

关于上海东亚期货有限公司-沅利一号集合资产管理计划 资产管理合同变更的托管人征询意见函（五）

宁波银行股份有限公司：

上海东亚期货有限公司（以下简称“我公司”）在宁波银行股份有限公司托管的上海东亚期货有限公司-沅利一号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）自成立以来，坚持规范运作、稳健运营。为更好地服务投资者，我公司作为管理人拟对《上海东亚期货有限公司-沅利一号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）中开放日、费率、投资经理等内容进行变更，变更条款修改对照明细表如下：

1、《资产管理合同》第五章第（三）款“运作方式”

原条款	变更后条款
（三） 运作方式 本集合为【开放式】集合资产管理计划。 本计划自成立起每周一、三、五开放（如遇非交易日，则相应顺延至下一交易日），中国证监会另有规定的除外。开放期可办理本集合计划的参与、退出业务，投资者需提前 30 个自然日提交预约退出申请。管理人有权提前结束或延期结束开放期，并及时在指定网站上发布公告。 投资者计划份额自份额确认日起 364 天内为份额锁定期，不允许计划份额持有人退出（部分份额已过锁定期，赎回后剩余未过锁定期份额资产低于监管规定及本合同约定的合格投资者要求的，该部分剩余份额不受锁定期限制，资产管理人应当将该计划份额持有人所持剩余份额做全部赎回处理）。	（三） 运作方式 本集合为【开放式】集合资产管理计划。 本计划自成立起每周一、三、五开放（如遇非交易日，则相应顺延至下一交易日），中国证监会另有规定的除外。开放期可办理本集合计划的参与、退出业务。管理人有权提前结束或延期结束开放期，并及时在指定网站上发布公告。 本集合不设定锁定期。

2、《资产管理合同》第八章第（一）款“集合计划的参与”中：第 2 项“参与的开放日和时间”

原条款	变更后条款
2、参与的开放日和时间 本计划自成立起每周一、三、五开放（如遇非交易日，则相应顺延至下一交易日），	2、参与的开放日和时间 本计划自成立起每周一、三、五开放（如遇非交易日，则相应顺延至下一交易日），

原条款	变更后条款
中国证监会另有规定的除外。开放期可办理本集合计划的参与、退出业务。管理人有权提前结束或延期结束开放期，并及时在指定网站上发布公告。 投资者计划份额自份额确认日起 364 天内为份额锁定期，不允许计划份额持有人退出（部分份额已过锁定期，赎回后剩余未过锁定期份额资产低于监管规定及本合同约定的合格投资者要求的，该部分剩余份额不受锁定期限制，资产管理人应当将该计划份额持有人所持剩余份额做全部赎回处理）。	中国证监会另有规定的除外。开放期可办理本集合计划的参与、退出业务。管理人有权提前结束或延期结束开放期，并及时在指定网站上发布公告。 本集合不设定锁定期。

3、《资产管理合同》第八章第（二）款“集合计划的退出”中：第 2 项“退出的开放日和时间”

原条款	变更后条款
2、退出的开放日和时间 本计划自成立起每周一、三、五开放（如遇非交易日，则相应顺延至下一交易日），中国证监会另有规定的除外。开放期可办理本集合计划的参与、退出业务。管理人有权提前结束或延期结束开放期，并及时在指定网站上发布公告。 投资者计划份额自份额确认日起 364 天内为份额锁定期，不允许计划份额持有人退出（部分份额已过锁定期，赎回后剩余未过锁定期份额资产低于监管规定及本合同约定的合格投资者要求的，该部分剩余份额不受锁定期限制，资产管理人应当将该计划份额持有人所持剩余份额做全部赎回处理）。 本集合计划采用“预约退出”原则，投资者只有在预约退出日提出退出申请的份额才能在开放期自动退出。对于未做预约退出申请的份额，根据管理人自动默认继续参与本集合计划。 预约退出申请的提出：投资者提前 30 个自然日提交预约退出申请，办理预约退出申请成功的集合计划份额，在 30 个自然日后的第一个开放日将自动办理退出业务，投资者无需在开放日再次办理退出申请。投资者必须根据集合计划销售机构规定的手续，向集合计划销售机构提出预约退出的申请。投资者在提交预约退出申请时，其在销售机构必	2、退出的开放日和时间 本计划自成立起每周一、三、五开放（如遇非交易日，则相应顺延至下一交易日），中国证监会另有规定的除外。开放期可办理本集合计划的参与、退出业务。管理人有权提前结束或延期结束开放期，并及时在指定网站上发布公告。

原条款	变更后条款
须有足够可用的集合计划份额余额，否则所提交的预约退出的申请无效而不予成交。 因销售机构系统原因无法实现预约退出的情况，则由投资者于开放期退出日（T 日）申请退出。	

4、《资产管理合同》第十三章“投资经理的指定与变更”中：第（一）项“投资经理的指定”

