

野村东方国际 CTA 旗舰 1 号 FOF 集合资产管理计划合同变更公告

野村东方国际 CTA 旗舰 1 号 FOF 集合资产管理计划（下称“本资产管理计划”）的管理人为野村东方国际证券有限公司（以下简称“管理人”），托管人为宁波银行股份有限公司（以下简称“托管人”）。为适应证监会 2023 年 1 月 13 日公布的最新修订的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称“新规”），同时为更好地服务份额持有人与潜在的投资者，并更好地适应投资环境、贴合投资策略，管理人拟修订全篇合同文本，主要涉及管理人自有资金参与退出的概括性授权、关联交易的概括性授权、合同变更条件与程序等条款的变更（具体详阅本公告附件一、附件二），现管理人与托管人已协商一致，征求全体投资者意见，履行合同变更程序。

一、拟变更的合同内容

合同文本的整本修订，具体请详见附件一、附件二及本资产管理计划变更后的法律文件。

二、合同变更条件与程序

根据本资产管理计划资产管理合同 25.1.1 “合同变更的条件与程序”的约定，本次合同变更条件符合资产管理合同第（一）点的第 4 点，采用第（二）点的第 4 点作为本次合同变更程序。

1. 合同变更条件

第（一）点第 4 点：“除上述第（1）至（3）款的规定外，因其他原因需要变更本合同的，经全体投资者、管理人和托管人协商一致后，可对资产管理合同内容进行变更，本合同另有约定的除外。资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意。”

2. 合同变更程序

第（二）点的第 4 点：“因前款合同变更的条件（4）的原因变更合同的，为保护投资者权益，由管理人和托管人事先书面达成一致后，于管理人网站向投资者信息披露，并且管理人须在信息披露后 5 个工作日内以书面或者通过管理人网站（由管理人决定）向本计划投资者发送或者刊登合同变更征询意见函，投资者应在合同变更征询意见函指定的日期内按指定的形式回复书面意见，管理人采取如下权利保障措施及安排：

i 投资者不同意变更的，管理人保障其退出权利，投资者应在征询意见函发出后的 5 个工作日内或最近一个开放日按照管理人届时具体安排提出退出本计划的申请；

ii 投资者不同意变更且逾期未申请退出的，则管理人有权在征询意见函中说明的意见回复期届满后将其持有的全

部资产管理计划份额强制退出本计划（退出价格为强制退出当日资产管理计划财产份额净值），由此发生的相关税费、或有损失由该投资者自行承担；

iii 投资者在征询意见函规定期限内未回复意见且逾期未退出的，视同该投资者同意本合同此次变更，管理人不再另行通知；

iv 投资者回复意见不明确的，则视为该投资者不同意合同变更，按照以上(i)、(ii)投资者不同意变更的方式处理。”

三、 本次合同变更实施的程序

1、由管理人和托管人共同签署的补充协议、合同变更公告（含合同变更征询意见函）于2023年2月20日在管理人网站及销售机构指定位置向投资者信息披露；

2、2023年2月21日（含）至2023年2月27日（含）为本次合同变更征询期，投资者应当在合同变更征询期内向销售机构根据合同变更征询意见函（详见附件一）反馈对于合同变更的意见，具体如下：

- (1) 表明“同意”为代表同意本次合同变更；
- (2) 表明“不同意”为代表不同意本次合同变更；
- (3) 不回复且在管理人设立的临时退出开放日未退出的代表同意本次合同变更；
- (4) 回复意见不明确代表不同意本次合同变更；

3、2023年2月28日为管理人设置的临时退出开放日，临时开放日退出不受锁定期限制且豁免退出费用，临时退出开放日内份额持有人仅可办理退出业务，不得办理参与业务。

- (1) 不同意本次合同变更的投资者应当在临时退出开放日提出退出本资产管理计划的申请；
- (2) 投资者在合同变更征询期内回复不同意本次合同变更且在临时退出开放日未申请退出的，管理人有权在临时退出开放日将其持有的全部资产管理计划份额强制退出本计划；

(3) 投资者在合同变更征询期内回复同意本次合同变更，或未回复意见且在临时退出开放日未退出的，视同该投资者同意本合同此次变更，管理人不再另行通知；

(4) 投资者在合同变更征询期内回复意见不明确的，投资者应当在临时退出开放日提出退出本资产管理计划的申请；投资者在合同变更征询期内回复意见不明确且临时退出开放日未申请退出的，管理人有权在临时退出开放日将其持有的全部资产管理计划份额强制退出本计划；

(5) 如管理人依据本合同的约定在临时退出开放日为投资者持有的资产管理计划份额办理强制退出的，退出价格为强制退出当日资产管理计划财产份额净值，由此发生的相关税费、或有损失由该投资者自行承担。

