

关于华泰紫金高收益债集合资产管理合同变更的确认函

中国民生银行股份有限公司：

为了持续服务广大投资者，满足广大投资者对华泰紫金高收益债集合资产管理计划的投资需求，根据最新的《证券公司客户资产管理业务管理办法》和《证券公司集合资产管理业务实施细则》相关规定，经研究决定，我公司拟对华泰紫金高收益债集合资产管理计划的投资范围、业绩基准、终止和清算等条款进行变更，资产管理合同及计划说明书内容一并调整。资产管理合同变更后，资产托管协议内容与资产管理合同内容不一致的，以资产管理合同为准。条款变更内容和流程如下：

（一）主要修改内容

见附件。

（二）具体流程

- 1) 与贵行沟通，并邮寄书面确认函。
- 2) 收到贵行的确认函回执后，在我司网站公告并书面通知委托人征询委托人意见。
- 3) 合同变更内容生效后，按监管规定及时向监管机构报备合同变更材料。

以上事宜，请贵行确认。

华泰证券股份有限公司

2014年4月25日



附件一：《华泰紫金高收益债集合资产管理计划合同》变更明细表

序号	位置（原章节）	原合同条款	修改后的合同条款
1	四、集合资产管理计划的基本情况（四）1、投资范围	<p>本集合计划主要投资于具有良好流动性、依法发行的各类金融工具，包括中小企业私募债、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债、短期融资券、中期票据、资产支持受益凭证、债券正回购、债券逆回购、债券型基金、货币市场基金、银行存款、现金以及中国证监会允许投资的其他金融工具。</p>	<p>本集合计划主要投资于具有良好流动性、依法发行的各类金融工具，包括中小企业私募债、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债、短期融资券、中期票据（含非公开定向债务融资工具（PPN）等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）、股票质押式回购、资产支持受益凭证、债券正回购、债券逆回购、债券型基金、货币市场基金、银行存款、现金以及中国证监会允许投资的其他金融工具。</p> <p>本集合计划可参与股票质押式回购业务，质权人登记为管理人，但上市交易未满1个月、ST或*ST股票不得作为本集合计划质押式回购业务质押标的。委托人签署本合同即代表同意以上约定，本集合计划参与股票质押式回购无需再行征询委托人同意。</p>
2	四、集合资产管理计划的基本情况（四）2、资产配置比例	<p>本集合计划资产的配置比例如下：</p> <p>固定收益类资产比例为0%—100%，其中中小企业私募债的投资比例为0%-40%。现金类资产比例为0%—100%，其中退出开放期现金类资产的比例不低于5%。</p> <p>固定收益类资产包括中小企业私募债、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债、短期融资券、中期票据、资产支持受益凭证、债券型基金等；现金类资产包括现金、银行存款、货币市场基金和剩余期限小于7天的债券逆回购等。</p> <p>本集合计划参与债券正回购融入资金余额不超过集</p>	<p>本集合计划资产的配置比例如下：</p> <p>固定收益类资产比例为0%—100%，其中股票质押式回购的投资比例为0%-20%。现金类资产比例为0%—100%，其中退出开放期现金类资产的比例不低于5%。</p> <p>固定收益类资产包括中小企业私募债、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债、短期融资券、中期票据（含非公开定向债务融资工具（PPN）等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）、股票质押式回购、资产支持受益凭证、债券型基金等；现金类资产包括现金、银行存款、货币市场基金和剩余期限小于7天的债券逆回购等。</p> <p>本集合计划参与债券正回购融入资金余额不超过集合计划资</p>

