

长城睿赢一号集合资产管理计划

资产管理合同补充协议

编号：【长城证券（2015）-JH-052-BC001】号

管理人：长城证券股份有限公司

托管人：宁波银行股份有限公司

2016 年 04 月



一、前言

合同当事人于 2015 年 09 月 30 日签署了编号为长城证券 (2015) -JH-052 的《长城睿赢一号集合资产管理计划资产管理合同》(简称“资管合同”), 长城睿赢一号集合资产管理计划 (简称“资管计划”) 已于 2015 年 11 月 11 日成立, 经四个月的运作后, 为保护各方的合法权益和更有利于资管计划的运作, 经合同当事人平等协商, 就资管合同未尽事宜和部分条款的修订签订本协议。

二、合同当事人

(一) 委托人

A 类委托人填写

个人委托人填写:

姓名:

证件类型:

证件号码:

通信地址:

邮政编码:

联系电话:

移动电话:

电子信箱:

其他:

机构委托人填写:

机构名称: 上海复旦复华科技股份有限公司

负责人/授权代表: 张陆洋

通信地址：上海市淮海中路 333 号瑞安广场 2006 室

邮政编码：200020

联系人姓名：顾宝玲

联系电话：021-63872288

电子信箱：bgu@forwardgroup.com

B 类委托人填写

个人委托人填写：

姓名：

证件类型：

证件号码：

通信地址：

邮政编码：

联系电话：

移动电话：

电子信箱：

其他：

机构委托人填写：

机构名称：

法定代表人：

通信地址：

邮政编码：

代理人姓名：

身份证号码：

联系电话：

电子信箱：

(二) 管理人

名称：长城证券股份有限公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 楼

法定代表人/授权代理人：

邮政编码：518048

联系人：王鹤

电话：0755-83556382

传真：0755-83516089、0755-83785915

(三) 托管人

名称：宁波银行股份有限公司

住所：宁波市鄞州区宁南南路 700 号宁波银行大厦

法定代表人：陆华裕

邮政编码：315100

联系人：王海燕

电话：0574-89103171

传真：0574-89103213

三、因资管合同第二十六条中有关于设置“临时开放期”的约定，为保持资管合同上下文的一致性，在资管合同第二条中增加对“临时开放期/日”的释义。

临时开放期/日：	指存续期内管理人根据本合同“二十六、合同的补充、修改与变更”的约定所设置的期间；
----------	--

四、因资管计划的注册登记机构为“长城证券股份有限公司”，资管合同第二条“释义”中的相关表述有误，故进行修改。

原约定为：

注册与过户登记人	指为委托人管理集合资产管理账户、办理份额注册登记、交易确认和代理发放红利、保管委托人名册等业务的专业机构，本集合计划的注册与过户登记人为中国证券登记结算有限责任公司；
----------	---

现修改为：

注册与过户登记人	指为委托人管理集合资产管理账户、办理份额注册登记、交易确认和代理发放红利、保管委托人名册等业务的专业机构，本集合计划的注册与过户登记人为 长城证券股份有限公司 ；
----------	--

五、因资管合同第二十六条中有关于设置“临时开放期”的约定，为保持资管合同上下文的一致性，对资管合同第二条“释义”中的相关条款进行修改。

原约定为：

封闭期	特指本集合计划存续期内，委托人不得参与、退出本集合计划的期间，本合同另有约定的除外。本集合计划自成立后的前 6 个月，除特殊申购开放日外均为封闭期；从第 7 个月开始，除每个季度的最后 1 个工作日为开放期外，所有时段均为封闭期；
-----	---

现修改为：

封闭期	特指本集合计划存续期内，委托人不得参与、退出本集合计划的期间，本合同另有约定的除外。本集合计划自成立后的前 6 个月，除特殊申购开放 期 和 临时开放期 外均为封闭期；从第 7 个月开始，除 一般开放期 和 临时开放期 外，所有时段均为封闭期；
-----	--

六、因资管合同第二十六条中有关于设置“临时开放期”的约定，为保持资管

合同上下文的一致性，对资管合同第四条第（六）款第1项中的相关条款进行修改。

原来约定为：

1、开放期：本集合计划开放期包括特殊申购开放期和一般开放期。

特殊申购开放期：本集合计划自成立之日起的前6个自然月，每个月开放一次，委托人只可以办理参与本集合计划业务，不可以办理退出本集合计划业务。具体特殊申购开放日详见管理人公告。