5、2023年3月1日为本次合同变更生效日。

四、 自有资金的退出

证监会于 2023 年 1 月 13 日公布的最新修订的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》，为持续满足法律法规和管理人内控要求，管理人将根据合同 8.4（3）的约定，于该公告披露满 5 个工作日后的最近一个开放日退出本资产管理计划内的全部自有资金持有份额，共 1,000,000.00 份。前述自有资金的持有期限已满足不少于 6 个月，敬请投资人知悉。



野村东方国际证券有限公司

2023 年 2 月 20 日

附件一：合同变更征询意见函

尊敬的份额持有人：

我们兹致函通知您，本公司管理的“野村东方国际 CTA 旗舰 1 号 FOF 集合资产管理计划”（以下简称“产品”）之集合资产管理计划合同（以下简称“本合同”）重要变更。

为适应证监会 2023 年 1 月 13 日公布的最新修订的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》，同时为更好地服务份额持有人与潜在的投资者，并更好地适应投资环境、贴合投资策略，经审慎考虑拟对如下事项进行变更，并征求份额持有人意见：

1. 管理人自有资金参与退出：

“（1）为满足管理人内部统一管理要求，对本资产管理计划自有资金参与比例进行目标动态管理，管理目标为自有资金参与比例不超过产品规模的 8%。

（2）管理人自有资金参与本计划份额的持有期限不少于 6 个月，在符合法律、行政法规等关于自有资金退出规定和本合同约定的情况下，可以与其他投资者同样办理退出业务。

（3）因本计划在开放日因投资者赎回份额造成本计划规模变动等客观因素导致前述（1）中比例被动超标的，自有资金将同步退出，以满足上述自有资金参与比例管理标准。投资者和托管人签署本合同，并且投资者认购/参与本资产管理计划份额，即视为投资者和托管人已经充分理解并同意上述安排。

（4）除上述（3）情形之外，管理人自有资金参与、退出本计划的，为保护投资者权益，管理人应当提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意，具体方式详见附件二；”

2. 关联交易情形的列举：

“本资产管理计划存在的或可能存在的利益冲突的关联交易，包括但不限于：

（1）管理人或将资产管理计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他关联方发行或者承销期内承销的证券将构成关联交易；

（2）管理人或将资产管理计划的资产投资于管理人、托管人管理的其他资产管理计划，或与该等计划发生互为交易对手的交易将构成关联交易；

（3）聘请管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方为资管计划提供服务（包括但不限于经纪服务、投资顾问服务、代销服务或其他服务等），资管计划按约定支付费用将构成关联交易；

（4）管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他关联方认购、参与、退出本资管计划份额将构成关联交易。

投资者签署本合同，认购/参与本资产管理计划份额，即视为已经充分理解并同意上述关联交易，管理人无需就前

述具体关联交易再行分别取得投资者的授权，管理人依据相关要求履行信息披露和监管报告义务。”

3. 合同的变更的条件与程序：调整合同变更的公示期；
4. 其他：其他涉及新规的合同条款更新与文字修订。

为份额持有人方便阅读、理解本次合同的核心变动，上述仅列示与份额持有人利益最为相关的核心变动条款之【管理人自有资金参与退出的概括性授权、关联交易的概括性授权、合同变更条件与程序等条款的变更】，其他合同内容修订，请见附件二“合同变更事项”。

此次合同变更，本公司征询份额持有人意见，具体如下：

1. 若您同意此次变更：

征询意见回函“同意”

2. 若您不同意此次变更：

征询意见回函“不同意”

2023年2月28日为本次合同变更设置的临时退出开放日，若您不同意本次合同变更，应当于该日提出退出本计划的申请。

附件二：合同变更事项

原条款	原条款	条款	条款变更
第一节：前言			
1.1 (2)	订立本合同的依据：《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国证券法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（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》（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》（以下简称《指导意见》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称《内容与格式指引》），和其他有关法律法规。	1.1 (2)	订立本合同的依据： <u>《中华人民共和国民法典》</u> （以下简称 <u>《民法典》</u> ）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国证券法》、 <u>《中华人民共和国期货和衍生品法》</u> 、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（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》（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》（以下简称《指导意见》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称《内容与格式指引》），和其他有关法律法规。
/	/	1.2	<u>本合同是规定资产管理合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，除依据法律法规规定和本资产管理合同的约定外，其他任何与本计划相关的涉及资产管理合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本合同不一致或有冲突，均以本合同为准。资产管理合同的当事人包括投资者、管理人和托管人。</u>
1.2	资产管理计划的管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案。	1.3	资产管理计划的管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行 <u>备案或报告</u>
/	/	1.4	<u>本资产管理计划按照中国法律法规成立并运作，若本合同的内容与届时</u>

