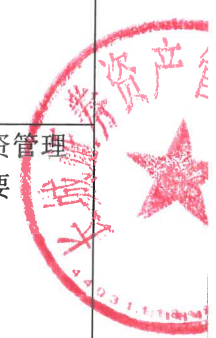


# 长城证券臻城陆享1号集合资产管理计划合同变更及临时开放公告

尊敬的广大投资者：

为满足我司投资管理需要，经与宁波银行股份有限公司协商一致，我公司拟对《长城证券臻城陆享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	长城证券臻城陆享1号集合资产管理计划资产管理合同原条款	长城证券臻城陆享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	新增条款	<p>(五) 投资范围和投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>.....</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产：商品型公募基金((含交易性开放式指数基金(ETF)，包括但不限于跟踪黄金、能源化工、有色金属和其他综合商品指数、大类商品指数或单个商品价格指数的ETF)。</p>	投资管理需要
五、资产管理计划的基本情况	新增条款	<p>(五) 投资范围和投资比例</p> <p>2、投资比例</p> <p>.....</p> <p>(3) 穿透后，本计划投资于期货和衍生品类资产的比例为总资产的0-20%（不包含20%）。</p>	投资管理需要
八、资产管理计划的参与、退出与转让	<p>(二) 本计划运作期间的退出</p> <p>2、退出的开放日和时间</p> <p>本计划自成立之日起【每月的第4个交易日】开放退出，开放期具体时间以管理人公告为准。本计划份额的退出日以“月月对应”为原则，投资者在持有本计划第12个月整数倍的开放日可以办理退出业务，管理人有权进行额度控制。</p>	<p>(二) 本计划运作期间的退出</p> <p>2、退出的开放日和时间</p> <p>本计划自成立之日起【每月的第4个交易日】开放退出，开放期具体时间以管理人公告为准。本计划份额的退出日以“月月对应”为原则，投资者在持有本计划第6个月整数倍的开放日可以办理退出业务，管理人有权进行额度控制。</p>	投资管理需要
十一、资产管理计划的投资	新增条款	<p>(二) 投资范围和投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>.....</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产：商品型公募基金((含交易性开放式指数基金(ETF)，包括但不限于跟踪黄金、能源化工、有色金属和其他综合商品指数、大类商品指数或单个商品价格指数的ETF)。</p>	投资管理需要
十一、资产管理计划的投资	新增条款	<p>(二) 投资范围和投资比例</p> <p>2、投资比例</p> <p>.....</p> <p>(3) 穿透后，本计划投资于期货和衍生品类资产的比例为总资产的0-20%（不包含20%）。</p>	投资管理需要



<p>十一、资产管理计划的投资</p>	<p>新增条款</p>	<p>(六) 投资策略 .....</p> <p>4、商品型基金投资策略 主要参照基准配置比例中的商品品种配置比例进行配置，具体方法如下： (1) 根据基准配置比例中商品部分各商品品种的成分和权重，在商品基金中抽样选择基础资产商品品种与基准配置比例中商品部分相同或接近的基金，组成初选基金池。 (2) 通过量化模型进行最优化分析，从备选基金池中选取基金构建组合。最优化目标为组合与基准配置比例中商品部分的日收益率序列的相关系数最大化，并据此求解组合中各基金的权重。 (3) 当基准配置比例定期或不定期进行调整时，通过量化模型重新计算，对组合进行相应调整。 (4) 由管理人基于对宏观经济和各商品品种基本面的判断，综合评估历史波动率是否准确反映了各商品品种的市场风险，并对组合进行适度调整。</p>	<p>投资管理需要</p>																					
<p>二十一、资产管理计划的费用与税收</p>	<p>(三) 费用费率、计算方法、支付方式和时间 2、管理人的业绩报酬 (2) 业绩报酬计提方法 2) 业绩报酬计提比例 年化收益率 <math>R \leq 2.5\%</math>: 不收取业绩报酬; <math>2.5\% &lt; \text{年化收益率 } R \leq 4.5\%</math>: 管理人对超过 2.5% 的部分提取 20% 的业绩报酬; 年化收益率 <math>R &gt; 4.5\%</math>: 管理人对超过 2.5% 不超过 4.5% 的部分提取 20% 的业绩报酬, 超过 4.5% 部分提取 40% 业绩报酬。 计算公式如下:</p> <table border="1" data-bbox="293 1547 786 1928"> <thead> <tr> <th>年化收益率 (R)</th> <th>提取比例</th> <th>业绩报酬 (Y)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td><math>R \leq 2.5\%</math></td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td><math>2.5\% &lt; R \leq 4.5\%</math></td> <td>20%</td> <td><math>Y = (R - 2.5\%) \times A \times 20\% \times D</math></td> </tr> <tr> <td><math>4.5\% &lt; R</math></td> <td>40%</td> <td><math>Y = (4.5\% - 2.5\%) \times A \times 20\% \times D + (R - 4.5\%) \times A \times 40\% \times D</math></td> </tr> </tbody> </table> <p>注: R 为年化收益率。</p>	年化收益率 (R)	提取比例	业绩报酬 (Y)	$R \leq 2.5\%$	0	0	$2.5\% < R \leq 4.5\%$	20%	$Y = (R - 2.5\%) \times A \times 20\% \times D$	$4.5\% < R$	40%	$Y = (4.5\% - 2.5\%) \times A \times 20\% \times D + (R - 4.5\%) \times A \times 40\% \times D$	<p>(三) 费用费率、计算方法、支付方式和时间 2、管理人的业绩报酬 (2) 业绩报酬计提方法 2) 业绩报酬计提比例 管理人对超过业绩报酬计提基准的部分提取 20% 的业绩报酬，计算公式如下:</p> <table border="1" data-bbox="815 1339 1292 1559"> <thead> <tr> <th>年化收益率 (R)</th> <th>提取比例</th> <th>业绩报酬 (Y)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td><math>R \leq X</math></td> <td>0</td> <td>0</td> </tr> <tr> <td><math>R &gt; X</math></td> <td>20%</td> <td><math>Y = (R - X) \times A \times 20\% \times D</math></td> </tr> </tbody> </table> <p>注: R 为年化收益率。 X 为管理人公布的当期业绩报酬计提基准。管理人于本计划初始募集及开放公告公布下一期业绩报酬计提基准，详见管理人公告。</p>	年化收益率 (R)	提取比例	业绩报酬 (Y)	$R \leq X$	0	0	$R > X$	20%	$Y = (R - X) \times A \times 20\% \times D$	<p>投资管理需要</p>
年化收益率 (R)	提取比例	业绩报酬 (Y)																						
$R \leq 2.5\%$	0	0																						
$2.5\% < R \leq 4.5\%$	20%	$Y = (R - 2.5\%) \times A \times 20\% \times D$																						
$4.5\% < R$	40%	$Y = (4.5\% - 2.5\%) \times A \times 20\% \times D + (R - 4.5\%) \times A \times 40\% \times D$																						
年化收益率 (R)	提取比例	业绩报酬 (Y)																						
$R \leq X$	0	0																						
$R > X$	20%	$Y = (R - X) \times A \times 20\% \times D$																						
<p>二十四、风</p>	<p>新增条款</p>	<p>(二) 产品特有风险</p>	<p>投资管理</p>																					

