

关于修改国融合泉1号集合资产管理计划资产管理合同的意见征询函

致国融合泉1号集合资产管理计划投资者：

应中国证券投资基金业协会要求，结合《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[第151号]，以下简称“《管理办法》”）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2018]31号，以下简称“《运作管理规定》”）、《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《指导意见》）的相关要求，现依据《国融合泉1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，管理人国融证券股份有限公司就本资管合同相关条款进行变更。

资管合同主要修改内容如下：

一、产品管理费调整

原合同第十二章第（一）条集合计划各项费用、收费方式及收费标准由原来的：

“1、认购费：0%

2、退出费：0%

3、管理费：1.5%/年

本集合计划应给付管理人管理费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为1.5%/年。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div 365$$

H为每日应计提的集合计划管理费；

E为前一日集合计划资产净值。”

变更为：

“1、认购费：0%

2、退出费：0%

3、管理费：1.0%/年

本集合计划应给付管理人管理费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为1.0%/年。计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费；

E 为前一日集合计划资产净值。”

二、投资范围及投资比例的变更

原补充协议（二）第（二）条投资范围和投资比例

由原来的：

“1、集合计划投资范围及投资比例

主要投资于股票、债券、公开募集的基金、私募证券投资基金、股指期货、期权、国债期货及现金类资产等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及法律法规或中国证监会认可的其他投资品种。其中，投资于固定收益类资产、权益类资产、商品及金融衍生品类资产中任一资产的投资比例均小于 80%。

具体为：

权益类：首次公开发行股票、二级市场股票以及港股通投资标的股票等，该类资产的投资比例为集合计划总资产的 0-80%（不含）；

固定收益类：现金、货币市场基金、银行存款、债券回购、同业存单、协议回购、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）等，该类资产的投资比例为集合计划总资产的 0-80%（不含）；

衍生品类：国债期货、股指期货，沪深交易所上市的股票（股指）期权等，衍生品的持仓合约价值为集合计划总资产的 0-80%（不含），且衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产 20%；

基金类：收益凭证、中国境内依法发行的公募基金（包括但不限于股票型基金、债券型基金、混合型基金、封闭式基金、LOF 基金（不含拆分）、ETF 基金、分级基金和 QDII 基金）、私募证券投资基金（在基金业协会登记的私募基金管理人发行并由具有证券投资基金托管资格的机构托管的契约式私募证券投资基金），该类资产的投资比例为集合计划总资产的 0-80%（不含）。

现金类资产包括现金、银行存款、货币市场基金、大额可转让存单、期限

为 7 天以下包括 7 天的债券逆回购、到期日在一年以内的国债。

本集合计划可参与股票一级市场新股申购。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。

2、投资限制条款

(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) 集合计划资产买入一家公司发行的证券（债券或股票）市值不超过该证券发行总额的 25%且不超过计划资产净值的 25%（投资于完全按照有关指数构成比例进行证券投资的资产管理计划、公募基金，以及中国证监会认定的其他投资组合除外）；

(4) 集合计划参与股票、债券、可转换债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不超过集合计划的总资产，申报的数量不超过拟发行公司本次的发行量；

(5) 投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过该上市公司总股本的 5%（不含）；

(6) 投资于一家上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(7) 本计划投资于衍生品类资产（期货）的总保证金低于计划资产总值的 20%；

(8) 不得投资于 S、ST、*ST、S*ST 及 SST 类股票；

(9) 本产品的总资产不得超过该产品净资产的 200%；

(10) 本集合计划投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品；

(11) 本集合计划投资的资产管理产品不再投资《管理办法》第三十七条第（一）至第（三）项规定以外的非标准化债权类资产、股权类资产、商品及金融衍生品类资产；

(12) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。”

变更为：

“1、集合计划投资范围及投资比例

主要投资于股票、债券、公开募集的基金、股指期货、期权、国债期货及现金类资产等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及法律法规或中国证监会认可的其他投资品种。其中，投资于固定收益类资产、权益类资产、商品及金融衍生品类资产中任一资产的投资比例均小于 80%。

具体为：

权益类：首次公开发行股票、二级市场股票以及港股通投资标的股票等，该类资产的投资比例为集合计划总资产的 0-80%（不含）；

固定收益类：现金、货币市场基金、银行存款、债券回购、同业存单、协议回购、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）等，该类资产的投资比例为集合计划总资产的 0-80%（不含）；

衍生品类：国债期货、股指期货，沪深交易所上市的股票（股指）期权等，衍生品的持仓合约价值为集合计划总资产的 0-80%（不含），且衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产 20%；

现金类资产包括现金、银行存款、货币市场基金、大额可转让存单、期限为 7 天以下包括 7 天的债券逆回购、到期日在一年以内的国债。

本集合计划可参与股票一级市场新股申购。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。

2、投资限制条款

（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）集合计划资产买入一家公司发行的证券（债券或股票）市值不超过该证券发行总额的 25%且不超过计划资产净值的 25%（投资于完全按照有关指数

构成比例进行证券投资的资产管理计划、公募基金，以及中国证监会认定的其他投资组合除外)；

(4) 集合计划参与股票、债券、可转换债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不超过集合计划的总资产，申报的数量不超过拟发行公司本次的发行量；

(5) 投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过该上市公司总股本的 5% (不含)；

(6) 投资于一家上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

(7) 本计划投资于衍生品类资产（期货）的总保证金低于计划资产总值的 20%；

(8) 不得投资于 S、ST、*ST、S*ST 及 SST 类股票；

(9) 本产品的总资产不得超过该产品净资产的 200%；

(10) 本集合计划投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品；

(11) 本集合计划投资的资产管理产品不再投资《管理办法》第三十七条第（一）至第（三）项规定以外的非标准化债权类资产、股权类资产、商品及金融衍生品类资产；

(12) 本集合计划参与质押式回购与买断式回购最长期限均不得超过 365 天；

(13) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。”

具体合同变更条款详见《国融合泉 1 号集合资产管理计划管理合同》合同编号：国融证券合同【 】第【 】号。

自本合同生效日起，原《国融合泉 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：国融证券合同[18]第 543 号）、《国融证券-合泉 1 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议》（合同编号：国融证券合同[19]第 649 号）及《国融证券-合泉 1 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议（二）》（合同编号：国融证券合同[19]第 966 号）同时作废。

本次变更是根据《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》（中基协-2019 年 3 月 29 日）。

本次修订符合相关法律法规和资管合同的约定，特在此征求投资者意见，请在
本函下方回执意见，感谢您的支持和配合。



资产管理人：国融证券股份有限公司

法定代表人/授权代表：

年 月

日

A handwritten signature in black ink is written over the date field, extending to the right.

附件：《国融合泉 1 号集合资产管理计划管理合同》

集合资产管理计划投资者对修改资管合同意见的回复

本公司/本人于 年 月 日认购国融合泉 1 号集合资产管理计划（产品代码：D50057），共 份，本公司/本人对《国融合泉 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：国融证券【19】第/b91号）产品管理费、投资范围和投资比例等条款进行修订表示：

☐同意

☐不同意

本公司/本人已完全理解并充分知悉，若本公司/本人不同意上述条款变更，则须在管理人公告安排的临时开放日办理强制赎回；若本公司/本人同意上述条款变更，则本公司/本人的初始投资本金将于临时开放日的下一日自动适用变更后的条款进行运作。

投资者：

法定代表人/授权代表：

日期： 年 月 日