

## 海通海蓝宝银集合资产管理计划 合同变更公告

根据《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《证券公司客户资产管理业务规范》及《海通海蓝宝银集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”），经与海通海蓝宝银集合资产管理计划托管银行中国工商银行股份有限公司（以下简称“托管人”）协商，上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”）拟对《资产管理合同》的相关条款进行变更。托管人已于 2013 年 9 月 10 日就本合同变更事项出具了确认函（见附件）。《资产管理合同》条款具体修改如下：

### 一、海通海蓝宝银集合资产管理计划资产管理合同修改对照明细表

序号	位置	原条款	现条款
1	三、集合计划的基本情况（二）投资范围和投资比例	<p>1、投资范围： 本集合计划的投资范围为国内依法发行的，<u>具有良好流动性的短期金融工具</u>，包括银行存款、货币市场基金、<u>剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、可分离债、不低于 AA 级的短期融资券、资产支持受益凭证、债券正、逆回购以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。</u> 本集合计划可投资于债券型基金和具有固定收益特征的分级股票型和混合型证券投资基金的优先级份额。 本集合计划不参与新股申购及一级市场可分离债申购，也不参与可转债、股票等权益类资产的投资以及<u>剩余期限超过 397 天的固定收益类品种的投资。</u></p> <p>2、资产配置比例： (1) <u>剩余期限在 397 天（含 397 天）的固定收益类资产：0%-90%</u>，固定收益类资产包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、可分离债、资产支持受益凭证、<u>不低于 AA 级的短期融资券、超过 7 天的债券逆回购等。</u></p>	<p>1、投资范围： 本集合计划的投资范围为国内依法发行的金融工具，包括银行存款、货币市场基金、银行理财产品、<u>国债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、可分离债、中期票据（含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）、不低于 A-1 级的短期融资券、资产支持受益凭证、债券正、逆回购以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。</u> 本集合计划可投资于债券型基金和具有固定收益特征的分级股票型和混合型证券投资基金的优先级份额。 本集合计划不参与新股申购及一级市场可分离债申购，也不参与可转债及股票等权益类资产的投资。</p> <p>2、资产配置比例： (1) <u>固定收益类资产：0%-90%</u>，固定收益类资产包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司</p>

		<p>(2) 现金类资产：10%—100%，现金类资产包括现金、银行存款、货币市场基金、不超过 7 天的债券逆回购等，<u>其中期限在 3 个月内（含 3 个月）的银行存款不低于现金类资产的 30%。</u></p> <p>(3) 债券型基金和具有固定收益特征的分级股票型和混合型证券投资基金的优先级份额：0-30%。</p> <p>(4) 债券正回购融入资金余额不超过计划资产净值的 40%。</p> <p>管理人将在本集合计划成立并开始投资运作之日起 6 个月内，使本集合计划的投资组合比例符合上述约定。因证券市场波动、投资对象合并、集合资产管理计划规模变动等外部因素致使集合资产管理计划的组合投资比例不符合集合资产管理合同约定的，管理人将在 10 个工作日内进行调整（如遇限售期等原因导致相关证券不能交易的，上述时间期限自动顺延）。</p> <p>如法律、行政法规或监管机构在集合资产管理合同生效后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>3、海通海蓝宝银集合资产管理计划资产投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券不超过集合计划资产净值的 7%。</p>	<p>债、可分离债、中期票据（含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）、资产支持受益凭证、不低于 A-1 级的短期融资券、超过 7 天的债券逆回购、银行理财产品等。</p> <p>(2) 现金类资产：10%—100%，现金类资产包括现金、银行存款、货币市场基金、不超过 7 天的债券逆回购等。</p> <p>(3) 债券型基金和具有固定收益特征的分级股票型和混合型证券投资基金的优先级份额：0-30%。</p> <p>(4) 债券正回购融入资金余额不超过计划资产净值的 40%。</p> <p>管理人将在本集合计划成立并开始投资运作之日起 6 个月内，使本集合计划的投资组合比例符合上述约定。因证券市场波动、投资对象合并、集合资产管理计划规模变动等外部因素致使集合资产管理计划的组合投资比例不符合集合资产管理合同约定的，管理人将在 10 个工作日内进行调整（如遇限售期等原因导致相关证券不能交易的，上述时间期限自动顺延）。</p> <p>如法律、行政法规或监管机构在集合资产管理合同生效后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>3、海通海蓝宝银集合资产管理计划资产投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券<u>或承销期内承销的证券</u>不超过集合计划资产净值的 7%。<u>交易完成之日起 5 个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所报告，同时采取切实有效的措施，防范利益冲突，保护客户合法权益。</u></p>
2	三、集合计划的基本情况（四）存续期间	本集合计划存续期为 3 年，可展期。	本集合计划 <u>无</u> 固定存续期。
3	九、投资收益与分配（二）收益分配原则	<p>1、每份计划单位享有同等分配权利；</p> <p>2、本集合计划收益分配后计划单位净值不能低于计划单位面值，即收益分配基准日的计划单位净值减去每份集合计划的份额收益分配金额后不能低于计划单位面值；</p>	<p>1、每份计划单位享有同等分配权利；</p> <p>2、本集合计划收益分配后计划单位净值不能低于计划单位面值，即收益分配基准日的计划单位净值减去每份集合计划的份额收益分配金额后不能低</p>

