

《金信金睿多策略1号集合资产管理计划资产管理合同》变更告知函

致国泰君安证券股份有限公司：

我司拟根据《金信金睿多策略1号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、金信金睿多策略1号集合资产管理计划资产管理合同条款具体修改如下

(一) 修订第十一节“资产管理计划的投资”第(七)条

1、删除表述：

“上述第1、2、7、8款投资限制如涉及【穿透核查或穿透合并】计算的，管理人应当定期向托管人提供相应底层核查材料或计算数据，托管人仅按照管理人提供的材料数据及提供频率进行事后监督，管理人应确保对所提供数据材料的真实性、准确性以及完整性负责。”

上述第3、9款投资限制由管理人自行监控。”

(二) 修订第十一节“资产管理计划的投资”第(十一)条“止损机制”第4款

1、删除表述：

“4、本计划的止损线由资产管理人负责监控并执行。”

(三) 修订第十八节“越权交易的界定”第(三)条“资产托管人的投资监督范围”第1款“资产托管人的投资监督原则”

1、原表述：

“资产托管人根据本计划经核对的估值数据对资产管理人的直接投资行为进行监督。如因资产托管人无法获得监督数据而导致无法监督的事项（包括但不限于涉及新股新债申报金额与数量、盘中监控及跨产品合并计算等），则由管理人负责监控并执行。如因管理人提供底层数据材料的提供频率、脱敏处理、可披露程度等原因导致托管人实际监督范围受限的，由此造成的后果由相应责任方承担。”

修改为：

“【资产托管人根据本计划经核对的估值数据对资产管理人的投资行为进行监督。】”

（四）修订第十九节“资产管理计划的估值与会计核算”第（一）条“计划资产的估值”第5款“估值方法”第（1）项“证券交易所上市的有价证券的估值”第B目

原表述：

“B、证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券等投资品种，但可转换债券除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，采用相应估值技术确认公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按历史成本估值。”

修改为：

“B、证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券等投资品种，但可转换债券除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，采用相应估值技术确认公允价值。”

（五）修订第十九节“资产管理计划的估值与会计核算”第（一）条“计划资产的估值”第5款“估值方法”第（2）项“处于未上市流通期间的有价证券应区分如下情况处理”第B目、C目

1、原表述：

“B、首次公开发行未上市的有价证券（如股票、交易所上市交易的基金、可转换债券等）采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按历史成本估值。

C、首次公开发行未上市的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券等投资品种，但可转换债券除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按历史成本估值。”

修改为：



“B、首次公开发行未上市的有价证券（如股票、交易所上市交易的基金、可转换债券等）采用估值技术确定公允价值。

C、首次公开发行未上市的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券等投资品种，但可转换债券除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，采用估值技术确定公允价值。”

（六）修订第十九节“资产管理计划的估值与会计核算”第（一）条“计划资产的估值”第5款“估值方法”第（3）项

1、原表述：

“（3）对在全国银行间债券市场交易的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券、非公开定向债务融资工具、同业存单等投资品种），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按历史成本估值。”

修改为：

“（3）对在全国银行间债券市场交易的固定收益品种（包括但不限于债券、资产支持证券、非公开定向债务融资工具、同业存单等投资品种），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。如第三方估值机构不发布估值价的，采用估值技术确定公允价值。”

（七）修订第十九节“资产管理计划的估值与会计核算”第（一）条“计划资产的估值”第5款“估值方法”第（8）项

1、原表述：

“（8）本计划持有的券商收益凭证，如收益凭证投资协议中有明确预期或固定收益率的，按成本列示并每日加计应收利息（或应计收益）进行估值；没有约定的，按照凭证发行方提供的定期价值报告估值，如无法提供的，由管理人与托管人根据本金与收益结算条款协商估值方法（其中包含按历史成本估值）。”

修改为：

“（8）本计划持有的券商收益凭证，如收益凭证投资协议中有明确预期或固定收益率的，按成本列示并每日加计应收利息（或应计收益）进行估值；没有约定的，按照凭证发行方提供的定期价值报告估值，如无法提供的，由管理人与托管人根据本金与收益结算条款协商估值方法。”

（八）修订第十九节“资产管理计划的估值与会计核算”第（一）条“计划资产的估值”第5款“估值方法”第（9）项C目

1、原表述：

“C、按份额净值计价的场外投资标的，按照场外投资标的的管理人、场外投资标的的运营服务机构或场外投资标的的托管人提供的最新份额净值估值，如前述场外投资标的的管理人、运营服务机构或托管人未提供份额净值依据，则按历史成本估值。”

修改为：

“C、按份额净值计价的场外投资标的，按照场外投资标的的管理人、场外投资标的的运营服务机构或场外投资标的的托管人提供的最新份额净值估值。”

（九）修订附件1“投资监督事项表”第3款“止损机制”

1、删除表述：

“本计划的【止损线】由管理人负责监控并执行。”

二、合同条款变更生效事宜

如贵司未提出书面反对意见的，相关合同条款变更将自【2022】年【3】月【2】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：【金信期货有限公司】

（盖章）

【2022年3月2日】