

# 长城证券长鑫收益宝 1 号集合资产管理计划合同变更及临时开放公告

尊敬的广大投资者：

为满足我司投资管理需要，经与托管行招商银行股份有限公司深圳分行协商一致，我公司拟对《长城证券长鑫收益宝 1 号集合资产管理计划资产管理合同》有关条款做出变更。具体如下：

修改内容	长城证券长鑫收益宝 1 号集合资产管理计划资产管理合同 原条款	长城证券长鑫收益宝 1 号集合资产管理计划资产管理合同 现条款	修改原因
五、资产管理计划的基本情况	<p>(五) 主要投资方向（投资范围）和投资比例</p> <p>4、预警线和止损线 本计划无预警线和止损线。</p> <p>(九) 资产管理计划的费用 管理人的管理费（含业绩报酬）：本计划财产的年管理费率为 0.1%； ……</p>	<p>(五) 主要投资方向（投资范围）和投资比例</p> <p>4、预警线和止损线 本计划设置预警线和止损线。</p> <p>(1) 预警线 单位净值 0.96 元为预警线。当单位净值触及预警线之日的下一个交易日起，本计划仅可进行卖出或赎回及相关的投资操作，不再进行买入或申（认）购及相关的投资操作。自本计划单位净值恢复到 0.96 元以上的下一个交易日起，本计划可恢复进行买入或申（认）购及相关的投资操作。</p> <p>(2) 止损线 单位净值 0.94 元为止损线。当单位净值触及止损线之日的下一个交易日起，管理人须对本计划持有的全部非现金资产进行变现操作，直至本计划资产全部变现为止。</p> <p>在上述计划资产变现过程中，如单位净值恢复到 0.94 元（含本数）至 0.96 元（含本数）区间，管理人可选择终止继续变现；如单位净值恢复到 0.96 元以上，管理人可重新对计划资产进行投资，且投资须符合本合同的各项相关约定。</p> <p>(九) 资产管理计划的费用 管理人的管理费（含业绩报酬）：本计划财产的年管理费率为 0.3%；……</p>	投资管理需要
十九、资产管理计划的费用与税收	<p>(三) 费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、管理人的管理费 资产管理计划财产的年管理费率为</p>	<p>(三) 费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、管理人的管理费 资产管理计划财产的年管理费率为</p>	投资管理需要

	0.1%，计算方法如下： .....	0.3%，计算方法如下： .....	
八、资产管理计划的参与、退出与转让	<p>(十一) 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与资产管理计划</p> <p>证券期货经营机构及其子公司自有资金不参与本计划。</p>	<p>(十一) 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与资产管理计划</p> <p>1、自有资金参与的条件、方式</p> <p>证券期货经营机构及其子公司在存续期可以以自有资金参与本计划。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划，应符合法律法规、监管规定和本合同的相关规定。</p> <p>2、自有资金参与的金额和比例</p> <p>证券期货经营机构以自有资金参与本集合计划的份额不得超过集合计划总份额的 15%，且最终自有资金参与金额合计不超过 3000 万元。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过集合计划总份额的 50%。最终的实际参与金额以管理人发布的自有资金参与公告为准。</p> <p>3、自有资金的责任承担方式与收益分配</p> <p>证券期货经营机构及其子公司自有资金所持有集合计划份额与投资者持有的集合计划份额享有同等权益、承担同等风险。证券期货经营机构及其子公司自有资金不对投资者的本金和收益进行赔付。</p> <p>4、自有资金的退出</p> <p>证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划的持有期限不得少于 6 个月。</p> <p>因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规规定及本合同约定比例的，管理人应该按照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时调整达标。</p> <p>5、为应对巨额退出以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他形式，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与或退出本计划，可不受前述第 2 条、第 4 条的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>6、集合计划存续期内，当法律法规或有关自有资金参与集合计划的规定或</p>	投资管理需要