		<p>合计划资产净值的 40%。</p> <p>本集合计划管理人将在集合计划成立之日起 3 个月内使集合计划的投资组合比例符合以上约定。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的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，但其投资比例不得超过资产净值的 7%。交易完成 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。</p> <p>如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内，并向管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券业协会报告。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>	<p>产净值的 40%。</p> <p>本集合计划管理人将在集合计划成立之日起 3 个月内使集合计划的投资组合比例符合以上约定。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的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，但其投资比例不得超过资产净值的 7%。交易完成 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。</p> <p>如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内，并向管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券业协会报告。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>
3	四、集合资产管理计划的基本情况（六）2、开放期	指集合计划成立后推广机构为委托人办理参与、退出业务的工作日。本集合计划的开放期包括参与开放期和退出开放期，其中参与开放期为计划成立后每满半年后的 10 个工作日（具体日期以管理人公告为准），接受委托人参与申请；退出开放期为计划成立后每满一年后的	指集合计划成立后推广机构为委托人办理参与、退出业务的工作日。本集合计划的开放期包括参与开放期和退出开放期，其中参与开放期为计划成立后满 1 年后的每个工作日（具体日期以管理人公告为准），接受委托人参与申请；退出开放期为计划成立后满 1 年后每周的周二（如果当周周二为非工作日，则当周不开放退出。具体

		3个工作日(具体日期以管理人公告为准),接受委托人退出申请。	日期以管理人公告为准),接受委托人退出申请。 考虑到保护原有客户的利益,开放期管理人有权通过公告形式对集合计划委托人参与规模上限、集合计划规模上限等要素进行限制。								
4	四、集合资产管理计划的基本情况(十一)1、参与费	不高于0.4%,详见本合同第五条的(一)	0%。								
5	四、集合资产管理计划的基本情况(十一)2、退出费	无	本集合计划退出费率不高于0.2%,退出费率随持有期限的增加而减少,如下表所示: <table border="1"> <thead> <tr> <th>持有期(P)</th> <th>退出费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>P<1月</td> <td>0.2%</td> </tr> <tr> <td>1月≤P<1年</td> <td>0.1%</td> </tr> <tr> <td>P≥1年</td> <td>0</td> </tr> </tbody> </table>	持有期(P)	退出费率	P<1月	0.2%	1月≤P<1年	0.1%	P≥1年	0
持有期(P)	退出费率										
P<1月	0.2%										
1月≤P<1年	0.1%										
P≥1年	0										
6	四、集合资产管理计划的基本情况(十一)5、业绩报酬	详见本合同第十二条的(三)。	无								
7	五、集合资产管理计划的基本情况(一)5、(1)参与费率	本集合计划参与费率不高于0.4%,参与费率随一次性参与金额的增加而减少,如下表所示: <table border="1"> <thead> <tr> <th>参与金额(一次性)(M)</th> <th>参与费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>M<500万</td> <td>0.4%</td> </tr> <tr> <td>500万元≤M</td> <td>每笔1000元</td> </tr> </tbody> </table>	参与金额(一次性)(M)	参与费率	M<500万	0.4%	500万元≤M	每笔1000元	本集合计划参与费为0。		
参与金额(一次性)(M)	参与费率										
M<500万	0.4%										
500万元≤M	每笔1000元										
8	五、集合资产管理计划的基本情况(二)5、(1)退出费用	本集合计划无退出费用。	本集合计划退出费率不高于0.2%,退出费率随持有期限的增加而减少,如下表所示: <table border="1"> <thead> <tr> <th>持有期(P)</th> <th>退出费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>P<1月</td> <td>0.2%</td> </tr> <tr> <td>1月≤P<1年</td> <td>0.1%</td> </tr> <tr> <td>P≥1年</td> <td>0</td> </tr> </tbody> </table>	持有期(P)	退出费率	P<1月	0.2%	1月≤P<1年	0.1%	P≥1年	0
持有期(P)	退出费率										
P<1月	0.2%										
1月≤P<1年	0.1%										
P≥1年	0										
9、	十一、集合计划的估值(七)估值方法		新增: 5、股票质押式回购按照成本列示,按股票质押式回购交易业务协议中约定的到期金额与首期金								