原条款	变更后条款
（一）投资经理的指定 本资产管理计划投资经理由管理人负责指定。 本资产管理计划投资经理为张春鸽，现担任上海东亚期货资产管理部投资经理，负责投资工作。期货从业资格证号：F03092447，基金从业资格证号：P1002424100001。吉林大学金融系研究生学历，历任江苏信宁投资有限公司交易主管、投资经理、上海东亚期货有限公司投资经理，具体负责投资管理。十二年从事债券投资行业，具有丰富的资产管理和投研经验，尤其擅长固定收益类证券的投资、交易和风险控制，对货币市场和固定收益市场有着深刻的理解和认识，对债券交易相关的各类资产品种的周期性波动规律具有丰富的实战经验，并在实际交易过程中形成完备的交易和风险控制体系。 本资产管理计划投资经理无外部兼职，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。	（一）投资经理的指定 本资产管理计划投资经理由管理人负责指定。 本资产管理计划投资经理为李承康，现担任上海东亚期货资产管理部投资经理，无外部兼职。期货从业资格证号：F03107186，基金从业资格证号：P1065132100002。复旦大学国际经济与贸易本科学历，历任上海昊达投资咨询有限公司法人代表兼执行董事，浙江捷荆资产管理有限公司法定代表人、总经理。多年从事金融投资行业，具有丰富的资产管理和投研经验。尤其擅长固定收益类债券的研究和投资，长期深入跟踪宏观经济数据，有较强的行业分析及判断能力和投资风险发现及防控能力。结合量化分析，对债券交易相关的各类资产品种的周期性波动规律有着较深的理解和丰富的交易经验。 最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

5、《资产管理合同》第十九章第（二）款中：第 2 项“管理费”、第 3 项“业绩报酬”

原条款	变更后条款
2、管理费 本集合计划自成立之日起计提管理费。本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的【1%】年费率计提，计算方法如下： $G = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年实际天数}$ G 为每日应计提的集合计划管理费 E 为前一日集合计划资产净值，成立日首日按照成立规模计算。	2、管理费 本集合计划自成立之日起计提管理费。本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的【2%】年费率计提，计算方法如下： $G = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年实际天数}$ G 为每日应计提的集合计划管理费 E 为前一日集合计划资产净值，成立日首日按照成立规模计算。

原条款	变更后条款
本资产管理计划的管理费自计划成立之日起，每日计提，按自然月支付给管理人。管理人在此授权托管人于本计划成立之日的次月度起，每月第4个工作日将管理费从本计划财产中支付至管理人账户，托管人有权在账户余额充足时进行扣划，管理人无需再出具资金划付指令。 	本资产管理计划的管理费自计划成立之日起，每日计提，按自然月支付给管理人。管理人在此授权托管人于本计划成立之日的次月度起，每月第4个工作日将管理费从本计划财产中支付至管理人账户，托管人有权在账户余额充足时进行扣划，管理人无需再出具资金划付指令。
3、业绩报酬 (1) 业绩报酬计提原则：①按委托人参与的计划份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。②在符合业绩报酬计提条件时，在集合计划分红日、委托人退出日、集合计划终止日可计提业绩报酬。③业绩报酬计提日是指实际发生业绩报酬计提的日期。④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。⑤在委托人退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，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，从退出资金中扣除。 	3、业绩报酬 本计划不收取业绩报酬。

6、《资产管理合同》第二十一章第（一）项“定期报告”

原条款	变更后条款
1、集合计划份额净值报告 自集合计划成立之日起，管理人每个交易日披露上一交易日经托管人复核的计划资产份额净值。	1、集合计划份额净值报告 自集合计划成立之日起，管理人每周第一个工作日披露上周最后一个工作日经托管人复核的计划资产份额净值。
3、年度审计报告 管理人应按照国家法律法规的规定聘请会计师事务所对集合计划的运营情况单独进行年度审计，于每个会计年度结束后的4个月内通过指定网站向委托人提供。	3、年度审计报告 管理人应按照国家法律法规的规定聘请会计师事务所对集合计划的运营情况单独进行年度审计，于每个会计年度结束后的4个月内向投资者披露。

7、《资产管理合同》第二十二章第（四）项“收益分配时间”

原条款	变更后条款
-----	-------

(四) 收益分配时间 在符合收益分配原则和分红条件的情况下，收益分配时间由管理人根据本集合计划收益情况拟定，收益分配频率原则上不超过每6个月一次，具体以管理人公告为准。管理人可以调整收益分配的时间和频率，提前向投资者披露。	(四) 收益分配时间 在符合收益分配原则和分红条件的情况下，收益分配时间由管理人根据本集合计划收益情况拟定，具体以管理人公告为准。管理人可以调整收益分配的时间和频率，提前向投资者披露。
---	--

根据《资产管理合同》第二十三章第（一）款的约定，我公司作为本计划管理人就前述变更事项书面征询托管人意见。在与贵行达成书面一致后，我公司将按照《资产管理合同》的约定履行相应程序，及时通过管理人网站向投资者征询意见。投资者不同意变更的，可就持有的计划份额提出退出申请。管理人可设置临时开放日，且在符合法律法规、监管机构及自律组织要求的前提下，不受《资产管理合同》“资产管理计划的参与和退出”中的相关限制；逾期未退出的，视同投资者同意合同变更。自征求意见截止之日起，公告内容即成为本合同组成部分。变更后的合同在征求意见截止日次一工作日生效，以管理人网站公告为准。管理人需将生效公告以邮件形式通知托管人。

若贵行同意本次合同变更内容，请贵行出具加盖公章或合同专用章的同意变更的回函。

本函一式贰份，贵行与本公司各留存壹份。



0606-7926

关于上海东亚期货有限公司-沅利一号集合资产管理计划 资产管理合同变更的托管人征询意见函回函

上海东亚期货有限公司：

我行已收悉贵司发送的《关于上海东亚期货有限公司-沅利一号集合资产管理计划资产管理合同变更的托管人征询意见函（五）》。

我行对于以上托管人征询意见函中的变更内容无异议。