		<p>3、<u>本集合计划建立定期分红机制：本集合计划进入开放期后，在符合以上集合计划分红条件，且有可供分配利润的前提下，管理人每个自然月进行收益分配，收益分配比例不低于该次可供分配利润的90%，并提前在管理人指定网站上披露；</u></p> <p>4、计划持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日的计划单位净值自动转为计划份额进行再投资；计划持有人未作选择的，按现金红利方式分配；</p> <p>5、计划持有人选择将本集合计划收益自动转为计划份额再投资的，免收参与费；</p> <p>6、收益分配时间和方案由管理人根据本集合计划收益情况拟定，经由托管人复核后确定，并在管理人指定网站上披露；</p> <p>7、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由持有人自行承担，与收益分配、退出集合计划的相关税负由持有人自行承担；</p> <p>8、法律、行政法规或监管机构另有规定的从其规定。</p>	<p>于计划单位面值；</p> <p>3、计划持有人可选择现金红利或将现金红利按除息日的计划单位净值自动转为计划份额进行再投资；计划持有人未作选择的，按现金红利方式分配；</p> <p>4、计划持有人选择将本集合计划收益自动转为计划份额再投资的，免收参与费；</p> <p>5、收益分配时间和方案由管理人根据本集合计划收益情况拟定，经由托管人复核后确定，并在管理人指定网站上披露；</p> <p>6、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由持有人自行承担，与收益分配、退出集合计划的相关税负由持有人自行承担；</p> <p>7、法律、行政法规或监管机构另有规定的从其规定。</p>
4	十五、集合计划的展期	<p>（一）本集合计划存续期届满时，管理人可以决定到期清算终止，或经监管机构批准后展期。</p> <p>（二）展期的条件</p> <p>在集合计划存续期届满前3个月，且不超过1个月的期间内，如满足以下条件，管理人有权向监管机构提出展期申请：</p> <p>1、集合计划运作情况良好，管理人、托管人未发生违法违规情况；</p> <p>2、管理人认为本集合计划继续运作符合委托人利益；</p> <p>3、管理人与托管人协商，托管人同意托管；</p> <p>4、中国证监会规定的其他条件。</p> <p>（三）展期的方式与程序</p> <p>1、管理人应于收到监管机构正式批准集合计划展期的文件后5个工作日内，将相关内容在管理人指定网站上公告。</p> <p>2、在管理人公告监管机构批准集合计划展期的文件后，同意展期的委托人需在集合计划到期前根据管理人公告的方式签订修改后的资产管理合同。至届满日为止，未签订修改后的资产管理合同的委托人视为不同意展期。管理人保障不同意展期的委托人到期合法终止合同的权利。</p> <p>（1）不同意展期的委托人可在集合资产管理合同有效期内按集合资产管理合同约定在开放日退出本集合计划；</p>	本集合计划无固定存续期限，不安排展期。