			额的差额平摊入每一天计提收益，收益到账日实际收益与计提收益的差额计入当天损益。
10	十二、集合计划的费用、业绩报酬 (一) 2、管理费	本集合计划无管理费。	管理费: 0.8%(管理人自 2014 年 7 月 1 日起开始收取管理费);
11	十二、集合计划的费用、业绩报酬 (三) 管理人的业绩报酬	<p>1、管理人收取业绩报酬的原则</p> <p>(1) 同一委托人在不同时间多次参与本计划的，管理人对委托人每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬。</p> <p>(2) 在本集合计划分红时、委托人退出时或集合计划终止时，管理人根据集合计划说明书所规定的提取条件和提取办法计提业绩报酬。集合计划分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。在委托人退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。</p> <p>(3) 在本集合计划分红时、委托人退出时或集合计划终止时，计算时期 T 内的年化收益率 r，若该年化收益率 r 小于或等于业绩基准，则管理人不提取业绩报酬；若年化收益率 r 大于业绩基准且小于或等于业绩基准，则管理人对上述集合计划份额提取年化收益率超过业绩基准部分的 60%作为业绩报酬。</p> <p>T 表示上一次业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然日天数（推广期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的上一次业绩报酬计提日指计划成立日；参与开放期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的上一次业绩报酬计提</p>	无

日指参与日)。

2、业绩报酬 (R) 的计提方法

如果 $r < \text{业绩基准}$, 则 $R=0$;
如果 $\text{业绩基准} \leq r$, 则 $R = \frac{r - \text{业绩基准}}{T/365} \times 60\% \times$

$= \text{本次业绩报酬计提日的累计单位净值}$

$= \text{上一次业绩报酬计提日的累计单位净值}$

$= \text{上一次业绩报酬计提日的单位净值}$

$= \text{提取业绩报酬的份额}$

$T = \text{上一次业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然日天数}$

注：推广期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的上一次业绩报酬计提日指计划成立日；参与开放期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的上一次业绩报酬计提日指参与日。

3、业绩报酬支付

在本集合计划分红时，托管人根据管理人的指令将分红资金（含业绩报酬）划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人，并将扣除业绩报酬的分红资金转入委托人的资金账户。

当集合计划份额退出或集合计划终止时，托管人根据管理人的指令将退出净值总额（含业绩报酬）划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人，并将扣除业绩报酬的退出款项转入委托人的资金账户。管理人业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管

		人不承担复核业绩报酬的责任。	
12	二十、集合计划终止和清算 (一) 有下列情形之一的, 集合计划应当终止: 5、	存续期内, 委托人人数少于 2 人或连续 20 个交易日集合计划资产净值低于 3000 万元;	存续期内, 委托人人数少于 2 人;
13	二十、集合计划终止和清算 (一) 有下列情形之一的, 集合计划应当终止: 7、	7、 自本计划成立日起每满一年, 若年化收益率不大于当期业绩基准, 则本集合计划提前终止;	删除此第 7 点。
14	二十三、风险揭示 (二) 本集合计划特有风险	3、提前终止集合计划的风险 自本计划成立日起每满一年, 若年化收益率不大于当期业绩基准, 则本集合计划提前终止。	3、股票质押回购投资风险 (1)【信用风险】融入方违约, 质押标的证券被违约处置后, 可能无法足额偿付债务的风险。 (2)【流动性风险】集合资产管理计划在股票质押回购待购回期间提前终止, 但回购未到期或违约处置未完成可能导致计划客户无法及时收回投资的风险。 (3)【限售股风险】标的证券为有限售条件股份, 初始交易或补充质押成交当日, 司法机关对标的证券进行司法冻结的, 中国结算深圳分公司优先办理司法冻结, 相应交易交收失败的风险。质押标的证券为有限售条件股份, 违约处置时仍处于限售期, 无法及时处置的风险。 (4)【司法冻结风险】标的证券被质押后, 因资金融入方的原因导致标的证券被司法冻结或强制执行, 标的证券无法被及时处置的风险。 (5)【未履行职责风险】证券公司未按照约定尽职履行交易申报、合并管理、盯市、违约处置等职责从而损害客户利益的风险。

