

关于旗峰避险增值集合资产管理计划

合同及说明书变更的公告

尊敬的各位委托人：

由东莞证券股份有限公司（以下简称“我公司”）管理，中国银行股份有限公司（以下简称“托管人”）托管的旗峰避险增值集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）自成立以来，一直规范运作，稳健运营。为了满足监管法规的要求，并且更好地为该集合计划委托人提供投资理财服务，根据相关法律法规及《旗峰避险增值集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《管理合同》）第七十条“合同的变更”的规定，我公司拟对《管理合同》及《旗峰避险增值集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）部分条款进行变更。

本次修订主要变更《管理合同》与《说明书》中有关集合计划自有资金参与、投资限制、合同变更条款等事项，并将管理人名称“东莞证券有限责任公司”变更为“东莞证券股份有限公司”，托管人由“中国银行股份有限公司”变更为“中国银行股份有限公司上海市分行”。主要修订内容详见附件（《旗峰避险增值集合资产管理计划法律文件变更前后条款对照表》）。

本次合同变更已取得托管人的同意，根据合同约定，管理人现以公告形式通知委托人，本次合同变更征询意见期间为 2015 年 1 月 29 日至 2015 年 2 月 24 日。如委托人不同意变更合同的，可于 2015 年 2 月 25 日前往本集合计划推广机构或根据推广机构提供的其他方式

办理退出事宜；委托人在上述日期内未提出异议或未办理退出手续的，视同委托人同意合同变更。

更新后的本集合计划《管理合同》及《说明书》通过管理人网站进行披露，敬请各位委托人认真阅读。变更后的合同将于 2015 年 2 月 26 日生效。

特此公告！

东莞证券股份有限公司

2015年1月29日

附件：

旗峰避险增值集合资产管理计划法律文件变更前后条款对照表

修订前	修订后
《旗峰避险增值集合资产管理计划资产管理合同》	《旗峰避险增值集合资产管理计划资产管理合同》（修订）
第一部分 集合计划的基本情况	
第十条 投资范围和投资比例 1、投资范围 本集合计划主要投资于具有良好流动性、中国境内依法公开发行的债券、债券型基金、银行存款及中国证监会允许投资的其他金融工具，不允许投资于股票、权证等权益类品种。 2、投资比例 本集合计划资产的配置比例如下： （1）固定收益证券，包括国债、金融债、公司债、中小企业私募债、可转债、分离交易可转债、短期融资券、资产支持受益凭证、债券型证券投资基金、分级基金的优先级份额部分等：0-95%。 （2）现金类资产，包括银行存款、一年内到期的央行票据、期限在七天以内（含七天）的债券逆回购、货币市场基金等：5-100%。 （3）证券正回购融入资金余额不超过计划资产净值的40%。 委托人知悉，作为证券公司的客户资产管理业务，为了集合计划委托人的权益最大化，本集合计划可以投资于管理人及管理人有关关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券或者从事其他重大关联交易。委托人参与本集合计划即视为同意集合计划资产进行上述交易，事后管理人应告知托管人，同时向证券交易所报告，并在管理人网站以公告方式向委托人披露。	第十条 投资范围和投资比例 1、投资范围 本集合计划主要投资于具有良好流动性、中国境内依法公开发行的债券、债券型基金、银行存款及中国证监会允许投资的其他金融工具，不允许投资于股票、权证等权益类品种。 2、投资比例 本集合计划资产的配置比例如下： （1）固定收益证券，包括国债、金融债、公司债、中小企业私募债、可转债、分离交易可转债、短期融资券、资产支持受益凭证、债券型证券投资基金、分级基金的优先级份额部分等：0-100%。 （2）现金类资产，包括银行存款、一年内到期的央行票据、期限在七天以内（含七天）的债券逆回购、货币市场基金等：0-100%；其中开放期保持现金类资产比例不低于5%。 （3）证券正回购融入资金余额不超过计划资产净值的40%。 委托人知悉，作为证券公司的客户资产管理业务，为了集合计划委托人的权益最大化，本集合计划可以投资于管理人及管理人有关关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券或者从事其他重大关联交易。委托人参与本集合计划即视为同意集合计划资产进行上述交易，事后管理人应告知托管人，同时向证券交易所报告，并在管理人网站以公告方式向委托人披露。

