

关于变更日信证券长安 2 号集合资产管理计划资产管理合同条款的公告

日期：2018-06-06 | 分享：

尊敬的日信证券长安 2 号集合资产管理计划委托人：

应中国证券投资基金业协会要求，结合《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发〔2018〕106 号，以下简称“资管新规”）的相关要求，现依据中国证监会《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》以及《日信证券长安 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（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，经托管人渤海银行股份有限公司同意（详见附件 5：《关于修改日信证券长安 2 号集合资产管理计划资产管理合同的意见征询函-托管行》），管理人国融证券股份有限公司对本资管合同相关条款进行变更，内容如下：

1、变更首次参与金额及追加参与资金的最低金额

原合同约定单个客户首次参与金额不低于 500 万元，追加应以 10 万元的整数倍递增；修改后的合同约定单个客户首次参与金额不低于 100 万元，在推广期或开放期追加参与资金的最低金额为人民币 10,000 元。

2、增加对存续期规模上限的要求

原合同约定存续期不设规模上限；修改后的合同约定存续期上限为 50 亿份。

3、修改投资范围和投资配置比例，并按照资管新规要求明确了产品类型

(1) 修改后的合同明示了本产品为固定收益类集合资产管理计划且为私募产品；

(2) 对投资范围和投资配置比例作如下变更

债券：在银行间市场和交易所市场交易的国债、央行票据、各类金融债（含政策性金融债、次级债、混合资本债、二级资本债、证券公司债、证券公司次级债券、非银行金融机构债等）、地方政府债、企业债、公司债（包括在证券交易所及机构间私募产品报价与服务系统发行的非公开发行公司债等）、项目收益债、可转换债券、可交换债券、可分离交易债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持证券、资产支持受益凭证、永续债、同业存单以及非公开定向债务融资工具（PPN）以及其他债券。

货币市场工具类：包括现金、货币市场基金、银行存款、债券回购。

其他类产品：债券型基金、分级基金 A 级、混合类基金、指数类基金、券商收益凭证、商业银行理财计划等。

金融衍生工具：国债期货（仅限于套期保值）。

如投资超出上述投资范围的其他金融产品，须各方协商一致并按照合同变更流程对产品合同进行修改。

修改后的投资比例和固定收益各类资产的配置比例为：

债券、现金、银行存款、货币市场基金、债券逆回购投资等固定收益类资产合计占资产总值的 80-100%。

国债期货（仅限于套期保值）、债券型基金、分级基金 A 级、混合类基金、指数类基金、券商收益凭证、商业银行理财计划等合计占资产总值的 0-20%。

本集合计划投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于 80%，非因管理人主观因素导致突破比例限制的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整至符合前述比例。

本产品的总资产不得超过该产品净资产的 200%。

本集合计划投资组合在固定收益各类资产上的配置比例，将严格遵守相关法律法规的规定：

- 1) 短期融资券的债项评级为 A-1 级；
- 2) 信用债的主体或者债项评级为 AA（含）及以上；
- 3) 投资于单只债券的数量不超过该债券发行总额的 20%且不得超过计划净值的 40%；
- 4) 债券正回购：融入资金余额不超过计划资产净值的 40%；
- 5) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

本集合计划自成立之日或投资范围变更起三个月内使集合资产管理计划的投资组合比例符合资产组合设计要求。

4、增加合格投资者的认定标准

修改后的合同明确合格投资者的相关定义。详见合同“第5章 集合计划的参与和退出。”之“一、集合计划的参与”之“（二）参与原则”。

5、修改封闭期和开放期的安排

原合同约定，产品份额设置3个月、6个月、9个月和12个月四种不同期限的封闭期，分别对应A、B、C、D四类子份额；修改后的合同将约定本集合计划不设封闭期，存续期每个交易日开放参与和退出，委托人可以办理参与业务和退出业务；但设置份额锁定期，即每一笔赎回份额需满足锁定期满12个月（含）的条件后才可以预约申请退出。