序号	位置(原章节)	原条款	修改后的条款
1	集合计划基本基本信息 开放期	本集合计划的开放期包括参与开放期和退出开放期,其中参与开放期为计划成立后每满半年后的10个工作日,接受委托人参与申请;退出开放期为计划成立后每满一年后的3个工作日,接受委托人退出申请。	<p>本集合计划的开放期包括参与开放期和退出开放期,其中参与开放期为计划成立后满1年后的每个工作日(具体日期以管理人公告为准),接受委托人参与申请;退出开放期为计划成立后满1年后每周的周二(如果当周周二为非工作日,则当周不开放退出。具体日期以管理人公告为准),接受委托人退出申请。</p> <p>考虑到保护原有客户的利益,开放期管理人有权通过公告形式对集合计划委托人参与规模上限、集合计划规模上限等要素进行限制。</p>
2	集合计划基本基本信息 相关费率	<p>1、参与费:不高于0.4%,详见“参与费”部分;</p> <p>2、托管费:0.1%;</p> <p>3、管理费:无;</p> <p>4、业绩报酬:在本集合计划分红时、委托人退出时或集合计划终止时,管理人根据集合计划说明书所规定的提取条件和提取办法计提业绩报酬,详见“费用报酬”部分。</p>	<p>1、参与费:0%;</p> <p>2、托管费:0.1%;</p> <p>3、管理费:0.8%(管理人自2014年7月1日起开始收取管理费);</p> <p>4、业绩报酬:无。</p>
3	集合计划基本基本信息 投资范围	本集合计划主要投资于具有良好流动性、依法发行的各类金融工具,包括中小企业私募债、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债、短期融资券、中期票据、资产支持受益凭证、债券正回购、债券逆回购、债券型基金、货币市场基金、银行存款、现金以及中国证监会允许投资的其他金融工具。	<p>本集合计划主要投资于具有良好流动性、依法发行的各类金融工具,包括中小企业私募债、国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转债、可分离债、短期融资券、中期票据(含非公开定向债务融资工具(PPN)等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具)、股票质押式回购、资产支持受益凭证、债券正回购、债券逆回购、债券型基金、货币市场基金、银行存款、现金以及中国证监会允许投资的其他金融工具。</p> <p>本集合计划可参与股票质押式回购业务,质权人登记为</p>

			管理人，但上市交易未满1个月、ST或*ST股票不得作为本集合计划质押式回购业务质押标的。委托人签署本合同即代表同意以上约定，本集合计划参与股票质押式回购无需再行征询委托人同意。								
4	集合计划的参与参与费	<p>本集合计划参与费率不高于0.4%，参与费率随一次性参与金额的增加而减少，如下表所示：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>参与金额（一次性）（M）</th> <th>参与费</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>M<500万</td> <td>0.4%</td> </tr> <tr> <td>500万元≤M</td> <td>每笔1000元</td> </tr> </tbody> </table>	参与金额（一次性）（M）	参与费	M<500万	0.4%	500万元≤M	每笔1000元	本集合计划参与费为0。		
参与金额（一次性）（M）	参与费										
M<500万	0.4%										
500万元≤M	每笔1000元										
5	集合计划的退出退出费	<p>本集合计划无退出费用。</p>	<p>本集合计划退出费率不高于0.2%，退出费率随持有期限的增加而减少，如下表所示：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>持有期（P）</th> <th>退出费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>P<1月</td> <td>0.2%</td> </tr> <tr> <td>1月≤P<1年</td> <td>0.1%</td> </tr> <tr> <td>P≥1年</td> <td>0</td> </tr> </tbody> </table>	持有期（P）	退出费率	P<1月	0.2%	1月≤P<1年	0.1%	P≥1年	0
持有期（P）	退出费率										
P<1月	0.2%										
1月≤P<1年	0.1%										
P≥1年	0										
6	费用、报酬费用种类		<p>增加：</p> <p>5、管理费：</p> <p>自2014年7月1日起，本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的0.8%年费率计提，计算方法如下：</p> $T = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$ <p>T为每日应计提的集合计划托管费</p> <p>E为前一日集合计划资产净值</p> <p>集合计划管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由集合计划管理人于次月首日起5个工作日内向集合计划托管人发送集合计划托管费划付指令，经集合计划托管人复核后于2个工作日内从集合计划资产中一次性支付给集合计划管理人。</p>								