			有效的法律法规的强制性规定不一致，应当以届时有效的法律法规的规定为准。
第2节 释义			
/	/	7	<u>《民法典》</u> ：指由2020年5月28日，十三届全国人大三次会议表决通过《中华人民共和国民法典》，及其不时修订和补充。
9	《管理办法》：指由中国证券监督管理委员会2018年第八次主席办公会议审议通过，自2018年10月22日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(中国证监会第151号令)，及其不时修订和补充。	10	《管理办法》：指由中国证券监督管理委员会2018年第八次主席办公会议审议通过，自2018年10月22日起施行， <u>并经证监会修订于2023年1月12日颁布，于2023年3月1日起实施的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(中国证监会第454203号令)</u> ，及其不时修订和补充。
10	《运作管理规定》：指由中国证券监督管理委员会2018年10月22日发布并实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(中国证监会公告第131号)，及其不时修订和补充。	11	《运作管理规定》：指由中国证券监督管理委员会2018年10月22日发布并实施， <u>并经证监会修订于2023年1月12日颁布，于2023年3月1日起实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(中国证监会2023年第2号公告第431号)</u> ，及其不时修订和补充。
16	合格投资者：指依据中国证券监督管理委员会2018年10月22日发布并实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(中国证监会公告第131号)，及其不时修订和补充，具备相应风险识别能力和风险承担能力，且符合本合同第6.1.1条之“募集对象”规定的自然人、法人或其他组织。	17	合格投资者：指依据中国证券监督管理委员会2018年10月22日发布并实施， <u>并经证监会修订于2023年1月12日颁布，于2023年3月1日起实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(中国证监会2023年第2号公告第431号)</u> ，及其不时修订和补充，具备相应风险识别能力和风险承担能力，且符合本合同第6.1.1条之“募集对象”

			规定的自然人、法人或其他组织。
21	计划成立日:指本计划正式成立的日期,即募集资金划入资产管理计划托管账户后,验资报告出具,管理人公告资产管理计划成立之日	22	计划成立日:指本计划正式成立的日期,即募集资金划入资产管理计划托管账户后,验资报告出具,管理人公告资产管理计划成立之日
37	委托财产:指投资者合法所有并委托资产管理人管理并由托管人托管的作为本合同标的的财产。	38	委托财产:指投资者合法所有并委托资产管理人管理并由托管人托管的作为本合同标的的财产 <u>指资产管理计划财产。</u>
44	管理费:指管理人向资产管理计划财产提供投资管理服务所收取的费用。参阅本合同第21.2条	45	管理费:指管理人向资产管理计划财产提供投资管理服务所收取的费用,包括固定管理费和业绩报酬(如有)。参阅本合同第21.2条
/	/	47	<u>关联交易:是指本计划与资产管理计划的关联方之间发生的交易,本计划可能涉及的具体关联交易情形参阅本合同第14节“利益冲突及关联交易”。</u>
第3节 承诺与声明			
3.2 (3)	在管理人发生异常且无法履行管理职能时,依照法律法规的规定、本合同的约定以及中国证监会、基金业协会的要求履行相关资产托管人职责,维护投资者权益	3.2 (3)	在管理人发生异常且无法履行管理职能时,依照法律法规的规定、本合同的约定以及中国证监会、 <u>证券投资基金业协会</u> 的要求履行相关资产托管人职责,维护投资者权益
3.3 (3)	已充分理解本合同条款,了解相关权利义务,了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征,知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺,了解“卖者尽责,买者自负”的原则,投资于本计划将自行承担投资风险。投资者理解,本合同约定的业绩报酬计提基准等内容仅是投资目	3.3 (3)	已充分理解本合同条款,了解相关权利义务,了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征,知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺,了解“卖者尽责,买者自负”的原则,投资于本计划将自行承担投资风险。投资者理解,本合同约定的业绩报酬计提基准等内容仅是投资目

