

关于征求国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划资产管理合同条款变更意见的公告

尊敬的委托人：

我司拟变更《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划资产管理合同》、《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议（一）》及《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议（二）》（以下简称“原合同”）的部分条款，《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划说明书》（以下简称“原说明书”）及《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划风险揭示书》（以下简称“原风险揭示书”）的相关内容一并调整。条款变更内容以已签订的《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议（三）》（编号：**【GHZQ-YF-DKZ-2206-补 003】**，作为原合同的组成部分，以下简称“补充协议”）为准，详见公告附件。

具体流程：

管理人将按照原合同第 24 部分的规定启动合同修改、变更程序，即以书面或者管理人官方网站公告方式（由管理人决定）向委托人发送合同变更征询意见函，并采取如下权利保障措施及安排：

自本公告发布之日起（含）起**【2】**个工作日内（即 2026 年 3 月 13 日至 2026 年 3 月 16 日）属征求委托人意见阶段，其中 2026 年 3 月 16 日为本集合计划的特别开放日。为维护委托人利益，征求意见期间管理人将采取如下权利保障措施及安排：

（1）委托人不同意变更的，管理人保障其退出权利，委托人应在管理人公告的特别开放期内（即 2026 年 3 月 16 日）提出全额退出本资产管理计划的申请；

（2）委托人不同意变更且逾期未退出的，则管理人有权在公告中说明的意见回复期限届满后（即 2026 年 3 月 16 日）将相关份额强制退出计划（退出价格为退出申请当日资产管理计划当日单位净值），由此发生的相关税费或或有损失由委托人自行承担；

（3）委托人未回复意见且逾期未退出，视同委托人同意资产管理合同变更，管理人不再另行通知；

(4) 委托人回复意见不明确的，则视为该委托人不同意变更，按照上述(1)-(2)处理。

(5) 如本资产管理计划固定开放日与合同修订、变更征求意见设置的特别开放期重合，该开放日申购本资产管理计划份额的投资者视为同意资产管理合同变更，未回复意见且未全额赎回本资产管理计划份额的投资者，亦视为同意资产管理合同变更。

补充协议(三)变更内容满足法律、行政法规和《资产管理合同》的相关规定后，在上述意见回复期限届满且管理人宣布合同变更生效之日起生效。

自合同变更生效之日起，变更后的内容即成为原合同组成部分。

上述流程结束，我公司将在公司网站公告国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划合同变更生效事宜。

关于本次合同条款修改的详细情况，委托人如有疑问，请拨打我公司咨询电话：95563。

若本次合同变更生效，本资产管理计划本次开放日起下一运作周期的业绩报酬计提基准 R1 为 2.8%；R2 为 3.2%，业绩报酬计提比例 W1%为 30%；W2%为 60%。

业绩报酬计提方式及比例见《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划资产管理合同》和《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划说明书》。本集合计划的业绩报酬计提基准，仅用于约定管理人的业绩报酬计提标准，并非管理人向委托人保证其资产本金不受损失或者保证其取的最低收益的承诺，本集合计划可能亏损，投资风险由委托人自行承担。

特此公告。



国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划 资产管理合同之补充协议（三）

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发[2018]106号）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《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》（以下简称《运作管理规定》）以及中国证监会、中国证券业协会和中国证券投资基金业协会的其他有关规定，委托人、管理人、托管人在平等自愿、公平、诚实信用原则的基础上订立了《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：【GHZQ-YF-DKZ-2206】）、《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议》（合同编号：

【GHZQ-YF-DKZ-2206-补 001】）及《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议（二）》（合同编号：【GHZQ-YF-DKZ-2206-补.002】）（以下合并简称“原合同”），现各方协商一致对原合同中部分条款进行变更，并签订《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议（三）》（编号：

【GHZQ-YF-DKZ-2206-补 003】，以下简称“本补充协议”），本次合同变更如涉及《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划说明书》（以下简称“原说明书”）、《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划风险揭示书》（以下简称“原风险揭示书”）及《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划托管协议》（以下简称“原托管协议”）部分条款的，一并根据本补充协议内容进行变更，具体变更内容如下：

