

华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划

合同变更的公告

尊敬的华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划投资者：

我公司作为关于华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）的管理人，在与托管人协商后，对关于华金隆盛增利宝 1 号集合资产管理计划资产管理合同（以下简称“合同”）内容做了修改，主要修改内容如下：

“一、投资范围及比例。

原合同表述为：“1、投资范围（1）固定收益类资产：包括但不限于现金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金、同业存单、期限在 7 天以内（含 7 天）的债券逆回购、到期日在 1 年以内（含 1 年）的政府债券、到期日在 1 年以内（含 1 年）的央行票据；集合计划可参与证券正回购，融入资金余额不得超过集合计划资产净值的 100%。法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，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、资产配置比例（1）固定收益类资产：占计划资产总值的 100%；（2）证券正回购：占资产净值的 0-100%。”现投资范围调整为“（1）固定收益类资产：包括现金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、货币市场基金、同业存单、债券逆回购、债券型基金（含债券分级基金）、国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债券、商业银行债券、非银行金融机构债券、特种金融债）、可转换债券、可交换债券、次级债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持票据优先级、资产支持证券优先级（资产支持受益凭证优先级）等；（2）金融衍生品：包括国债期货、利率互换、信用风险缓释凭证等。法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，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。”

二、投资限制

原合同约定：“为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：1、证券正回购资金余额不得超过本计划上一交易日净资产 100%。债券逆回购余额不得超过本计划上一交易日净资产 100%；2、管理人管理的全部集合计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%，由于相关数据托管人无法取得，本条限制由管理人自行监督；3、集合计划投资于同一资产（同一资产指单只基金）不超过集合计划净值的 25%；4、本计划总资产不超过净资产的 200%。管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责，托管人不承担由此造成的损失。如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。”现调整为：“为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：（1）本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%，银行活期存款、国债、中央银行票据、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；（2）管理人管理的全部集合计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%，银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；

（3）本计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%；（4）本集合计划参与债券逆回购的资金余额不得超过上一日净资产的 100%；（5）本集合计划参与债券正回购的资金余额不得超过上一日净资产的 100%；（6）本集合计划所投资的短期融资券债项不低于 A-1 且主体评级不低于 AA，企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、中期票据等债券类标的的主体或债项或担保人信用等级不低于 AA。资产证券化产品的债项评级为 AA+（含）以上。（7）

本集合计划不参与融资融券交易。本集合计划不投资中小企业私募债和非标准化债权资产。

(8) 本集合计划所投资的资产支持证券(优先级)均为银行间市场、上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易的资产支持证券。(9) 本集合计划不主动投资于二级市场股票,但可以持有因可转债、可交债转股所形成的股票,因所持股票所派发的权证以及可分离交易债券而产生的权证。如法律法规或监管部门修改或取消上述限制,履行适当程序后,本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。”

三、开放期

原合同表述为“每1个月开放一次,开放时间为6个工作日,前5个开放日仅开放申购,不开放赎回,第6个开放日仅开放赎回,不开放申购。”现调整为“每年1、4、7和10月的10日至12日为开放期,各开放一次。每次开放期为3个工作日,若开放期遇法定节假日、休息日等则自动顺延。每个开放期的第1个开放日开放申购和赎回,第2和第3个开放日仅开放申购,不开放赎回。具体开放期以管理人公告为准。”

四、管理人的业绩报酬

原合同表述为:“1、业绩报酬计提原则:

管理人在本集合计划份额退出日和计划终止日计提业绩报酬,每笔份额期间年化收益率若不超过4%,则不提取业绩报酬;超过4%(含)以上的部分按超出部分的50%计提业绩报酬。

2、业绩报酬计提的方法:

(1) 集合计划份额收益R的计算方式

$$R = \frac{A - P}{P} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

其中A为业绩报酬计提日集合计划的份额累计单位净值,P为集合计划份额参与时的累计单位净值或最近一次发生业绩报酬计提后的份额累计单位净值,T为集合计划份额的期间经历天数。