	标而不是管理人对本计划收益状况所做出的承诺或保证。		标 <u>浮动管理费</u> 的计费依据,而不是非管理人对本计划 <u>财产</u> 收益状况所做出的承诺或保证。
第4节 当事人的权利与义务			
4.6 (5)	按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项,承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬(如有)、托管费、审计费、税费等合理费用;	4.6 (5)	按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项,承担资产管理合同约定的管理费、 <u>业绩报酬(如有)</u> 、 <u>托管费、审计费、税费等合理费用</u> ;
4.7 (2)	按照资产管理合同约定,及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬(如有);	4.7 (2)	按照资产管理合同约定,及时、足额获得管理人管理费用及 <u>(包括固定管理费和业绩报酬(如有))</u> ;
/	/	4.7 (7)	以管理人的名义,代表本资产管理计划与其他第三方签署与本资产管理计划投资相关的协议文件、行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
4.8 (17)	聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计;	4.8 (17)	聘请具有证券相关业务资格符合 <u>《证券法》</u> 规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计;
/	/	4.8 (25)	保证向投资者支付的受托资金及 <u>收益返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户</u> ;
4.10 (9)	编制托管年度报告,并向证券投资基金业协会备案,抄报中国证监会相关派出机构;	4.10 (9)	编制托管年度报告,并向证券投资基金业协会备案,抄报 <u>报送</u> 中国证监会相关派出机构;
第5节 资产管理计划基本情况			
5.5.2 (3)	商品及金融衍生品类资产:指依法在交易所市场交易的股指期货、股指期权、交易所ETF期权、国债期货,以及公开募集证券投资基金之商品型基金	5.5.2 (3)	商品及金融衍生品类 <u>期货及衍生品</u> 类资产:指依法在交易所市场交易的股指期货、股指期权、交易所ETF期权、国债期货,以及公开募集证券投资基金之商品型基金
5.5.3	经过穿透合并计算,本计划投资于	5.5.3 (4)	经过穿透合并计算,本计划投资于

(4)	商品及金融衍生品的持仓合约价值占计划总资产比例0%~80% (不含) 或衍生品账户权益占计划总资产比例0%~20% (不含), 且投资于商品及金融衍生品类中商品基金资产占计划总资产比例0%~80% (不含)		商品及金融衍生品类 <u>期货</u> 及衍生品类的持仓合约价值占计划总资产比例0%~80% (不含) 或 <u>期货</u> 及衍生品账户权益占计划总资产比例0%~20% (不含), 且投资于商品及金融衍生品类 <u>期货</u> 及 <u>衍生品类</u> 中商品基金资产占计划总资产比例0%~80% (不含)
第6节 资产管理计划的募集			
6.1.1 (3)	依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构, 包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构;	6.1.1 (3)	依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构, 包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、 <u>商业</u> 银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构;
6.1.1 (5)	基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金, 慈善基金等社会公益基金, 合格境外机构投资者 (QFII)、人民币合格境外机构投资者 (RQFII);		基本养老金、社会保障基金、 <u>企业年金基金</u> 等养老基金, 慈善基金等社会公益基金, 合格境外机构投资者 (QFII)、人民币合格境外机构投资者 (RQFII);
第7节 资产管理计划的成立与备案			
7.1 (2)	投资者人数不少于2人, 且不超过200人;	7.1 (2)	投资者人数不少于2人, 且不超过200人 (<u>符合条件的员工持股计划不穿透计算员工人数</u>);
7.2	资产管理计划的募集金额缴足之日起10个工作日内, 管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告, 并在取得验资报告后公告资产管理计划成立, 并书面通知资产托管人。管理人应在资产管	7.2	资产管理计划的募集金额缴足之日起10个工作日内, 管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告, 并在取得验资报告后公告资产管理计划成立, 并书面通知资产托管人。管理人应在资产管

	理计划成立起5个工作日内报证券投资基金业协会备案。资产管理计划成立前,任何机构和个人不得动用投资者参与资金。		理计划成立起5个工作日内, <u>将资产管理合同、投资者名单与认购金额、资产缴付证明等材料报证券投资基金业协会备案。资产管理计划成立前,任何机构和个人不得动用投资者参与资金。</u>
7.3	<p>资产管理计划备案完成前的投资活动</p> <p>资产管理计划在成立后备案完成前,不得开展投资活动,以现金管理为目的,投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</p>	7.3	<p><u>资产管理计划备案完成前的投资活动</u></p> <p><u>资产管理计划在成立后备案完成前,不得开展投资活动,以现金管理为目的,投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</u></p>
第8节资产管理计划的参与、退出与转让			
8.4.1	<p><u>自有资金的认购/参与方式和比例</u></p> <p>(1)管理人可以自有资金认购/参与本计划,管理人自有资金参与本计划份额不超过本计划总份额的15%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的,应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时调整达标。管理人每次自有资金参与应提前5个工作日告知份额持有人和托管人。</p> <p>(2)自有资金的收益分配</p> <p>管理人自有资金参与持有的计划份额与其他投资者持有计划份额享有相同的分红和收益权。</p> <p>(3)自有资金退出的条件</p> <p>i 管理人自有资金参与本计划份额的持有期限不少于六个月,在符合法律、行政法规等关于自有资金退出规定和本合同约定的情况下,可以与其他投资者同样办理退出业务。</p>	8.4.1	<p><u>自有资金的认购/参与方式和比例和退出的条件:</u></p> <p><u>管理人可以自有资金认购/参与本计划。</u></p> <p><u>(1) 为满足管理人内部统一管理要求,对本资产管理计划自有资金参与比例进行目标动态管理,管理目标为自有资金参与比例不超过产品规模的8%。</u></p> <p><u>(2) 管理人自有资金参与本计划份额的持有期限不少于6个月,在符合法律、行政法规等关于自有资金退出规定和本合同约定的情况下,可以与其他投资者同样办理退出业务。</u></p> <p><u>(3) 因本计划在开放日因投资者赎回份额造成本计划规模变动等客观因素导致前述(1)中比例被动超标的,自有资金将同步退出,以满足上述自有资金参与比例管理标准。投资者和托管人签署本合同,并且投资者认购/参与</u></p>