		<p>政策发生变更，管理人经与托管人协商一致并公告后，可直接对“（十一）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与资产管理计划”的相关内容进行修改和调整。</p> <p>7、风险揭示：证券期货经营机构及其子公司自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响集合计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注集合计划规模变动情况，控制流动性风险。</p> <p>存续期内，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出本计划时应当提前5个工作日以邮件或书面形式征询托管人，取得其同意；提前5个工作日告知全体投资者并通过官网公告方式取得其同意；存续期内，投资者不同意自有资金参与或退出的，应当保障其退出的权利，投资者在开放期内未退出的，视为同意证券期货经营机构及其子公司自有资金进行参与或退出。如投资者通过书面方式明确表示不同意但又不退出的，自有资金不能进行参与或退出。但在开放期内由于投资者退出份额、产品规模变动等客观因素导致的自有资金参与比例“被动超标”的情况，管理人无需提前5个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意，可进行自有资金退出等调整，但事后应当及时通过公告在5个工作日内进行告知。</p>	
<p>二十二、 风险揭示</p>	<p>三、一般风险揭示</p> <p>（十一）证券交易资金前端控制风险</p> <p>根据证券交易所、中登公司的相关规定，证券交易所、中登公司根据最高额度和自设额度对管理人的关联交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并对管理人实施前端控制，其中，最高额度为按照证券交易所、中登公司对于最高额度的定义计算的额度，自设额度为管理人自行申报的低于最高额度的额度，自设额度应低于最高额度。如果本计划或管理人管理的其他资产管理计划下的某笔交易导致管理人关联交易单元全天净买入申报金额达到或超过自设额度的，证券交易所将拒绝接受该笔交易及该关联交易单元后续竞价交易买</p>	<p>三、一般风险揭示</p> <p>（十一）证券交易资金前端控制风险</p> <p>根据证券交易所、中登公司的相关规定，证券交易所、中登公司根据最高额度和自设额度对管理人的关联交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并对管理人实施前端控制，其中，最高额度为按照证券交易所、中登公司对于最高额度的定义计算的额度，自设额度为管理人自行申报的低于最高额度的额度，自设额度应低于最高额度。如果本计划或管理人管理的其他资产管理计划下的某笔交易导致管理人关联交易单元全天净买入申报金额达到或超过自设额度的，证券交易所将拒绝接受该笔交易及该关联交易单元后续竞价交易买入申报，本计划的相</p>	<p>投资管理 需要</p>

入申报，本计划的相关投资交易将无法成功申报。尽管管理人可在规定时间内通过托管人向中登公司申请盘中紧急调整最高额度或自设额度，但调整能否成功取决于是否在申请时间内、中登公司及证券交易所是否同意等诸多因素，并且调整完成需要一段时间，此时本计划仍然存在无法及时完成投资的风险。因上述原因可能导致管理人无法完成投资，继而影响本计划投资收益、给受托资产造成损失。因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的，证券交易所、中登公司可以采取调整额度、暂停实施资金前端控制、限制交易单元交易权限等处置措施。因资金前端控制异常情况以及证券交易所、中登公司采取的相应措施可能影响管理人的投资，继而影响受托资产的投资收益、给受托资产造成损失。

#### (十二) 其他风险

##### 3、未设置预警线、止损线所涉风险

本产品未设置预警线、止损线，可能存在由于投资品种价格持续向不利方向变动、投资品种市场剧烈波动等原因，受托资产存在全部亏损的风险。

关投资交易将无法成功申报。尽管管理人可在规定时间内通过托管人向中登公司申请盘中紧急调整最高额度或自设额度，但调整能否成功取决于是否在申请时间内、中登公司及证券交易所是否同意等诸多因素，并且调整完成需要一段时间，此时本计划仍然存在无法及时完成投资的风险。因上述原因可能导致管理人无法完成投资，继而影响本计划投资收益、给受托资产造成损失。因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错等原因导致资金前端控制出现异常的，证券交易所、中登公司可以采取调整额度、暂停实施资金前端控制、限制交易单元交易权限等处置措施。因资金前端控制异常情况以及证券交易所、中登公司采取的相应措施可能影响管理人的投资，继而影响受托资产的投资收益、给受托资产造成损失。管理人作为交易参与者须确保申报信息真实、完整、有效，切实履行资金前端控制各项职责，托管人作为结算参与者须配合管理人履行资金前端控制申报职责。因管理人提供的信息不准确导致申报异常或申报失败的，责任由管理人自行承担。如遇申报异常或失败的，托管人需及时通知管理人，在申报截止时间点前管理人与托管人协商处理办法，并重新完成申报；托管人未及时通知管理人的，应承担相应损失赔偿责任。管理人对资金前端控制额度报送负有监控职责，并通过交易所系统查询最高额度与申报明细。若管理人对申报数据持有异议，将及时与托管人沟通并协商解决。

#### (十二) 其他风险

##### 3、设置预警线、止损线所涉风险

本产品预警线为 0.96 元，止损线为 0.94 元；预警线、止损线并非本产品可能承受损失下限的保证，本产品如触发预警、止损线，管理人可根据合同约定继续投资运作，可能存在由于投资品种价格持续向不利方向变动、投资品种市场剧烈波动等原因，受托财产存在超出预警线、止损线监控及可测算范围进一步亏损的风险。



--	--	--	--

根据《长城证券长鑫收益宝1号集合资产管理计划资产管理合同》约定，本次变更将在管理人网站进行公告。本计划将于2025年2月14日进行临时开放，投资者不同意变更的，应在公告发布后的临时开放期内退出本计划。投资者未将其所持本计划全部份额退出的，视为投资者同意本合同此次变更，变更于公告发布后临时开放期结束后的第一个工作日开始生效。

感谢投资者对本集合计划的信任。长城证券长鑫收益宝1号集合资产管理计划自成立以来，运行良好。管理人将继续本着勤勉尽责的态度，发挥专业的理财能力，谋求委托资产的保值增值。

特此公告。