① 若集合计划份额之前未被计提过业绩报酬,则P=份额认购(或申购)时的集合计划份额累计单位净值。

② 若集合计划份额之前被计提过业绩报酬,则P=份额最近一次发生业绩报酬计提后的份额累计单位净值。

R的计算在百分号内保留两位小数,小数点后第三位四舍五入。

年化收益率	提取比例	业绩报酬公式
$R < 4\%$	0	0
$R \geq 4\%$	50%	$Y = Q \times P \times (R - 4\%) \times 50\% \times T / 365$

其中:

Q为集合计划的份额;

R为Q的期间年化收益率;

Y为业绩报酬;

P为集合计划份额的期初成本,即参与时集合计划份额单位净值或最近一次发生业绩报酬计提后的份额单位净值;

T为集合计划份额的期间经历天数。

业绩报酬的计算结果保留到小数点后两位,小数点后第三位四舍五入。同一笔退出包含参与时间不同的份额时分别计算业绩报酬。

3、业绩报酬的支付:每次业绩报酬计提结束后,由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令,托管人于【5】个交易日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、

休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

支付方式：

账户名称（接收业绩报酬）：华金证券股份有限公司

账 号：216200100100908100

开户行：兴业银行股份有限公司上海分行营业部

行号：309290000107

因涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不承担复核业绩报酬的责任。”现调整为：“（1）业绩报酬计提原则

①本集合计划按照委托人每笔资金分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

②本集合计划的业绩报酬计提日为委托人份额每年1月和7月的分红日、份额退出日和集合计划终止日。

③集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。委托人退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。

④委托人申请退出时，按照“先进先出”的原则，即按照参与的先后次序进行退出顺序的确认，以此计算、提取退出份额的业绩报酬。

⑤管理人于每个开放期前公告下一结算周期的业绩报酬计提基准 K_i （年化）。业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的标准，并不是管理人向委托人保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。结算周期：（1）集合计划成立日（含）至第1个开放期的第1个工作日（含）的期间；（2）集合计划第1个开放期的第2个工作日（含）至集合计划下一开放期的第1个工作日（含）的期间，依此类推。

（2）业绩报酬计提方法、比例和提取频率

本集合计划在委托人份额每年1月和7月分红日、份额退出日和集合计划终止日计提业绩报酬。管理人对委托人上一发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（若上一发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，则初始募集期认购的为本集合计划成立日，存续期申购及红利再投资参与的为份额参与日）至本次业绩报酬计提日所涵盖的各结算周期分段计算业绩报酬（“分段业绩报酬”）。管理人对每个结算周期中份额年化收益超过当期业绩报酬计提基准的部分的【50%】的业绩报酬。

①委托人每个结算周期年化收益率 R_i 计算公式：

$$R_i = \frac{A_i - B_i + D_i}{B_i} \times \frac{365}{T_i} \times 100\%$$

R_i 为集合计划本次结算周期的期间份额年化收益率；

A_i 为集合计划本次结算周期期末的单位净值；

B_i 为集合计划成立日或上一结算周期期末的单位净值；

D_i 为集合计划成立日或上一结算周期期末至本次结算周期期末的期间单位分红金额；

T_i 为集合计划成立日或上一结算周期期末至本次结算周期期末的实际天数；

R_i 的计算在百分号内保留两位小数。

②委托人每个结算周期业绩报酬计提计算公式：

年化收益率 (R_i)	计提比例	业绩报酬 (Y_i) 计算方法
$R_i \leq K_i$	0	0
$R_i > K_i$	50%	$Y_i = (R_i - K_i) \times 50\% \times F_i \times C_i \times \frac{T_i}{365}$