一般开放期：从本集合计划成立后第7个自然月开始，本集合计划每季度开放一次，委托人可在每次开放期申请参与和退出本集合计划份额，具体开放日为每个季度的最后1个工作日。

现修改为：

1、开放期：本集合计划开放期包括特殊申购开放期、一般开放期**和临时开放期**。

特殊申购开放期：本集合计划自成立之日起的前6个自然月，每个月开放一次，委托人只可以办理参与本集合计划业务，不可以办理退出本集合计划业务。具体特殊申购开放日详见管理人公告。

一般开放期：从本集合计划成立后第7个自然月开始，本集合计划每季度开放一次，委托人可在每次开放期申请参与和退出本集合计划份额，具体开放日为每个季度的最后1个工作日。

临时开放期：本集合计划可根据本合同“二十六、合同的补充、修改与变更”中的约定设置临时开放期。临时开放期的设置方法和要求由本合同“二十六、合同的补充、修改与变更”进行具体约定。

七、为了更好的运作资管计划，保障委托人的权益，本协议对资管合同第七条第（三）款中涉及预警和止损的条款进行了修改，具体如下。

原约定为：

1、本计划存续期间，当某一自然日（T）日估值结果显示该日计划单位净值等于或低于 0.9300 元时，则本计划触及预警线，估值结果均以管理人计算结果为准。B 类份额委托人将于两个交易日内（T+2 日）追加资金直至本计划单位份额净值达到 1.0000 元。

自本计划触及预警线之日的 T+1 日起，管理人按照监管要求和合同约定进行相关的投资操作，不得做出买入或申（认）购及相关的投资行为。当本计划单位净值恢复到 0.9300 元（不含）以上的，自下一个交易日起，管理人才能继续做出买入或申（认）购及相关的投资决策

2、本计划存续期间，当某一自然日（T）日估值结果显示该日计划单位净值等于或低于 0.9000 元时，则本计划触及止损线，估值结果均以管理人计算结果为准。B 类份额委托人将于下一个交易日（T+1 日）追加资金直至本计划单位份额净值达到 1.0000 元。若 T+1 日计划单位份额净值未能达到 1.0000 元，管理人将于下一个交易日（T+2 日）起对本计划持有的全部非现金资产进行不可逆变现，直至本计划财产全部变现为止。变现完成后，本计划提前终止。

现修改为：

1、本计划存续期间，当某一交易日（T）日估值结果显示该日计划单位净值等于或低于 0.9000 元时，则本计划触及预警线，估值结果均以管理人计算结果为准。B 类份额委托人应于两个交易日内（T+2 日）追加资金直至本计划单位份额净值达到 0.9200 元。

自本计划触及预警线之日的 T+1 日起，管理人按照监管要求和合同约定进行相关的投资操作，但不得做出买入或申（认）购及相关的投资行为。当本计划单位净值恢复到 **0.9200** 元及 0.9200 元以上的，自下一个交易日起，管理人才可以继续做出买入或申（认）购及相关的投资决策。

2、本计划存续期间，当某一交易日（T）日估值结果显示该日计划单位净值等于或低于 **0.8500** 元时，则本计划触及止损线，估值结果均以管理人计算结果为准。B 类份额委托人应于下一个交易日（T+1 日）追加资金直至本计划单位份额净值达到 **0.9200** 元。若 T+2 日本计划单位份额净值未能达到 **0.9200** 元，管理人将于下一个交易日（T+3 日）**9:30 起**对本计划持有的全部非现金资产进行变现，直至本计划财产全部变现为止。变现完成后，本计划提前终止。

自本计划触及止损线之日的 T+1 日起，管理人按照监管要求和合同约定进行相关的投资操作，但不得做出买入或申（认）购及相关的投资行为。当本计划单位净值恢复到 **0.9200** 元及 0.9200 元以上的，自下一个交易日起，管理人才可以继续做出买入或申（认）购及相关的投资决策。

