投资国债期货的信息披露
基金管理人应当在基金季度报告、基金中期报告、基金年度报告等定期报告中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

（12）实施侧袋机制期间的信息披露
本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书“侧袋机制”部分的规定。

	(13) 中国证监会规定的其他信息。
--	--------------------

在《基金合同》中明确本基金信息披露的规定媒介为符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《公开募集证券投资基金信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介。

在《基金合同》中约定，当出现下述情况时基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露本基金相关信息：

- 1、基金投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
- 2、不可抗力；
- 3、法律法规规定、中国证监会或《基金合同》认定的其他情形。

（十一）调整合同终止条款

主要条款对照如下：

长江证券超越理财可转债 集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金
<p>出现下列情形之一时，本集合计划将终止：</p> <p>（1）管理人因违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责；</p> <p>（2）托管人因解散、破产、撤销、丧失集合资产管理计划托管机构资格、停止营业等事由，不能继续担任集合计划托管人的职务，而无其它托管机构承受其原有权利及义务；</p> <p>（3）集合计划存续期间，委托人人数</p>	<p>有下列情形之一的，在履行相关程序后，《基金合同》应当终止：</p> <p>（1）基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>（2）基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p>（3）《基金合同》约定的其他情形；</p> <p>（4）相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>

低于2人； （4）法律、行政法规、集合资产管理合同及中国证监会规定的其他情形。	
--	--

（十二）调整争议处理

主要条款对照如下：

长江证券超越理财可转债集合资产管理计划	长江聚利债券型证券投资基金
<p>因履行本合同发生的争议，由当事人协商解决；协商不成的，可向中国证券业协会证券纠纷调解中心申请调解；调解不成的，提交管理人所在地有管辖权的法院管辖。</p>	<p>各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会，根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为上海市，仲裁裁决是终局性的，并对各方当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。</p> <p>争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。</p> <p>《基金合同》受中国法律（不含港澳台地区法律）管辖。</p>

（十三）增加基金份额持有人大会机制

根据《基金法》和《运作办法》的规定，在本基金的《基金合同》中设置基金份额持有人大会机制，约定须召开基金份额持有人大会的事项，并明确持有人大会会议召集人、召集方式；召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式；基金份额持有人出席会议的方式；议事内容与程序；表决、计票规则、生效与公告；实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定等。

（十四）增加侧袋机制、摆动定价机制

根据公募基金相关法律法规要求，在本基金的法律文件中增加侧袋机制、摆动定价机制相关条款。

二、变更相关流程安排

根据《资产管理合同》的约定，本公司已征得托管人同意后在官方网站（www.cjzcg1.com）就《资产管理合同》变更的事宜发布《关于长江证券超越理财可转债集合资产管理计划变更为长江聚利债券型证券投资基金及法律文件变更的公告》，并于2022年1月4日通过网站公告方式向投资者发送《关于长江证券超越理财可转债集合资产管理计划变更为长江聚利债券型证券投资基金及法律文件变更的征询意见函》（以下简称“征询意见函”）。

投资者不同意本次变更的，应在征询意见函发出后的5个工作日内（即2022年1月4日至2022年1月10日）将完整、准确填写的征询意见函附件回执送达至回执指定地址，并将所持有的原集合计划份额全部退出。投资者未在前述日期内回复意见的，或答复意见不明确的，或提出异议但未在前述日期内退出全部集合计划份额的，则其已以行为表明同意本次变更。

本次变更将于2022年1月11日生效，即自2022年1月11日（含该日）起《基金合同》生效，《资产管理合同》同日起失效。

三、重要提示

1、敬请投资者仔细阅读变更后长江聚利债券型证券投资基金的《基金合同》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》等法律文件。

2、《基金合同》生效后，投资者继续持有的原集合计划份额将变更为长江聚利债券型证券投资基金A类基金份额，持有期限连续计算。基金管理人自《基金合同》生效之日起不超过三个月开始办理申购、赎回业务，具体业务办理时间和办理规则另行公告。

3、投资者欲了解长江证券超越理财可转债集合资产管理计划变更为长江聚利债券型证券投资基金的相关事宜，可登录本公司网站（www.cjzcg1.com）查询或拨打本公司客户服务热线（4001-166-866）咨询相关信息。

长江证券（上海）资产管理有限公司

二〇二一年十二月三十一日