7	<p>费用、报酬 业绩报酬</p>	<p>1、本集合计划的业绩基准为中国人民银行公布的一年期定期存款利率+150BP，存续期内如遇中国人民银行利率调整，则按利率执行的时间进行加权平均。该业绩基准仅供投资者参考，不作为管理人对委托人承诺。管理人并不保证本集合计划资产投资不受损失，也不保证最低收益。</p> <p>2、管理人收取业绩报酬的原则</p> <p>(1) 同一委托人在不同时间多次参与本计划的，管理人对委托人每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬。</p> <p>(2) 在本集合计划分红时、委托人退出时或集合计划终止时，管理人根据集合计划说明书所规定的提取条件和提取办法计提业绩报酬。集合计划分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。在委托人退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。</p> <p>(3) 在本集合计划分红时、委托人退出时或集合计划终止时，计算时期 T 内的年化收益率 r，若该年化收益率 r 小于或等于业绩基准，则管理人不提取业绩报酬；若年化收益率 r 大于业绩基准且小于或等于业绩基准，则管理人对上述集合计划份额提取年化收益率超过业绩基准部分的 60% 作为业绩报酬。</p> <p>T 表示上一次业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然日天数（推广期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的上一次业绩报酬计提日指计划成立日；参与开放期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的上一次业绩报酬计提日指参与日）。</p> <p>3、业绩报酬 (R) 的计提方法</p> <p>如果 $r < \text{业绩基准}$，则 $R=0$；</p> <p>如果 $\text{业绩基准} \leq r$，则 $R = \text{参与份额} \times (r - \text{业绩基准}) \times 60\% \times T / 365$</p> <p>= 本次业绩报酬计提日的累计</p>	无
---	-----------------------	---	---

		<p>单位净值</p> <p>=上一次业绩报酬计提日的累计单位净值</p> <p>=上一次业绩报酬计提日的单位净值</p> <p>=提取业绩报酬的份额</p> <p>T=上一次业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然日天数</p> <p>注：推广期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的上一次业绩报酬计提日指计划成立日；参与开放期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的上一次业绩报酬计提日指参与日。</p>	
		<p>4、业绩报酬支付</p> <p>在本集合计划分红时，托管人根据管理人的指令将分红资金（含业绩报酬）划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人，并将扣除业绩报酬的分红资金转入委托人的资金账户。</p> <p>当集合计划份额退出或集合计划终止时，托管人根据管理人的指令将退出净值总额（含业绩报酬）划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬支付给管理人，并将扣除业绩报酬的退出款项转入委托人的资金账户。</p> <p>管理人业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不承担复核业绩报酬的责任。</p>	
8	<p>终止和清算</p> <p>1、有下列情形之一的，集合计划应当终止：（5）</p>	<p>存续期内，委托人人数少于 2 人或连续 20 个交易日集合计划资产净值低于 3000 万；</p>	<p>存续期内，委托人人数少于 2 人；</p>
9	<p>终止和清算</p> <p>1、有下列情形之一的，集合计划应当终止：（7）</p>	<p>自本计划成立日起每满一年，若年化收益率不大于当期业绩基准，则本集合计划提前终止；</p>	<p>删除此第（7）点。</p>