第五部分 集合计划存续期间委托人的退出	
第二十七条 退出的费用及其用途 1、本集合计划退出费主要用于支付开展退出业务必要的手续费。 2、在本集合计划存续期内，委托人申请退出的份额持有期限不满六个月的，退出费率为 0.2%；委托人申请退出的份额持有期限已满六个月及以上的，不收取退出费用，委托人退出金额为退出总额扣减退出费用后的余额，计量单位为人民币元，退出金额保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额计入集合计划损益。 	第二十七条 退出的费用及其用途 1、本集合计划退出费主要用于支付开展退出业务必要的手续费。 2、在本集合计划存续期内，委托人申请退出的份额持有期限不满六个月的，退出费率为 0.2%；委托人申请退出的份额持有期限已满六个月及以上的，不收取退出费用，委托人退出净额为退出金额扣减退出费用后的余额，计量单位为人民币元，退出净额保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额计入集合计划损益。
第七部分 管理人自有资金参与安排	
第三十二条 参与比例和金额 管理人以自有资金参与本集合计划。管理人自有资金参与比例为集合计划成立日募集资金规模（不含管理人自有资金参与部分）的 5%，参与资金的上限为 5000 万元人民币，并承诺在集合计划存续期内不退出。	第三十二条 参与比例和金额 管理人可以自有资金参与本集合计划。 推广期内，管理人自有资金参与比例为集合计划成立日募集资金规模（不含管理人自有资金参与部分）的 5%，参与资金的上限为 5000 万元人民币。 存续期内，管理人自有资金参与比例不得超过监管部门规定的最高比例上限，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限的，管理人应当尽快安排自有资金退出事宜并进行公告，以符合法规要求。 集合计划存续期间，管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时，应当提前 5 日告知客户和托管人。 为应对集合计划巨额赎回，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提

	下，管理人以自有资金参与或退出本集合计划可不受前款规定限制。
第十一部分 集合计划费用	
..... 2) 业绩报酬提取方法: 以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日(以下简称“上一个业绩报酬计提日”,如未发生业绩报酬计提,推广期内参与的,以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日,存续期内参与的,以参与当日为上一个业绩报酬计提日,下同)到本次业绩报酬计提日的年化收益率,作为计提业绩报酬的基准。 	 2) 业绩报酬提取方法: 以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日(以下简称“上一个业绩报酬计提日”,如未发生业绩报酬计提,推广期内参与的,以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日,存续期内参与的,以参与当日为上一个业绩报酬计提日,下同)到本次业绩报酬计提日为计提区间计算年化收益率。
第十三部分 信息披露	
第五十三条 定期报告 4、对账单 在存续期内,管理人在每季度结束后的 15 个工作日内通过书面或电子邮件方式向委托人提供对账单;年度对账单在每年度结束后的 15 个工作日内对所有委托人寄送。对账单内容应包括计划差异性、计划风险、委托人持有计划份额的数量及净值,参与、退出明细,以及收益分配等情况。委托人还可自行通过推广机构查询其账户情况。	第五十三条 定期报告 4、对账单 在存续期内,管理人在每季度结束后的 15 个工作日内通过书面或电子邮件方式向委托人提供对账单;年度对账单在每年度结束后的 15 个工作日内对所有委托人寄送。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值,参与、退出明细,以及收益分配等情况。委托人还可自行通过推广机构查询其账户情况。
第十九部分 风险揭示	
10、合同变更风险	10、合同变更风险

对于除法律法规以及业务规则等的变化之外的其它原因导致的本集合计划资产管理合同变更，管理人将以管理人网站公告和书面两种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生效之日内给出书面或其他约定方式的答复。自合同变更公告发布之日起至公告约定合同变更生效日的期间内，本集合计划允许委托人退出集合计划，委托人不同意变更的，可在公告日起至合同变更生效之日内提出退出申请，逾期未退出且未有意见答复的，视同委托人同意本合同变更，委托人明确答复不同意变更但逾期未退出的，也视同委托人同意本合同变更，从而带来风险。 应对措施： 本集合计划管理人将以管理人网站公告和书面两种形式将合同变更事项尽力通知投资者，并且从网站公告发布日至合同变更生效日至少有 10 个交易日(含公告发布日与合同变更生效日)，以降低合同变更等带来的风险。	对于除法律法规以及业务规则等的变化之外的其它原因导致的本集合计划资产管理合同变更，管理人将及时通过管理人网站披露及通过邮寄、电子邮件或手机短信平台其中之一的方式通告委托人合同变更内容并征求委托人意见，委托人应在通告发出后 5 个工作日内给出书面或其他约定方式的答复。委托人不同意合同变更的，有权于异议期限届满后在管理人所指定的“特别开放期内”提出退出申请，逾期未退出或未有意见答复的，视同委托人同意本合同变更，委托人明确答复不同意变更但逾期未退出的，也视同委托人同意本合同变更，从而带来风险。 应对措施： 本集合计划管理人将以管理人网站公告及通过邮寄、电子邮件或手机短信平台其中之一的方式将合同变更事项尽力通知投资者，并且管理人将在开放日前 5 个工作日内发出通告，并在开放公告中提示不同意管理人对合同变更的委托人在异议期限届满后于管理人所指定的“特别开放期内”申请退出本集合计划，以降低合同变更等带来的风险。
第二十二部分 合同的变更	
第七十条 本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理。管理人经托管人同意，有权对本合同做出不影响委托人实质利益的调整和补充，并及时在管理人网	第七十条 本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理。管理人经托管人同意，有权对本合同做出不影响委托人实质利益的调整和补充，并