3、B 类份额委托人追加资金后，若本计划单位份额净值连续三个交易日高于 1.0000 元，B 类份额委托人可提取追加的资金，提取后当日本计划单位份额净值不得低于 1.0000 元，且提取资金不得大于追加资金。

八、鉴于管理人不再聘请上海熙峰投资管理有限公司作为资管计划的研究顾问，因此对资管合同中涉及研究顾问的条款进行修改，具体如下。

- 1、删除资管合同第二条中对“研究顾问”的释义；
- 2、删除资管合同第十二条第（一）款第 3 项“研究顾问费”；
- 3、删除资管合同第十五条“集合计划研究顾问”；

4、删除资管合同第二十四条第（二）款第3项“聘请研究顾问的风险”；

5、对资管合同第十六条第（二）款“集合计划的投资程序”进行修改。

原约定为：

1、资产管理部聘请外部专业研究机构担任本集合计划的研究顾问，提供研究建议。投资主办人借助研究顾问支持体系和本集合计划的收益 - 风险特征，结合自身对市场和资金面的分析判断，决定具体的投资品种、规模并决定买卖时机。

2、研究建议内容及提供流程包括：

（1）研究顾问严格按照法律法规、集合计划合同、管理人的要求向管理人提供拟投资的产品名单；

（2）管理人对上述产品进行风险审核，确定可投资的产品组合；

（3）研究顾问提供投资标的或模拟组合建议及其研究报告；

（4）管理人对投资标的或模拟组合建议进行研究和审核，并决定投资操作；

（5）如因交易条件不能满足、上市公司停牌、证券期货交易所闭市等原因导致投资标的或模拟组合建议不能执行，则该建议作废，管理人立即通知研究顾问，并有权要求研究顾问另外提供符合法律法规、集合计划合同、管理人要求的投资标的或模拟组合建议；

（6）当出现以下情况时，管理人有权自行处置投资品种，并立即通知研究顾问：

④因证券市场波动、上市公司合并、集合资产管理计划规模变动、股权分置改革中支付对价等因素导致集合资产管理计划的投资不符合计划文件约定的限制，研究顾问未能在本合同规定的有效时间内向管理人提出调整建议；

②为支付集合资产管理计划赎回款项而必须变现部分投资品种且研究顾问未

能及时调整并提供投资标的或模拟组合建议的；

③根据相关法规或监管部门的要求，必须卖出部分投资品种且研究顾问经管理人通知后仍未能及时提供投资标的或模拟组合建议的；

④其他客观原因导致管理人必须变更投资品种，且研究顾问经管理人通知后仍未能及时提供投资标的或模拟组合建议的；

(7) 若研究顾问提供的投资标的或模拟组合建议包含场外交易（包括但不限于网下配售、增发、新股申购、基金交易等），研究顾问应至少提前一个工作日向管理人提交投资标的或模拟组合建议。

现修改为：

1、管理人的资产管理业务部门审议投资主办人提交的资产配置方案并监督投资主办人的执行情况和日常投资组合管理。

2、投资主办人在资产管理业务部门授权的范围内，根据本集合计划既定的投资理念和资产配置比例制定资产配置策略，选择合适的投资标的构建投资组合，并负责进行投资组合的日常管理。

3、交易指令由投资主办人或其他被授权人向交易员下达，交易员在确认投资指令的合规性、有效性后依据投资指令具体执行交易操作，并及时将指令的执行情况反馈给投资主办人。

九、本协议生效后，即成为资管合同不可分割的组成部分，与资管合同具有同等法律效力。除本协议中明确约定的条款之外，资管合同的其余部分继续有效。

十、本协议经各方当事人签署后自临时开放期公告后的第二个工作日生效。

十一、本协议一式捌份，管理人执肆份、托管人和委托人各执贰份，具有同等法律效力。

(本页无正文，为编号长城证券 (2015) -JH-052-BC001 的《长城睿赢一号集合资产管理计划资产管理合同补充协议》签署页)

委托人：

个人 (签字)：

证件号码/类型：

机构 (盖章)：

法定代表人或授权签字人：



管理人：长城证券股份有限公司 (盖章)：

法定代表人或授权代理人：



托管人：宁波银行股份有限公司 (盖章)：

负责人或授权代理人：



于 2016 年 4 月 28 日签订