ii——因资产管理计划规模变动等客观因素导致自有资金参与本计划份额被动超过法律、法规及本合同规定比例上限的,管理人应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时调整达标。

iii——管理人每次自有资金退出应提前5个工作日告知投资者和托管人,告知方式为管理人指定披露网站信息披露。

iv——为应对集合资产管理计划巨额退出以解决流动性风险,或者中国证监会认可的其他情形,在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下,管理人以其自有资金参与及后续的退出可以不受本条前述约定限制。出现上述情形时,管理人应及时告知投资者和托管人,并向相关派出机构报告。

本资产管理计划份额,即视为投资者和托管人已经充分理解并同意上述安排。

(4) 除上述(3)情形之外,管理人自有资金参与、退出本计划的,为保护投资者权益,管理人应当提前5个工作日告知全体投资者和托管人,并取得其同意,具体方式为:

由管理人和托管人事先书面达成一致后,于管理人网站向投资者信息披露,并且管理人须在信息披露后5个工作日内以书面或者通过管理人网站(由管理人决定)向本计划投资者发送或者刊登征询意见函,投资者应在征询意见函指定的日期内按指定的形式回复书面意见,管理人采取如下权利保障措施及安排:

i 投资者不同意的,管理人保障其退出权利,投资者应在征询意见函发出后的5个工作日内或最近一个开放日按照管理人届时具体安排提出退出本计划的申请;

ii 投资者不同意且逾期未申请退出的,则管理人有权在征询意见函中说明的意见回复期届满后将其持有的全部资产管理计划份额强制退出本计划(退出价格为强制退出当日资产管理计划财产份额净值),由此发生的相关税费、或有损失由该投资者自行承担;

iii 投资者在征询意见函规定期限内未回复意见且逾期未退出的,视同该投资者同意,管理人不再另行通知;

iv 投资者回复意见不明确的,则视为该投资者不同意,按照以上(i)、

			<p>(ii) 投资者不同意的方式处理。</p> <p>(5) 为应对集合资产管理计划巨额退出以解决流动性风险,或者中国证监会认可的其他情形,在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下,管理人以其自有资金参与及后续的退出可以不受本条前述约定限制。出现上述情形时,管理人应及时告知投资者和托管人,并向中国证监会相关派出机构报告。</p>
第11节 资产管理计划的投资			
11.2 (3)	商品及金融衍生品类资产:指依法在交易所市场交易的股指期货、股指期权、交易所ETF期权、国债期货,以及公开募集证券投资基金之商品型基金	11.2 (3)	<u>商品及金融衍生品类期货及衍生品类资产</u> :指依法在交易所市场交易的股指期货、股指期权、交易所ETF期权、国债期货,以及公开募集证券投资基金之商品型基金
11.4 (4)	经过穿透合并计算,本计划投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值占计划总资产比例0%~80%(不含)或衍生品账户权益占计划总资产比例0%~20%(不含),且投资于商品及金融衍生品类中商品基金资产占计划总资产比例0%~80%(不含)	11.4 (4)	经过穿透合并计算,本计划投资于 <u>商品及金融衍生品类期货及衍生品类</u> 的持仓合约价值占计划总资产比例0%~80%(不含)或 <u>期货及衍生品</u> 账户权益占计划总资产比例0%~20%(不含),且投资于 <u>商品及金融衍生品类期货及衍生品类</u> 中商品基金资产占计划总资产比例0%~80%(不含)
11.5 (1)	本计划因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素致使资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的,管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易起的15个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调		本计划因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素致使资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的,管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易起的 <u>1520</u> 个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成

