

上海新南洋股份有限公司

关于签订资产管理计划合同补充协议的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

上海新南洋股份有限公司(以下简称“公司”)于2017年3月14日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及上海证券交易所网站(<http://www.sse.com.cn>)上发布了《关于设立定向资产管理计划的公告》(临:2017-005)。公司(作为委托人)与方正证券股份有限公司(作为资产管理人,以下简称“方正证券”或“管理人”)及宁波银行股份有限公司(作为托管人,以下简称“宁波银行”或“托管人”),成立高客专享2号定向资产管理计划,签订《高客专享2号定向资产管理计划资产管理合同》(以下简称“资产管理计划合同”)和相关附件资料。

根据公司第八届二十三董事会对公司经营班子的授权,现根据资产管理业务需要,公司、方正证券及宁波银行于2017年8月26日签订了《高客专享2号定向资产管理计划资产管理合同之补充协议》(以下简称“补充协议”),具体内容如下:

一、变更和补充原管理合同条款

(一)对资产管理合同第五条第一款第1项“委托人的委托资产”项下条款进行变更。

原合同约定为:

“注:若本项目进行网下申购的,则委托资产总额应符合网下申购新股的要求。证券资产的初始委托价值6000万元应当以资产到账日当日的公允价值为准。若项目实施时出现总额不足的情况,不足部分由委托人、管理人及托管人签订相应补充协议后追加相应数量的标的股票”。

现变更为:

“注:若本项目进行网下申购的,则委托资产总额应符合网下申购新股的要求。

证券资产的委托价值应不低于 6000 万元，以资产到账日当日的公允价值为准（按到账日收盘价计算）。若因证券资产市值发生变化导致本计划不符合网下新股申购市值要求的，则由管理人以《追加通知书》（见附件一）的形式，及时通知委托人追加相应数量的标的股票以满足市值需求。管理人在核实资产到账后当日出具《委托资产到账确认书》（见附件二）。若委托人未按照《追加通知书》的要求追加委托资产导致本计划无法参与网下新股申购的，管理人及托管人不承担责任。”

（二）补充相关条款

现补充为：

为避免歧义，各方确认：委托人按照资产管理合同第五条第一款“委托人的委托资产”约定足额向本计划交付委托资产且管理人确认委托资产全部到账后，管理人应向委托人及托管人以传真形式发送《委托资产起始运作通知书》并确定本计划委托资产运作起始日。

若本计划参与新股申购发生现金资产不足以覆盖中签新股缴款时，管理人应以传真或邮件的形式通知委托人及时追加现金资产。

（三）对资产管理合同第十四条“资产管理业务的费用与税收”第(二)款第 3 项“业绩报酬”进行变更。

原合同约定为：

“3、业绩报酬

业绩比较基准为 0%/年。当投资收益小于或等于 0%/年时，不提取业绩报酬；当投资收益大于 0%/年时，委托人应该按本计划大于 0%/年部分所获投资收益的 10%向管理人支付业绩报酬。即业绩报酬计提比例为 10%

管理人业绩报酬计算公式

业绩报酬= 委托资产日均本金×MAX（年化收益率-业绩比较基准, 0）×业绩报酬计提比例×业绩报酬计提期间天数÷365

其中：

业绩报酬计提期间指上次业绩报酬计提日（不含，若无，则为起始运作日）至本次业绩报酬计提日（含），下简称“期间”。

投资收益：是指业绩报酬计提期末账户存有的全部现金资产的资产净值减去期初委托的现金资产的资产净值的差额，再减去期间银行托管专户净流入现金金额。

即：投资收益=业绩报酬计提期末委托现金资产的资产净值(仅包括现金资产)－期初委托现金资产的资产净值－∑ 期间委托人追加现金资金+∑ 期间委托人提取的现金资金。

收益率=投资收益 ÷ 委托资产日均本金

委托资产日均本金=∑ 委托资产每日本金 ÷ 期间天数

年化收益率 = 收益率*365 ÷ 期间天数

管理人的业绩报酬在业绩报酬计提日由管理人计算并计提，业绩报酬计提日为每年 11 月 20 日（遇节假日顺延至下一工作日）或委托资产提取日或合同终止日。业绩报酬计提区间为上一次业绩报酬计提日（不含）至本次业绩报酬计提日（含）。

管理人业绩报酬的支付：管理人计算并计提的业绩报酬经与托管人核对无误后（管理人可先与委托人核对一致），由管理人向托管人发送用于业绩报酬支付的划款指令，托管人收到指令后予以执行。”

