

**关于《海通期货-海新 2 号集合资产管理计划资产管理合同（2023 年 5 月修订版）》
变更征询意见函**

尊敬的委托人：

由我司担任管理人的“海通期货-海新 2 号集合资产管理计划”因投资管理需要，现需对《海通期货-海新 2 号集合资产管理计划资产管理合同（2023 年 5 月修订版）》（以下简称《资产管理合同》）的部分内容进行修订及变更：

1. 将《资产管理合同》“五、资产管理计划基本情况”中“（五）主要投资方向”的以下表述：

“……”

（1）债券类资产：证券交易所或银行间市场发行及交易的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券；

……”

修改为

“……”

（1）债券类资产：证券交易所或银行间市场发行及交易的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、永续债；

……”

2. 将《资产管理合同》“五、资产管理计划基本情况”中“（六）投资比例及限制”的以下表述：

“1、本计划投资于固定收益类资产（包含债券类资产和货币市场工具）按市值计不低于计划总资产的 80%；

……”

4、期限要求：本计划所持有的单一债券（除国债、地方政府债、政策性金融债）剩余到期期限或剩余行权期限不得超过 7 年，持有的所有信用债券组合久期不得超过 5 年。

……”

8、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。”

修改为

“1、本计划投资于固定收益类资产（包含债券类资产和货币市场工具）按市值计不低于计划总资产的 80%；

……”

4、期限要求：本计划所持有的单一债券（除国债、地方政府债、政策性金融债、永续债）剩余到期期限或剩余行权期限不得超过 7 年，持有的所有信用债券（除永续债）组合久期不得超过 5 年。

……”

8、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。”



3. 将《资产管理合同》“十一、资产管理计划的投资”中“(二) 投资范围”的以下表述:

“... ..

(1) 债券类资产: 证券交易所或银行间市场发行及交易的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券;

... ..”

修改为

“... ..

(1) 债券类资产: 证券交易所或银行间市场发行及交易的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、永续债;

... ..”

4. 将《资产管理合同》“十一、资产管理计划的投资”中“(六) 投资比例及限制”的以下表述:

“1、本计划投资于固定收益类资产(包含债券类资产和货币市场工具)按市值计不低于计划总资产的 80%;

... ..

4、期限要求: 本计划所持有的单一债券(除国债、地方政府债、政策性金融债)剩余到期期限或剩余行权期限不得超过 7 年, 持有的所有信用债券组合久期不得超过 5 年。

... ..

8、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。”

修改为

“1、本计划投资于固定收益类资产(包含债券类资产和货币市场工具)按市值计不低于计划总资产的 80%;

... ..

4、期限要求: 本计划所持有的单一债券(除国债、地方政府债、政策性金融债、永续债)剩余到期期限或剩余行权期限不得超过 7 年, 持有的所有信用债券(除永续债)组合久期不得超过 5 年。

... ..

8、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。”

5. 将《资产管理合同》附件四“投资监督事项表”中的以下表述:

“一、投资范围

... ..

(1) 债券类资产: 证券交易所或银行间市场发行及交易的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可

交换债券、资产支持证券；

… …

二、投资比例投资限制

1、本计划投资于固定收益类资产（包含债券类资产和货币市场工具）按市值计不低于计划总资产的 80%；

… …

4、期限要求：本计划所持有的单一债券（除国债、地方政府债、政策性金融债）剩余到期期限或剩余行权期限不得超过 7 年，持有的所有信用债券组合久期不得超过 5 年。

… …

8、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。”

修改为

“一、投资范围

… …

（1）债券类资产：证券交易所或银行间市场发行及交易的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、永续债；

… …

二、投资比例投资限制

1、本计划投资于固定收益类资产（包含债券类资产和货币市场工具）按市值计不低于计划总资产的 80%；

… …

4、期限要求：本计划所持有的单一债券（除国债、地方政府债、政策性金融债、永续债）剩余到期期限或剩余行权期限不得超过 7 年，持有的所有信用债券（除永续债）组合久期不得超过 5 年。

… …

8、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。”



根据《资产管理合同》“二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算”章节约定，本次合同变更拟通过以下方式进行：

“资产管理人、资产托管人首先就本合同拟变更事项达成一致。资产管理人就本合同变更事项向资产委托人发送合同变更征询意见函（或通知）。资产委托人应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复意见。资产委托人不同意变更的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内明确回复；资产委托人未在指定日期内回复意见或未在指定的日期内退出本计划的，视为资产委托人同意合同变更。征询意见期满，由管理人安排临时开放日并强制退出所有不同意合同变更的计划份额持有人所持全部份额（本条约定不受本合同“资产管理计划的参与、退出”中关于计划退出的期限限制，具体退出规则以管理人通知为准）。变更事项自临时开放日的次工作日开始生效，对

合同各方均具有法律效力。变更事项生效后，管理人应及时向资产委托人、托管人出具盖章的合同变更生效通知，并发布合同变更的公告。”

管理人已就上述变更内容征得托管人同意，现向全体委托人征询意见：

如您不同意本次变更，请务必在临时开放日 2023 年 10 月 18 日当日退出本计划（本次退出份额如持有期限不满 180 天的，管理人免收退出费）；如您未在 2023 年 10 月 18 日当日退出本计划的，视为您同意此次变更。变更事项自临时开放日的次工作日即 2023 年 10 月 19 日开始生效。

同时自变更生效日起，我司将启用整合更新后的《海通期货-海新 2 号集合资产管理计划资产管理合同（2023 年 10 月修订版）》文本，新参与的投资者将签署该版本，现有投资者无需另行签署《海通期货-海新 2 号集合资产管理计划资产管理合同（2023 年 10 月修订版）》。

