

关于修改日信证券长安 2 号集合计划资管合同的意见征询函

致渤海银行股份有限公司：

根据业务发展需求，依据《日信证券长安 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称“本资管合同”）第二十五章“合同的补充、修改与变更”的相关约定，对本资管合同投资范围的约定进行变更，具体内容如下：

【修改内容 1】

资管合同第四章“集合计划的基本情况”第（二）款第 2 条“投资范围”增加“国债期货、利率互换”两种投资标的。

【修改内容 2】

资管合同第四章“集合计划的基本情况”第（二）款第 3 条“资产配置比例”增加以下配置比例限制：

（3）国债期货，持有的国债期货合约价值不超过债券持仓市值的 200%。

（4）利率互换，持有的利率互换合约价值不得超过债券持仓市值的 50%。

【修改内容 3】

资管合同第十一章“集合计划估值”第（七）款估值方法增加以下内容：

“5、国债期货估值办法

国债期货按估值日的结算价估值；估值日无结算价的，以最近交易日的结算价估值。”

以上合同变更内容特向贵行征求意见，请贵行在本函下方回执意见，感谢贵行的支持与配合！

资产管理人：国融证券股份有限公司

2017 年 2 月 28 日

渤海银行股份有限公司对修改本资管合同意见的回复：

我行对关于修改日信证券长安 2 号资管合同的意见为：

同意

不同意

资管合同修改后，望管理人按照资管合同的约定及时履行后续事项。

托管人：渤海银行股份有限公司（盖章）

负责人/授权代表：（签字）

日期：2017.3.13



A handwritten signature in black ink, appearing to be "Jinwei".