险揭示		..... 5、投资于商品型公募基金的风险 本计划可能投向商品型公募基金（含交易性开放式指数基金（ETF））。大宗商品价格受全球供需、地缘政治等因素影响，可能产生较大波动；此外，可能存在交易价格偏离净值的溢价风险，以及基金表现与标的指数之间的跟踪误差。	需要
二十四、风险揭示	新增条款	（三）一般风险揭示 ..... 9、业绩报酬调整风险 本计划每期业绩报酬计提基准由管理人确定，存在管理人可能下调业绩报酬计提基准、不利于投资者利益的情形。	投资管理需要

将“附件一：《投资交易监督事项表》”修订为：

投资交易监督事项表		
序号	监督内容	监控计量方式
1	投资范围	<p>（1）固定收益类资产：公司债（大公募、小公募以及非公开发行公司债）、企业债、地方政府债、同业存单、可交换债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转换债券、永续期债券、可分离交易可转债、资产支持证券（ABS）、非公开定向债务融资工具（PPN）、资产支持票据（ABN）、国债、金融债、次级债券（务）、混合资本债、债券逆回购、央行票据、现金、银行存款、同业存款、债券型公募基金（含ETF基金）及货币市场基金。</p> <p>（2）权益类资产：股票、股票型公募基金（含交易性开放式指数基金（ETF））。</p> <p>（3）期货和衍生品类资产：商品型公募基金（含交易性开放式指数基金（ETF），包括但不限于跟踪黄金、能源化工、有色金属和其他综合商品指数、大类商品指数或单个商品价格指数的ETF）。</p> <p>（4）资产管理产品：银行、信托公司、证券公司、基金公司、期货公司、保险资产管理机构及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司发行的资产管理计划、信托计划、银行理财、在中国证券投资基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金以及其它接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品。</p>

		(5) 本计划可以参与证券回购。
2	投资比例	<p>(1) 穿透后, 本计划投资于固定收益类资产占本计划总资产的比例不低于 80%。本计划投资于其他资产管理产品时, 计算本计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。</p> <p>(2) 穿透后, 本计划投资于权益类资产的比例为总资产的 0-20% (不包含 20%)。</p> <p>(3) 穿透后, 本计划投资于期货和衍生品类资产的比例为总资产的 0-20% (不包含 20%)。</p> <p>(4) 本计划投资于资产管理产品类资产的比例 (按市值计算) 低于资产总值的 80%。</p>

《长城证券臻城陆享 1 号集合资产管理计划说明书》、《长城证券臻城陆享 1 号集合资产管理计划风险揭示书》相关条款参照《长城证券臻城陆享 1 号集合资产管理计划资产管理合同》进行修改。

特别说明: 本次变更涉及业绩报酬计提方式, 本计划 2025 年度后续开放期次的业绩报酬计提基准为: 2.50%。本次合同变更生效后, 当前存量客户均将适用于本次变更后的新基准 2.50%。

根据《长城证券臻城陆享 1 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十五条“资产管理合同的变更、终止与财产清算”中的有关约定, 本次变更将在管理人网站进行公告。本计划将于 2025 年 10 月 24 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, 此次变更于公告发出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。长城证券臻城陆享 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, 谋求受托资产的保值增值。

特此公告。