现变更为：

“3、业绩报酬

扣除委托人初始及追加委托资产中的证券资产自身价格波动造成的损益和按委托人指令（如有）进行投资产生的损益影响之后的投资收益，当投资收益小于或等于 0 时，不提取业绩报酬；当投资收益大于 0 时，委托人应该按本计划所获投资收益的 10%向管理人支付业绩报酬。即业绩报酬计提比例为 10 %

管理人业绩报酬计算公式：

业绩报酬=投资收益×业绩报酬计提比例

其中：投资收益为扣除委托人初始及追加委托资产中的证券资产自身价格波动造成的损益和按委托人指令（如有）进行投资产生的损益影响之后的收益

具体说明如下：

委托人初始委托**证券**资产损益为：

序号	股票标识	期初数量	期末数量	期初价格	期末价格	期间分红
1	A_1	m_1	k_1	p_1	q_1	div_1
2	A_2	m_2	k_2	p_2	q_2	div_2
.....
n	A_n	m_n	k_n	p_n	q_n	div_n

注：产品运行期间可能出现分红送股

$$profit_A = \sum_{i=1}^n k_i \times q_i - m_i \times p_i + div_i$$

委托人追加委托**证券**资产损益为：

序号	股票标识	追加数量	期末数量	追加时价格	期末价格	追加日至期末分红
1	B_1	m_1	k_1	p_1	q_1	div_1
2	B_2	m_2	k_2	p_2	q_2	div_2
.....
n	B_n	m_n	k_n	p_n	q_n	div_n

注：追加日至期末期间可能出现分红送股

$$profit_B = \sum_{i=1}^n k_i \times q_i - m_i \times p_i + div_i$$

按委托人要求进行投资产生的损益（如有）为：

序号	股票标识	指令买入数量或持有数量	指令卖出数量	买入价格	卖出价格	持有期间分红
1	C_1	m_1	m_1	p_1	q_1	div_1
2	C_2	m_2	m_2	p_2	q_2	div_2
.....
n	C_n	m_n	m_n	p_n	q_n	div_n

注：持有或买入至卖出期间可能出现分红

按委托人要求进行投资产生损益的计算范围仅适用于其初始委托及追加委托的**证券**；即上表内的 C_i 必须符合下列特征：

$$C_i \in \{A_1, A_2, \dots, A_n\} \cup \{B_1, B_2, \dots, B_n\}$$

$$profit_C = \sum_{i=1}^n (q_i - p_i) \times m_i + div_i$$

期末未全部卖出的股票 C_i ，按初始委托或追加委托**证券**资产计算损益；

设期初产品净值为 V_1 ；期末产品净值为 V_2 ；

若期间发生现金提取，则应扣减与提取现金等额的初始委托资金；

设上文中的投资收益为x：

$$x = V_2 - (V_1 - \text{期间提取现金}) - \text{profit}_A - \text{profit}_B - \text{profit}_C - \text{其他费用}$$

其他费用的解释权归属于管理人，但需征得委托人同意。

管理人的业绩报酬在业绩报酬计提日由管理人计算并计提，业绩报酬计提日为每年11月20日（遇节假日顺延至下一工作日）、委托资产提取日或合同终止日任一日期。业绩报酬计提区间为上一次业绩报酬计提日（不含）至本次业绩报酬计提日（含）

管理人业绩报酬的支付：管理人计算并计提的业绩报酬经与托管人核对无误后（管理人可先与委托人核对一致），由管理人向托管人发送用于业绩报酬支付的划款指令，托管人收到指令后予以执行。”

（四）对原合同第十二条第五款“估值程序”进行变更：

原合同约定为：

“管理人于每工作日（简称“估值日”）对当日的委托资产净值进行估值。托管人每个工作日对管理人的估值结果进行复核，并在每周最后一个估值日对当周委托资产净值及估值表和管理人进行对账。”

现变更为：

“管理人于每工作日（简称“估值日”）对当日的委托资产净值进行估值。托管人每个工作日对管理人的估值结果进行复核，并于每个工作日对当日委托资产净值及估值表和管理人进行对账。”

二、补充约定追加资产相关信息

根据《资产管理计划合同之补充协议》条款约定，管理人以《追加通知书》通知公司追加相应标的股票，具体如下：

本次追加委托资产的总量为委托人持有的交大昂立证券（股票代码：600530）450万股。

公司将根据项目后续进展情况及时履行信息披露义务，敬请投资者关注并注意投资风险。

以上事项，特此公告。

上海新南洋股份有限公司

董事会

2017年8月30日