		<p>(2) 对于不同意展期且未退出本集合计划的委托人，管理人按本集合计划存续期届满日的集合计划单位净值将其份额退出。</p> <p>(四) 展期的成立或失败</p> <p>本集合计划存续期届满后的第一个工作日满足集合计划成立条件，即进入展期运作。如果同意展期的委托人持有总金额及人数低于集合计划的存续条件，本集合计划展期失败。</p> <p>(五) 展期情况备案</p> <p>本集合计划展期成立后 5 个工作日内，管理人将展期情况公告并报注册地中国证监会派出机构备案。</p>	
5	<p>十八、风险揭示及其相应风险防范措施</p> <p>(二) 特定风险 7、再投资风险</p>	<p>本集合计划投资于剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的固定收益类品种获得的本息收入或者到期的资金，可能由于市场利率的下降面临资金再投资时，将获得比之前较少的收益率，从而对本计划产生再投资风险。</p> <p>风险对策：针对此类风险，管理人将加强研究，把握宏观经济和财政货币政策趋势以及证券市场走势，通过战略和战术资产配置，动态调整组合久期并维持在适当水平，降低此类风险。</p>	<p>本集合计划投资于固定收益类品种获得的本息收入或者到期的资金，可能由于市场利率的下降面临资金再投资时，将获得比之前较少的收益率，从而对本计划产生再投资风险。</p> <p>风险对策：针对此类风险，管理人将加强研究，把握宏观经济和财政货币政策趋势以及证券市场走势，通过战略和战术资产配置，动态调整组合久期并维持在适当水平，降低此类风险。</p>
6	<p>二十三、合同的补充与修改 (一) 合同补充、修改的程序 3、合同变更的方式/第 (1) 条</p>	<p>需要变更本合同的，管理人和托管人应书面达成一致，并由管理人在指定网站以公告形式及书面通知等形式通知委托人并征求委托人意见，委托人应在公告发布之日起至公告约定合同变更成立日（从网站公告发布日至合同变更成立日至少有 20 个交易日，含公告发布日与合同变更成立日）内通过管理人指定网站做出答复。</p>	<p>需要变更本合同的，管理人和托管人应书面达成一致，并由管理人在指定网站以公告形式或书面通知等形式通知委托人并征求委托人意见，委托人应在公告发布之日起至公告约定合同变更成立日（从网站公告发布日至合同变更成立日至少有 20 个交易日，含公告发布日与合同变更成立日）内通过管理人指定网站做出答复。</p>

注：1、管理人已于 2012 年 12 月 6 日发布了《海通海蓝宝银集合资产管理计划业务运作调整公告》，本合同变更中，合同原条款指根据《海通海蓝宝银集合资产管理计划业务运作调整公告》而相应变更之后的条款。

2、本次合同变更生效后，本集合计划产品类型变更为债券型产品，属于中低风险收益品种。

3、《海通海蓝宝银集合资产管理计划说明书》、《海通海蓝宝银集合资产管理计划风险揭示书》根据资产管理合同做相应条款的变更。

## 二、变更流程

鉴于《证券公司客户资产管理业务管理办法》颁布生效后，中国证监会已不再受理证券公司集合资产管理计划的相关行政许可申请，管理人关于本集合计划变更存续期、投资范围等的法定程序因新的法律法规而发生了变化，因此，管理人将依据《证券公司客户资产管理业务管理办法》和本集合计划合同的相关规定变更存续期限、投资范围等条款。

管理人在管理人指定网站公布本公告即视为通过网站方式通知委托人，同时管理人将在 5 个工作日内以书面方式向委托人征询合同变更意见。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的 20 个工作日内开放日（即 2013 年 9 月 16 日、2013 年 9 月 23 日、2013 年 9 月 30 日、2013 年 10 月 8 日、2013 年 10 月 14 日和 2013 年 10 月 21 日）提出退出本集合计划的申请；委托人未在前述时间回复意见、也未在以上所述开放日退出计划，视为委托人同意合同变更。

合同变更于本公告后第 25 个工作日（即 2013 年 10 月 29 日）起生效，公告内容即成为资产管理合同的组成部分。对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人，管理人将统一在合同变更成立日次一工作日做强制退出处理。

管理人在合同变更后 5 个工作日内将合同变更情况向中国证券业协会报备，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。

附件：中国工商银行股份有限公司就《关于海通海蓝宝银集合资产管理计划合同变更的意见征询函》的确认函

上海海通证券资产管理有限公司

2013 年 9 月 13 日

---

## 回 执

上海海通证券资产管理有限公司：

贵司发来的《关于海通海蓝宝银集合资产管理计划合同变更的意见征询函》收悉，经研究，同意贵司在来函中所述的合同条款变更内容。

本确认函一式两份，双方各执一份。

中国工商银行股份有限公司（盖章）



签署日：2013 年 9 月 10 日