

关于修改日信证券日鑫多利（债券型）资管合同的意见征询函

致渤海银行股份有限公司：

根据业务发展需求，依据《日信证券日鑫多利（债券型）集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称“本资管合同”）第二十六章“合同的补充、修改与变更”的相关约定，对本资管合同投资范围的约定进行变更，具体内容如下：

【修改内容 1】

资管合同第四章“集合资产管理计划的基本情况”第（五）款第 1 条“投资范围”增加“国债期货、利率互换”两种投资标的。

修改为：

“本集合计划将主要投资于国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、可转换债券、可分离交易债券、可交换债券、短期融资券、中小企业私募债、中期票据（含非公开定向债务融资工具，资产支持票据等）、资产支持证券、货币市场基金、债券型基金、混合型基金、分级基金之优先级、分级基金之劣后级、债券逆回购、债券正回购、国债期货、利率互换、商业银行理财计划、银行存款等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会认可的其他投资品种。”

【修改内容 2】

资管合同第四章“集合资产管理计划的基本情况”第（五）款第 2 条“资产配置比例（占资产总值比例）”增加以下配置比例限制：

（6）国债期货，持有的国债期货合约价值不超过债券持仓市值的 200%。

（7）利率互换，持有的利率互换合约价值不得超过债券持仓市值的 50%。

【修改内容 3】

资管合同第十二章“集合计划的估值”第（七）款估值方法增加以下内容：

“7、国债期货估值办法

国债期货按估值日的结算价估值；估值日无结算价的，以最近交易日的结算价估值。”

以上合同变更内容特向贵行征求意见，请贵行在本函下方回执意见，感谢贵行的支持与配合！

资产管理人：国融证券股份有限公司



2017年2月28日

渤海银行股份有限公司对修改本资管合同意见的回复：

我行对关于修改日信证券日鑫多利（债券型）资管合同的意见为：

同意

不同意

资管合同修改后，望管理人按照资管合同的约定及时履行后续事项。

托管人：渤海银行股份有限公司（盖章）

负责人/授权代表：（签字）

日期：2017.3.13