Y_i 为委托人本次结算周期的业绩报酬，计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入；

F_i 为委托人本次结算周期业绩报酬计提登记在册的份额数；

C_i 为委托人本次结算周期的期初单位净值。

T_i 为委托人本次结算周期的实际天数。

委托人上一发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（若上一发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，则初始募集期认购的为本集合计划成立日，存续期中申购及红利再投资参与的为份额参与日）至本次业绩报酬计提日所涵盖的各结算周期计算分段业绩报酬。若任一结算周期内份额年化收益大于当期业绩报酬计提基准，则管理人对超过部分计提【50%】的分段业绩报酬。

若任一结算周期内份额年化收益小于或等于当期业绩报酬计提基准，则管理人不计提本次结算期间的分段业绩报酬。

本次业绩报酬计提日的业绩报酬为本次业绩报酬计提期间内各结算周期的分段业绩报酬之和。

因涉及注册登记数据，业绩报酬以管理人提供的数据为准，托管人配合进行划付。”

五、管理费支付方式

原合同约定：“管理人的管理费每日计算，逐日计提，按自然季支付，每自然季度结束之日起【5】个工作日内由管理人向托管人发送当个自然季度管理费划付指令，托管人复核后于【5】个工作日内从集合计划资产中一次性扣除支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。”现调整为：“管理人的管理费每日计算，逐日计提，自然季支付，托管人根据与管理人核对一致的财务数据，按照本协议约定的管理费计算方式计算并于每自然季度结束之日起第5个交易日自托管账户自动扣划管理费，管理人无需再出具资金划拨指令。如遇托管账户资金余额不足的，托管人可待托管账户有资金时再划扣。费用自动划扣后，托管人应向管理人告知管理费支付金额及计算方式，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。”

六、估值方法

原合同约定：“1、债券估值方法

(1) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(2) 在证券交易所市场交易的债券，按中证指数有限公司提供的债券估值数据进行估值。

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(4) 对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(5) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据中央国债登记结算公司公布的收益率曲线及估值价格。

(6) 对在银行间市场上市交易的资产支持证券，应主要依据中央国债登记结算公司公布的收益率曲线及估值价格估值。对未在银行间市场上市交易且中债登公司未提供价格的，按成本估值。对在交易所上市的资产支持证券品种，鉴于其交易不活跃，各产品的未来现金流也较难确认的，按成本估值。

2、银行存款估值方法

银行存款每日按当日银行存款余额计提存款利息。银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

3、货币市场基金的估值方法

货币市场基金按照该基金公布的前一日每万份收益逐日计提收益。

4、债券逆回购的估值方法

持有的债券逆回购以本金列示，按约定利率逐日确认利息收入。

5、正回购的估值方法

正回购以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

6、同业存单的估值方法：

同业存单以本金列示，按协议或者合同利率逐日确认利息收入。

7、其他品种的估值由管理人和托管人按照估值原则协商确定。如管理人或托管人发现对委托资产的估值违反本合同项下订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

8、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值，管理人应于新规定实施后及时在管理人指定网站进行公告。

9、相关法律法规以及监管部门另有新规定的，从其规定。”

现调整为：“① 投资标准化固定收益品种的估值方法

(1) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(2) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(3) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(4) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(5) 对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(6) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构（中债）公



布的收益率曲线及估值价格。

(7)对在银行间市场上市交易的资产支持证券等固定收益品种,按第三方估值机构(中债)提供的相应品种的当日估值净价估值。对在交易所上市的资产支持证券品种,鉴于其交易不活跃,各产品的未来现金流也较难确认的,按成本估值。

② 投资上市证券投资基金的估值方法

(1)ETF 基金场内持仓、LOF 基金场内持仓、境内上市定期开放式基金、封闭式基金,以其估值日收盘价估值;

(2)境内上市交易型货币市场基金,如基金管理人披露份额净值,则按所投资基金的基金管理人披露的前一交易日份额净值进行估值;如基金管理人披露万份(百份)收益,则按所投资基金前一交易日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益。

③ 投资非上市证券投资基金的估值方法

(1)境内非货币市场基金(包括但不限于ETF 基金场外持仓、LOF 基金场外持仓等),以其前一交易日基金份额净值估值;