6、增加违约退出的安排

修改后的合同约定委托人如在本集合计划的存续期间退出申请份额未满12个月锁定期退出本集合计划，为委托人违约，属于违约退出。委托人违约退出的，应支付净退出金额(扣除应计提的业绩报酬后的实际退出金额)的1%作为违约退出费用，违约退出费用全额归入集合计划财产，于违约退出时一次性支付。

7、调整本集合计划的费用

原合同约定管理费率为0.2%，托管费率为0.04%；修改后的合同将管理费分为固定管理费和业绩报酬，固定管理费率为0.6%，同时规定了业绩报酬的计提方式，按单一份额业绩报酬核算期内计算的年化收益率参考当期业绩比较基准计提业绩报酬；托管费费率为0.03%。

8、修改产品参与和退出机制

原合同约定存续期不定期开放，委托人投资期限到期前五个工作日(T-5日)预约退出；修改后的合同约定：存续期，本集合计划成立日起，每个工作日为开放申购日，委托人可以办理参与业务。每一笔赎回份额需满足锁定期满12个月(含)的条件后才可以提前十个工作日预约申请退出。

9、补充巨额退出和预警止损线的相关表述

原合同未设置巨额退出和预警止损机制；修改后的合同增加了巨额退出的认定和处理方式的条款和预警和止损线的条款(预警线为0.95；止损线为0.90)

10、修改分级条款

原合同约定根据风险收益特征进行分级，分为优先级和风险级两级；修改后的合同约定不设置分级安排。

11、修改自有资金参与的条款

原合同约定：推广期，管理人的自有资金仅参与风险级份额；存续期，管理人自有资金可以参与本集合计划的优先级和风险级份额；修改后的合同约定自有资金参与本集合计划份额比例不得超过本计划总份额的15%。管理人自有资金参与份额不对其他委托人承担保本保收益责任。

12、修改收益分配的相关表述

原合同约定本集合计划优先级份额享有约定的预期收益率。对于持有到期的优先级份额，本集合计划在到期日按约定的预期收益

进行结算。本集合计划风险级份额享有优先级份额分配收益后的剩余收益。若风险级份额资产净值不足以覆盖优先级份额的预期收益时，风险级份额单位净值为 0，优先级各分层产品份额获得全部的集合计划净资产；修改后的合同约定每份集合计划份额享有同等收益分配权。

1) 如单一份额在该业绩报酬核算期亏损，则需要进行份额缩减，使得份额净值为面值 1.00 元；

2) 如单一份额在该业绩报酬核算期内虽有收益但不足业绩比较基准的，则按实际收益率进行收益分配，分配完毕之后调整份额净值为面值 1.00 元；

3) 如单一份额在该业绩报酬核算期内收益大于业绩比较基准，则按业绩比较基准分配收益，管理人提取超额部分的 80%作为业绩报酬，余下 20%归份额持有委托人享有，分配完毕之后调整份额净值为面值 1.00 元。

13、其他

为了符合新规的相关要求，合同进行了相关细节条款的完善，合同变更具体内容详见附件 1：《日信证券长安 2 号集合资产管理计划资产管理合同》，附件 2：《日信证券长安 2 号集合资产管理计划托管协议》，附件 3：《日信证券长安 2 号集合资产管理计划风险揭示书》及附件 4：《日信证券长安 2 号集合资产管理计划说明书》。

至此，产品委托人对上述变更条款已完全理解并充分知悉，委托人征询函回执详见附件 6：《关于修改日信证券长安 2 号集合资产管理计划资产管理合同的意见征询函-委托人》。

不同意上述条款变更的委托人，将于临时开放日-2018 年 6 月 7 日（T 日）办理强制赎回，退回其持有本金和收益，优先级收益=委托人持有份额数*申购该份额时公告公布的业绩比较基准 / 365*持有期天数（含临时开放日），剩余收益归次级份额持有人所有（如有），次级份额持有人退出金额=临时开放日次级份额数*临时开放日前一日（T-1 日）次级单位净值；若委托人同意上述条款变更，则其初始投资本金将于临时开放日的下一日（T+1 日）自动适用变更后的条款进行运作，同时于 T+2 日进行持有期收益现金分红的确认。

变更事项自公告日开始生效，对合同各方均具有法律效力。

特此公告。

国融证券股份有限公司

2018 年 6 月 6 日