一、修改、变更内容

原合同	修改前	修改后
第 14 部

<p>分关联方及关联交易</p>	<p>五、资产管理计划的关联交易审批与内控机制</p> <p>公司产品评审与投资决策委员会(简称“产品委”)负责上述重大关联交易审批,并根据内部制度授权对关联交易的分级审批;产品委下设各投资决策小组,负责授权范围内的关联交易审批;资管分公司风险管理总部负责产品委、各投资决策小组审批权限以外的关联交易审批。</p> <p>管理人将严格遵循投资者利益优先原则,采取切实有效措施,防范利益冲突,保护投资者合法权益。</p>	<p>五、资产管理计划的关联交易审批与内控机制</p> <p>管理人按照内部制度规定要求进行上述重大关联交易审批,并根据内部制度授权对关联交易的分级审批;相关议事机构、下设的各投资决策小组、风险管理部门负责其授权范围内的关联交易审批。</p> <p>管理人将严格遵循投资者利益优先原则,采取切实有效措施,防范利益冲突,保护投资者合法权益。</p>
<p>第20部分资产管理计划的费用与税收</p>	<p>.....</p> <p>四、业绩报酬</p> <p>管理人有权对每个运作周期的收益超过业绩报酬计提基准的部分提取60%作为管理人业绩报酬,业绩报酬的计提频率不得超过每6个月一次,因投资者退出资产管理计划,管理人提取业绩报酬的,不受提取频率限制。</p> <p>管理人于每个运作周期开始前公布该运作周期起止日期及该运作周期的业绩报酬计提基准。每个运作周期原则上为每个封闭期加上该封闭期结束后的开放日,封闭期首日为该运作周期的首日。产品结束前的最后一个运作周期为该运作周期的首</p>	<p>.....</p> <p>四、业绩报酬</p> <p>管理人对委托人每笔参与份额年化收益率超过业绩报酬计提基准的部分提取一定比例作为业绩报酬;业绩报酬在集合计划分红日、委托人退出日和集合计划终止日计提,具体以管理人公告为准。从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次,因投资者退出资产管理计划,管理人提取业绩报酬的,不受提取频率限制。</p> <p>1、业绩报酬计提原则</p> <p>(1) 按委托人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p>(2) 在符合业绩报酬计提条件时,在</p>

<p>日至产品终止清算日。</p> <p>R为每个运作周期的年化收益率；</p> <p>A为业绩报酬计提日当日管理人提取业绩报酬前的单位累计净值；</p> <p>C为上一个业绩报酬计提日的单位累计净值；</p> <p>C' 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；</p> <p>D表示上一业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的间隔天数；</p> <p>E=业绩报酬；</p> <p>R' 为每个运作周期的业绩报酬计提基准；</p> <p>K=业绩报酬计提日资产管理计划总份额</p> <p>年化收益率$R=(A - C)/C' \times 365 /D \times 100\%$；</p> <p>业绩报酬计提日为每个运作周期的开放日或资产管理计划清算日。</p> <p>业绩报酬计提标准为：</p> <p>当$R > R'$ 时，对超过R' 的收益部分提取60%的业绩报酬，即$E=(R- R') \times 60\% \times C' \times K \times (D \div 365)$</p> <p>如管理人已经提取业绩报酬，即使委</p>	<p>集合计划分红日、委托人退出日和集合计划终止日计提业绩报酬。</p> <p>(3) 在集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。</p> <p>(4) 在委托人退出或集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。</p> <p>(5) 在委托人退出或集合计划终止时，业绩报酬按委托人退出份额或集合计划终止时持有份额计算。如退出份额包括一笔参与份额的一部分，则将该部分参与份额视为一笔参与份额进行核算。</p> <p>(6) 业绩报酬计提基准可以定期或不定期进行调整，业绩报酬计提基准的调整频率必须与本资产管理计划开放期相匹配，具体以管理人公告为准。</p> <p>2、业绩报酬计提方法</p> <p>(1) 管理人于业绩报酬计提日，针对投资者每笔份额分别核算其业绩报酬，以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，推广期参与的为本资产管理计划成立日，开放期参与的为参与委托当日的下一工作日）至本次业绩报酬计提日期的年化收益率R，作为计提业绩报酬的基准。年化收益率计算公式为：</p>
---	---