	调整的,管理人应及时向中国证监会派出机构报告。		调整的,管理人应及时向中国证监会派出机构报告。
/	/	11.11 (8)	<u>利用资产管理计划,通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式,违规为管理人及其控股股东、实际控制人或其他关联方提供融资;</u>
/	/	11.11 (9)	<u>为管理人或他人违规持有金融机构股权提供便利;</u>
11.11 (8)	从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;	11.11 (10)	从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
/	/	11.11 (11)	<u>不得开展明股实债投资;</u>
/	/	11.11 (12)	<u>不得通过投资其他资产管理产品变相扩大投资范围或者规避监管要求;</u>
第14节利益冲突及关联交易			
14.1	<p>本资产管理计划存在的或可能存在的利益冲突的关联交易,包括但不限于:</p> <p>(1) 管理人或将资产管理计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他关联方发行或者承销期内承销的证券将构成关联交易;</p> <p>(2) 本计划投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司设立并管理的资产管理产品将构成关联交易。</p> <p>投资者签署本合同,认购/参与本资产管理计划份额,即视为已经充分理解并同意上述关联交易。</p>	14.1	<p>本资产管理计划存在的或可能存在的利益冲突的关联交易,包括但不限于:</p> <p>(1) 管理人或将资产管理计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他关联方发行或者承销期内承销的证券<u>将构成关联交易</u>;</p> <p>(2) 本计划投资手管理人或将资产管理计划的资产投资于管理人、托管人管理的其他资产管理计划,或与该等计划发生互为交易对手的交易将构成关联交易;</p> <p>(3) <u>聘请管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方为资管计划提供服务(包括但不限于经纪服务、投资顾问服务、代销服务或其他</u></p>

			<p>服务等), 资管计划按约定支付费用将构成关联交易;</p> <p>(4) 管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他关联方认购、参与、退出本资管计划份额将构成关联交易。</p> <p>投资者签署本合同, 认购/参与本资产管理计划份额, 即视为已经充分理解并同意上述关联交易, 管理人无需就前述具体关联交易再行分别取得投资者的授权, 管理人依据相关要求履行信息披露和监管报告义务。</p>
14.2	<p>管理人运用资产管理计划财产从事除前述列明情形以外的其他重大关联交易, 应事先取得投资者同意, 并应当提供充分证据证明未损害投资者利益, 事后应及时、全面、客观的向投资者和托管人进行临时报告的披露, 并向中国证监会相关派出机构报告。</p>	14.2	<p>管理人运用资产管理计划财产从事除前述列明情形以外的其他重大关联交易的, 应的, 应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定, 事先取得投资者的同意, 并应当提供充分证据证明未损害投资者利益, 事后应及时、全面、客观的向投资者和托管人进行临时报告的披露, 并向中国证监会相关派出机构报告。</p>
第16节, 资产管理计划的财产			
16.1 (1)	<p>资产管理计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任, 投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。</p>	16.1 (1)	<p>资产管理计划财产的为信托财产, <u>其</u>债务由资产管理计划财产本身承担责任, 投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。</p>
16.1 (5)	<p>资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务, 管理人、托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人向管理人或托管人</p>	16.1 (5)	<p>资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务, 管理人、托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人向管理人或托管人</p>

	对资产管理计划财产主张权利时,管理人或托管人应明确向上述债权人告知资产管理计划财产的独立性,管理人、托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性,采取合理措施并及时通知投资者。		对资产管理计划财产主张权利时,管理人或托管人应明确向上述债权人告知资产管理计划财产的独立性,管理人、托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性,采取合理措施并及时通知投资者。
16.2 (3)	管理人以本计划名义开立沪深证 券交易所的证券账户,作为本计划沪 深证券交易的指定证券账户,账户名 称命名规则为:“证券期货经营机构名 称—托管人名称—资产管理计划名 称”,具体以实际开立为准,管理人应 于本计划成立后的七个工作日内开 立。管理人不得将证券账户以出租、 出借、转让或者其他方式提供给他人 使用。	16.2 (3)	管理人以本计划名义开立沪深证 券交易所的证券账户,作为本计划沪 深证券交易的指定证券账户,账户名 称命名规则应当符合 <u>证券投资基金业 协会及证券期货登记结算机构的有关 规定</u> ,具体以实际开立为准,管理人 应于本计划成立后的七个工作日内开 立。管理人不得将证券账户以出租、 出借、转让或者其他方式提供给他人 使用。
第18节 越权交易的界定			
18.2.1	非因管理人主动投资行为导致的 下列不符合投资政策的情形不构成本 合同所述越权交易: 本计划因证券期货市场波动、证券 发行人合并、资产管理计划规模变动等 管理人之外的因素致使资产管理计划 投资不符合法律、行政法规和中国证 监会规定的投资比例或者本合同约定 的投资比例的,管理人应当在流动性受 限资产可出售、可转让或者恢复交易 起的15个交易日内调整至符合相关要 求。确有特殊事由未能在规定时间内 完成调整的,管理人应及时向中国证 监会派出机构报告	18.2.1	非因管理人主动投资行为导致的 下列不符合投资政策的情形不构成本 合同所述越权交易: 本计划因证券期货市场波动、证券 发行人合并、资产管理计划规模变动等 管理人之外的因素致使资产管理计划 投资不符合法律、行政法规和中国证 监会规定的投资比例或者本合同约定 的投资比例的,管理人应当在流动性受 限资产可出售、可转让或者恢复交易 起的 <u>4520</u> 个交易日内调整至符合相关 要求。确有特殊事由未能在规定时间 内完成调整的,管理人应及时向中国 证监会派出机构报告
第23节 信息披露与报告			
23.1.3	资产管理计划支付的固定管理费、	23.1.3 (2)	资产管理计划支付的管理费(包括