(2)境内货币市场基金,按所投资基金前一交易日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。

④ 存款的估值方法

持有的银行定期存款或通知存款以本金列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入。

⑤ 股票的估值方法

(1)上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值。

(2)上市流通股估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件,以最近交易日的收盘价估值。

(3)首次发行未上市的股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本价估值。

(4)送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价进行估值。

(5)首次公开发行有明确锁定期的股票和非公开发行有明确锁定期的股票按如下方法进行估值。

$$FV=S*(1-LoMD)$$

其中 FV 为估值日该流通受限股票的价值, S 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值, LoMD 为该流通受限股票的剩余限售期对应的流动性折扣。

⑥ 金融衍生品的估值方法

(1)国债期货,按估值日交易所公布的当日结算价估值;估值日无交易,且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的结算价估值;如最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的,应采取相应的衍生品估值模型,确定公允价值。

(2)利率互换,对于外汇交易中心交易的利率互换,按第三方估值数据(上清所)估值;对于第三方估值数据(上清所)未提供估值数据服务的,按交易对手方提供的估值数据进行估值。

若交易对手方未能提供估值日最新估值数据,如当日未发生影响公允价值计量的重大事件的,可采用交易对手方提供的前一交易日估值数据进行估值,如最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的,应采取相应的衍生品估值模型,确定公允价值。

(3)信用风险缓释凭证,对于外汇交易中心交易的信用风险缓释凭证,按第三方估值数据(中债)估值;对于第三方估值数据(中债)未提供估值数据服务的,按交易对手方提供的估值数据进行估值。

若交易对手方未能提供估值日最新估值数据，如当日未发生影响公允价值计量的重大事件的，可采用交易对手方提供的前一交易日估值数据进行估值，如最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的，应采取相应的衍生品估值模型，确定公允价值。

⑦ 债券逆回购的估值方法

持有的债券逆回购以本金列示，按约定利率逐日确认利息收入。

⑧ 债券正回购的估值方法

债券正回购以成本列示，按约定利率逐日确认利息支出。

如有上述未尽事宜，由管理人参考《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》，与托管人协商一致后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

如管理人或托管人发现集合计划估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

如有新增事项或国家有最新规定的，按国家最新规定估值。

除管理人在资产购入时特别标注并给托管人正式书面通知及另有规定外，本计划购入的资产均默认按交易性金融资产核算与估值。如国内证券投资会计原则及方法发生变化，由管理人与托管人另行协商确定估值方法。”

以上为合同主要修改内容，详细内容请见附件合同。华金隆盛增利宝1号集合资产管理计划风险揭示书及计划说明书中的内容根据上述条款做相应变更。

根据合同第二十六章合同的补充、修改与变更中的约定：“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，并通过在管理人网站公告的形式向委托人征求意见。委托人不同意变更的，应在管理人设置的特别开放期退出本集合计划的申请；委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意。委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

委托人不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利，管理人可在特别开放期为委托人办理退出集合计划的业务；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人，管理人有权在公告中说明的回复期限届满后，将其份额强制退出集合计划，由此发生的相关税费或或有损失由委托人自行承担。合同变更生效日以管理人公告为准。集合计划份额的退出价格为退出当日集合计划单位净值。

委托人同意，无论其是否提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人的违约行为。”

本公告于2019年12月20日由管理人以网站公告的形式向委托人征求意见，委托人不同意变更的，应在征询意见发出的5个交易日内提出退出本集合计划的申请，申请意见请于2019年12月26日（含）前以邮件形式发送至邮箱hjzgd@huajinsc.cn，回复格式为姓名+证件类型+证件号码+“不同意华金隆盛增利宝1号合同变更”，管理人将设置特别开放期，仅为不同意合同变更的客户办理赎回业务，特别开放期安排将另行公告。在本公告满5个交易日后，变更后的华金隆盛增利宝1号集合资产管理计划资产管理合同将于2019年12月27日生效。

特此公告！