站通告委托人。 管理人和托管人应书面达成一致，对本合同做出影响委托人实质利益的调整和补充的，管理人应当及时通过管理人网站披露及通过邮寄、电子邮件或手机短信平台其中之一的方式通告委托人合同变更内容并征求委托人意见，如果委托人未在通告发出后的 15 日内提出异议的，应视为其同意管理人对本合同做出变更。 委托人明确表示不同意管理人对合同做出的补充或修改内容的，有权在管理人发出通告时规定的 15 日异议期限届满后的首个开放日提出退出申请。管理人须在开放日前 15 个工作日发出通告，并在开放公告中提示不同意管理人对合同变更的委托人在异议期限届满后的首个开放期内退出本集合计划。如果委托人既不同意合同变更，又没有在异议期限届满后的首个开放期内及时退出本集合计划，应视为其同意管理人对本合同做出变更。 合同变更事项需要经过中国证监会同意的，包括但不限于变更集合计划管理的期限、规模上限、投资范围、投资比例、管理人或托管人的报酬标准以及中国证监会规定的其他事项，应当经中国证监会同意后方可变更。 合同变更后，委托人、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权力，履行相应义务。	及时在管理人网站通告委托人。 由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致，在管理人网站公告及通过邮寄、电子邮件或手机短信平台其中之一的方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的，应于管理人通告的异议期限届满后，在管理人所指定的“特别开放期内”提出退出申请；委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更，但没有在管理人所指定的“特别开放期内提出退出申请的，视为委托人同意合同变更。委托人同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致后变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。 合同变更后，委托人、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权力，履行相应义务。
第二十四部分 其他事项	
.....	 增加“或有事项”内容:

	本合同所称的或有事件是指，根据相关法律法规的规定，管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。 委托人在此同意，如果或有事件发生，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司，并无须就此项变更和委托人另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告委托人。管理人保障委托人退出本集合计划的权利，并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。 管理人应当保证该从事资产管理业务的公司具备开展此项业务的相关资格，并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。 管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。
《旗峰避险增值集合资产管理计划说明书》	《旗峰避险增值集合资产管理计划说明书》(修订)
第十一部分 投资限制	
	删除以下内容：“4、将集合计划投资于一家公司发行的证券超过集合计划资产净值的10%；因客观原因导致集合计划的投资组合比例不符合集合资产管理合同约定或有关规定的，计划管理人应在十个工作日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定； 5、管理人所管理的客户资产（含本集合计划资产）投资于一家公司发行的证券，按证券面值计算，超过该证券发行总量的10%；因客观原因导致集合计划的投资组合比例不符合集合资产管理合同约定或有关规定的，计划管理人应在十个工作日内进行调整。法律法规另有规定时，从其规定；”

第十六部分 集合计划的退出	
..... （四）在集合计划存续期间，计划管理人、推广机构、注册登记机构不得为委托人办理集合计划份额转让事宜。 	 （四）在集合计划存续期间，计划管理人、推广机构、注册登记机构不得为委托人办理集合计划份额转让事宜（法律、行政法规另有规定的除外）。
第十九部分 信息披露	
..... （一）在集合计划成立后，计划管理人应当每季度及每年度在管理人网站披露集合计划的管理报告和托管报告，并报计划管理人住所地中国证监会派出机构备案。 计划管理人提交上述报告的同时，还应当提交由计划管理人风险管理与控制部门对集合计划独立出具的风险管理与控制报告。 资产管理报告的内容包括但不限于：报告期内集合计划运作情况，资产配置情况、主要财务指标、投资组合情况和价值变动情况等。资产管理报告由管理人编制，经托管人复核后公告。 本集合计划管理人应聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划的运营情况进行年度审计，出具会计年度审计报告，审计意见应当在计划管理人网站披露，并报中国证监会及计划管理人住所地中国证监会派出机构备案。 季度报告应在每个会计年度的每个季度结束后十五日内公告；年度报告在会计年度结束后六十日内公告。	 （一）在集合计划成立后，计划管理人应当每季度及每年度在管理人网站披露集合计划的管理报告和托管报告，并报计划管理人住所地中国证监会派出机构备案。 资产管理报告的内容包括但不限于：报告期内集合计划运作情况，资产配置情况、主要财务指标、投资组合情况和价值变动情况等。资产管理报告由管理人编制，经托管人复核后公告。 本集合计划管理人应聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划的运营情况进行年度审计，出具会计年度审计报告，审计意见应当在计划管理人网站披露，并报中国证监会及计划管理人住所地中国证监会派出机构备案。 季度报告应在每个会计年度的每个季度结束后十五日内公告；年度报告在会计年度结束后六十日内公告。
其他修订内容	
1、《管理合同》与说明书中“东莞证券有限责任公司”修改为“东莞证券股份有限公司”；托管人由“中国银行股份有限公司”变更为“中国银行股份有限公司上海市分行”，并更新管理人和托管人的相应信息； 2、《管理合同》中所涉及变更内容，说明书进行相应变更； 3、《管理合同》与说明书中涉及证监会及证券业协会关于证券公司资产管理业务法律法规名称、日期等信息相应进行更新。	