托人退出本资产管理计划时净值有所下跌，则该部分已提取业绩报酬亦不退还委托人。

业绩报酬在业绩报酬计提日计提，由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人复核后据此计提应付管理人业绩报酬，业绩报酬计入管理费，须与产品一一对应并逐个结算，管理人管理的不同产品之间不得相互串用。本合同第20部分约定的管理费属于管理人的固定管理费，业绩报酬视为除固定管理费之外的管理费。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，业绩报酬以管理人提供的数据为准。

.....

$$R = \frac{P_1 - P_0}{P_0^*} * \frac{365}{N} * 100\%$$

R为上一业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日委托人每笔参与份额的年化收益率：

P_1 为业绩报酬计提日当日管理人提取业绩报酬前的单位累计净值；

P_0 为上一个业绩报酬计提日的单位累计净值；

P_0^* 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

N为上一业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的间隔天数；

(2) 管理人根据当个业绩报酬核算期的投资者每笔份额实际年化收益率(R)情况，分段计提业绩报酬(E)，投资者所持有份额以认(申)购时间的不同分别进行业绩报酬的核算和计提，具体计算规则如下：

年化收益率 (R)	业绩报酬 (E) 计算公式
$R \leq R1$	$E = 0$
$R2 \geq R > R1$	$E = (R - R1) * W1\% * P_0^* * N * M/365$
$R > R2$	$E = (R - R2) * W2\% * P_0^* * N * \frac{M}{365} + (R2 - R1) * W1\% * P_0^* * N * \frac{M}{365}$

注：E表示管理人每笔参与份额应计提的业绩报酬，M表示委托人每笔参与在上一个业绩报酬计提日对应的集合计划份额，R1、R2为业绩报酬计提基准，W1%、W2%为业绩报酬计提比例，具体以管理人公告为准。

		<p>3、业绩报酬支付方式</p> <p>业绩报酬在业绩报酬计提日计提，由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人据此计提应付管理人业绩报酬。本合同第20部分约定的管理费属于管理人的固定管理费，业绩报酬视为除固定管理费之外的管理费。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。因涉及注册登记数据，业绩报酬以管理人提供的数据为准，托管人仅根据管理人指令进行支付。</p> <p>.....</p>
--	--	--

二、合同变更具体流程

管理人将按照原合同第 24 部分的规定启动合同修改、变更程序，即在管理人的网站上发布拟修改、变更合同的公告。公告安排如下：

自公告发布之日起（含）起【2】个工作日内属征求委托人意见阶段。为维护委托人利益，管理人拟将征求委托人意见阶段的最后一个工作日设为特别开放期，征求意见期间采取如下权利保障措施及安排：

(1) 委托人不同意变更的，管理人保障其退出权利，委托人应在管理人公告的特别开放期内提出退出本资产管理计划的申请；

(2) 委托人不同意变更且逾期未退出的，则管理人有权在公告中说明的意见回复期限届满后将相关份额强制退出计划（退出价格为退出申请当日资产管理计划当日单位净值），由此发生的相关税费或或有损失由委托人自行承担；

(3) 委托人未回复意见且逾期未退出，视同委托人同意本合同变更，管理人不再另行通知；



(4) 委托人回复意见不明确的, 则视为该委托人不同意变更, 按照上述(1)-(2)处理。

如本资产管理计划固定开放日与合同修订、变更征求意见设置的特别开放期重合, 该开放日申购本资产管理计划份额的投资者视为同意资产管理合同变更, 未回复意见且未全额赎回本资产管理计划份额的投资者, 亦视为同意资产管理合同变更。

本补充协议变更内容满足法律、行政法规和《资产管理合同》的相关规定后, 在上述意见回复期限届满且管理人宣布合同变更生效之日起生效。

自合同变更生效之日起, 变更后的内容即成为原合同组成部分。

三、如原合同、原说明书、原风险揭示书及原托管协议相关条款的约定与本补充协议不一致的, 以本补充协议约定的内容为准; 本补充协议未予约定的, 按原合同执行。

(以下无正文)

(本页无正文，为《国海证券扬帆定开债 2206 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议（三）》签署页)

委托人（签字）：

（盖章）：

签署日期： 年 月 日

管理人：国海证券股份有限公司（公章）



法定代表人/授权代理人



签署日期：2026 年 2 月 26 日

托管人：中国工商银行股份有限公司深圳市分行（合同用章）



负责人/授权代表

签署日期：2026 年 2 月 28 日