(2) vi	托管费、业绩报酬等费用, 包括计提基准、计提方式和支付方式	vi	固定管理费和业绩报酬(如有)、托管费、业绩报酬等费用, 包括计提基准、计提方式和支付方式
23.1.4 (2) vii	资产管理计划支付的固定管理费、托管费、业绩报酬等费用, 包括计提基准、计提方式和支付方式	23.1.4 (2) vii	资产管理计划支付的管理费(包括固定管理费和业绩报酬(如有))、托管费、业绩报酬等费用, 包括计提基准、计提方式和支付方式
23.1.4 (4)	资产管理计划年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格的会计师事务所审计, 审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。	23.1.4 (4)	资产管理计划年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格符合《 <u>证券法</u> 》规定的会计师事务所审计, 审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见。
第24节 风险揭示			
24.1.7	本合同约定收取的管理费、托管费、业绩报酬(如有)均不含上述“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为”需缴纳的增值税及附加。本计划在运营过程中发生的增值税等应税行为需缴纳的增值税及相关附加, 由计划资产承担, 将导致计划收益减少, 净值下降, 从而带来风险。	24.1.7	本合同约定收取的管理费(包括 <u>固定管理费和业绩报酬(如有)</u>)、托管费、业绩报酬(如有)均不含上述“资管产品运营过程中发生的增值税应税行为”需缴纳的增值税及附加。本计划在运营过程中发生的增值税等应税行为需缴纳的增值税及相关附加, 由计划资产承担, 将导致计划收益减少, 净值下降, 从而带来风险。
24.3.1 (2)	本计划投资范围不涉及《 <u>证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法</u> 》第三十七条第五项规定的非标产品, 在本计划合同中没有按照《 <u>内容与格式指引</u> 》的要求制订相应条款;	24.3.1 (2)	本计划投资范围不涉及《 <u>证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法</u> 》第三十七 <u>八</u> 条第五项规定的非标产品, 在本计划合同中没有按照《 <u>内容与格式指引</u> 》的要求制订相应条款;
24.3.3	资产管理计划委托募集所涉风险; 如有需要, 管理人可以聘请已在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为证券投资基金业协会会员的机构作为本计划的销售机构代为推介、	24.3.3	资产管理计划委托募集所涉风险; 如有需要, 管理人可以聘请已在中国证监会注册取得 <u>公开募集证券投资</u> 基金销售业务资格并已成为证券投资基金业协会会员的机构作为本计划的

