

《民生量化智锐集合资产管理计划资产管理合同》变更告知函二

致国泰君安证券股份有限公司：

我司拟根据《民生量化智锐集合资产管理计划资产管理合同》的相关约定通过公告形式对该基金合同条款进行变更，特向贵司告知相关变更事宜。

一、民生量化智锐集合资产管理计划资产管理合同条款具体修改如下

（一）修订第二十章“资产管理计划的费用与税收”第（二）条“费用计提方法、计提标准和支付方式”第1款“管理费”

1、原表述：

“1、管理费

资产管理人的管理费包括资产管理人的固定管理费和业绩报酬。

（1）固定管理费

固定管理费率为年费率【1.85】%。在通常情况下，固定管理费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times \text{年固定管理费率} \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的固定管理费

E为前一自然日的计划资产净值

本计划成立之日起，固定管理费每日计提，按【自然季度】支付。自下一【自然季度】开始，由托管人根据与管理人核对一致的计划资产估值数据，从计划财产中一次性支付至管理人账户，管理人无需再出具划款指令。管理人在与托管人协商一致后，可将付费模式变更为托管人根据管理人提交的划款指令进行付费。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

(2) 业绩报酬

(a) 本计划业绩报酬计提基准为【年化7%】。

(b) 业绩报酬的计提基准日：委托人退出日、分红权益登记日、计划清算日。

(c) 业绩报酬的计算：业绩报酬的计算采用单个委托人单笔投资年化收益差额法计提，即资产委托人所持每笔份额或退出份额在持有期（即下述公式中的“T”，下同）的年化收益率大于业绩报酬计提基准时，分别计算每笔份额在上一成功计提基准日至本次计提基准日持有期间的年化收益率（R），对超出业绩报酬计提基准的持有期差额收益按比例【30%】进行计提。

业绩报酬的具体计算及支付如下：

1) 【退出、清算日】时提取业绩报酬

T_n = 【退出日、清算日】的计划份额累计净值；

T_0 = 认购或参与日（以下简称“参与日”）或该资产委托人最近一次成功计提业绩报酬基准日（以下简称“最近报酬日”）的计划份额累计净值；

T_1 = 参与日或最近报酬日的计划份额净值；

T = 该资产委托人最近一次业绩报酬成功计提日（若无最近一次业绩报酬成功计提日，则认购所得份额为计划成立日，参与所得份额为参与确认日）至本次业绩报酬计提日之间的实际天数；

E = 业绩报酬；

B = 业绩报酬计提基准；

K = 当日退出份额数量（退出时）或业绩报酬计提基准日（非退出时）持有的份额数量
 $\times T_1$ ；

$R = (T_n - T_0) / T_1 \times 365 / T \times 100\%$ ；

【业绩报酬计提的条件为：

当 $0\% < R-B$ 时，对超出业绩报酬计提基准部分提取【30%】的业绩报酬，即 $E=K \times (R-B) \times T/365 \times 【30\%】$ ；

当 $R-B \leq 【0\%】$ 时，不提取业绩报酬。】

【2）分红提取业绩报酬

当发生分红时，管理人在分红权益登记日先按“【退出、清算日】时提取业绩报酬”的方法计算每个资产委托人的应计提业绩报酬金额，然后在派发分红时从分红金额中扣除业绩报酬；当分红金额不足以扣除业绩报酬时，以分红金额为限进行扣除。】

业绩报酬采用按账户计提的方式，多次参与退出的计划份额在确定份额参与日或最近报酬日时采用“先进先出”法。

业绩报酬的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此带来的收益和损失归入计划资产。

(d) 业绩报酬的支付

业绩报酬由【管理人或运营服务机构】负责计算及复核，并由管理人在资产委托人【分红或退出或清算】款项（以下简称“退出金额”）中分别予以相应扣除，即退出金额支付日，托管人根据管理人的指令将退出金额（含业绩报酬）划拨到计划募集账户，管理人扣除归其所有的应计提业绩报酬后，剩余的退出金额由管理人支付给资产委托人。

业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，委托人赎回日、计划清算日以及合同约定的其他业绩报酬计提基准日遇非交易日顺延的情况除外。

资产管理人指定收取管理费的银行账户为：

户名：【民生期货有限公司】

开户行：【中国建设银行北京西四支行】

账号：【11001007200059507059】”

修改为：

“1、管理费

资产管理人的管理费包括资产管理人的固定管理费和业绩报酬。

(1) 固定管理费

固定管理费率为年费率【1.85】%。在通常情况下，固定管理费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年固定管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的固定管理费

E 为前一自然日的计划资产净值

本计划成立之日起，固定管理费每日计提，按【自然季度】支付。自下一【自然季度】开始，由托管人根据与管理人核对一致的计划资产估值数据，从计划财产中一次性支付至管理人账户，管理人无需再出具划款指令。管理人在与托管人协商一致后，可将付费模式变更为托管人根据管理人提交的划款指令进行付费。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

资产管理人将从本计划中收取固定管理费的 $\frac{1}{1.85}$ 由资产管理人账户支付给投资顾问。

(2) 业绩报酬

(a) 本计划业绩报酬计提基准为【年化7%】。

(b) 业绩报酬的计提基准日：委托人退出日、分红权益登记日、计划清算日。

(c) 业绩报酬的计算：业绩报酬的计算采用单个委托人单笔投资年化收益差额法计提，即资产委托人所持每笔份额或退出份额在持有期（即下述公式中的“T”，下同）的年化收益率大于业绩报酬计提基准时，分别计算每笔份额在上一成功计提基准日至本次计提基准日持有期间的年化收益率（R），对超出业绩报酬计提基准的持有期差额收益按比例【30%】进行计提。

业绩报酬的具体计算及支付如下：

1) 【退出、清算日】时提取业绩报酬

T_n =【退出日、清算日】的计划份额累计净值；

T_0 =认购或参与日（以下简称“参与日”）或该资产委托人最近一次成功计提业绩报酬基准日（以下简称“最近报酬日”）的计划份额累计净值；

T_1 =参与日或最近报酬日的计划份额净值；

T =该资产委托人最近一次业绩报酬成功计提日（若无最近一次业绩报酬成功计提日，则认购所得份额为计划成立日，参与所得份额为参与确认日）至本次业绩报酬计提日之间的实际天数；

E =业绩报酬；

B =业绩报酬计提基准；

K =当日退出份额数量（退出时）或业绩报酬计提基准日（非退出时）持有的份额数量
 $\times T_1$ ；

$R = (T_n - T_0) / T_1 \times 365 / T \times 100\%$ ；

【业绩报酬计提的条件为：

当 $0\% < R - B$ 时，对超出业绩报酬计提基准部分提取【30%】的业绩报酬，即 $E = K \times (R - B) \times T / 365 \times 【30\%】$ ；

当 $R - B \leq 【0\%】$ 时，不提取业绩报酬。】

【2）分红提取业绩报酬

当发生分红时，管理人在分红权益登记日先按“【退出、清算日】时提取业绩报酬”的方法计算每个资产委托人的应计提业绩报酬金额，然后在派发分红时从分红金额中扣除业绩报酬；当分红金额不足以扣除业绩报酬时，以分红金额为限进行扣除。】

业绩报酬采用按账户计提的方式，多次参与退出的计划份额在确定份额参与日或最近报酬日时采用“先进先出”法。

业绩报酬的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此带来的收益和损失归入计划资产。

(d) 业绩报酬的支付

业绩报酬由【管理人或运营服务机构】负责计算及复核，并由管理人在资产委托人【分红或退出或清算】款项（以下简称“退出金额”）中分别予以相应扣除，即退出金额支付日，托管人根据管理人的指令将退出金额（含业绩报酬）划拨到计划募集账户，管理人扣除归其所有的应计提业绩报酬后，剩余的退出金额由管理人支付给资产委托人。

业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，委托人赎回日、计划清算日以及合同约定的其他业绩报酬计提基准日遇非交易日顺延的情况除外。

资产管理人将从本计划中收取业绩报酬的80%由资产管理人账户支付给投资顾问。

资产管理人指定收取管理费的银行账户为：

户名：【民生期货有限公司】

开户行：【中国建设银行北京西四支行】

账号：【11001007200059507059】”

二、合同条款变更生效事宜

1、本计划由于监管规定变化导致了上述合同变更，如投资者不同意该等变更而退出本计划，根据资产管理合同约定不受锁定期限制。又由于资产管理合同未约定在365天内退出而收取退出费的情形，不同意该等变更的投资者且份额持有期低于365天，本计划不收退出费。

2、如贵司未提出书面反对意见的，相关合同条款变更将自【2023】年【4】月【6】日起正式生效，我司将以公告等形式向投资者披露本函变更的具体内容。

管理人：【民生期货有限公司】