	<p>销售本计划份额, 并可根据情况变更或增减销售机构。存在委托募集情形时, 尽管管理人将对销售机构进行合理的尽职调查及监督, 将与销售机构以书面形式签署资产管理计划销售协议, 销售机构能否合法存续、有效维系基金销售资格、持续规范地开展销售行为、确保其销售人员专业审慎执业等因素都有可能对既有的份额持有人及潜在的投资者造成影响, 在一定情况下, 可能是实质不利的影响</p>		<p>销售机构代为推介、销售本计划份额, 并可根据情况变更或增减销售机构。存在委托募集情形时, 尽管管理人将对销售机构进行合理的尽职调查及监督, 将与销售机构以书面形式签署资产管理计划销售协议, 销售机构能否合法存续、有效维系基金销售资格、持续规范地开展销售行为、确保其销售人员专业审慎执业等因素都有可能对既有的份额持有人及潜在的投资者造成影响, 在一定情况下, 可能是实质不利的影响</p>
第25节 资产管理合同的变更、终止与财产清算			
25.1.1 (2)	<p>因以下事由, 投资者签署本合同, 认购/参与本计划, 即视为资产管理计划投资者同意, 由管理人全权处理本计划合同的变更事宜:</p> <p>i 对本资产管理计划认购、参与、退出、资产管理计划份额转让和非交易过户业务规则(包括但不限于总规模、单个投资者首次认购、参与金额、每次参与金额及持有本资产管理计划总金额限制、锁定期等)进行调整;</p> <p>ii 调低管理人的固定管理费费率, 调低业绩报酬提取比例;</p> <p>iii 调低参与费、退出费的费率;</p> <p>iv 按照法律法规或本合同规定, 管理人有权变更本合同的其他情形。</p>	25.1.1 (2)	<p>因以下事由, 投资者和托管人签署本合同, 并且投资者认购/参与本计划, 即视为资产管理计划投资者和托管人同意, 由管理人全权处理本计划合同的变更事宜:</p> <p>i 对本资产管理计划认购、参与、退出、资产管理计划份额转让和非交易过户业务规则(包括但不限于总规模、单个投资者首次认购、参与金额、每次参与金额及持有本资产管理计划总金额限制、锁定期等)进行调整;</p> <p>ii 调低管理人的固定管理费费率, 调低业绩报酬提取比例;</p> <p>iii 调低参与费、退出费的费率;</p> <p>iv 按照法律法规或本合同规定, 管理人有权变更本合同的其他情形。</p>
25.1.2 (1)	<p>因上述合同变更的条件(1)的原因变更本合同的, 经管理人与托管人协商一致后, 可以对本计划合同与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改, 或根据相关监管机构或自</p>	25.1.2 (1)	<p>因上述合同变更的条件(1)的原因变更本合同的, 经管理人与托管人协商一致后, 可以对本计划合同与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改, 或根据相关监管机构或自</p>

	<p>律组织备案补正意见的要求对本合同进行修改,更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定。变更后的资产管理合同由管理人于管理人网站披露,披露满5个工作日,且管理人通过官方网站向投资者宣布合同变更生效,此次资产管理合同的变更生效;</p>		<p>律组织备案补正意见的要求对本合同进行修改,更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定。变更后的资产管理合同由管理人于管理人网站披露,披露时长不低于2满5个工作日,且管理人通过官方网站向投资者宣布合同于管理人指定的合同变更日生效,合同变更生效日不得早于披露届满日变更生效,此次资产管理合同的变更生效;</p>
25.1.2 (2)	<p>因上述合同变更的条件(2)的原因变更合同的,管理人将变更事项以书面形式于管理人网站披露,披露满5个工作日,合同变更生效,此次资产管理合同的变更生效。管理人于本次合同变更生效日当日以发送合同变更生效公告扫描件的方式通知托管人;</p>	25.1.2 (2)	<p>因上述合同变更的条件(2)的原因变更合同的,管理人将变更事项以书面形式于管理人网站披露并以书面形式通知托管人,披露时长不低于2满5个工作日,且管理人通过官方网站向投资者宣布合同于管理人指定的合同变更日生效,合同变更生效日不得早于披露届满日变更生效,此次资产管理合同的变更生效;</p>
25.1.2 (3)	<p>因上述合同变更的条件(3)变更本合同的,由管理人和托管人书面协商一致后处理本资产管理计划合同的变更事宜,但管理人有权自行决定变更的事项除外。管理人将变更事项以书面形式于管理人网站披露,披露满5个工作日,且管理人通过官方网站向投资者宣布合同变更生效,此次资产管理合同的变更生效;</p>	25.1.2 (3)	<p>因上述合同变更的条件(3)变更本合同的,由管理人和托管人书面协商一致后处理本资产管理计划合同的变更事宜,但管理人有权自行决定变更的事项除外。管理人将变更事项以书面形式于管理人网站披露,披露时长不低于2满5个工作日,且管理人通过官方网站向投资者宣布合同于管理人指定的合同变更日生效,合同变更生效日不得早于披露届满日变更生效,此次资产管理合同的变更生效;</p>
25.4 (3)	<p>管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解算、被撤销、被宣告破产,且在六个月内没有新的管理人承</p>	25.4 (3)	<p>管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解算解散、被撤销、被宣告破产,且在六个月内没有新的管理人</p>

	接;		承接;
25.4 (5)	持续五个工作日, 投资者少于2人 (不含) 的	25.4 (5)	<u>全部</u> 份额持有人退出全部份额, 或 持续五个工作日, 投资者少于2人 (不 含) 的
25.4 (6)	本资产管理计划各类份额对应的 资产净值的总和低于人民币一千万元, 且管理人决定终止本资产管理计划(为 免歧义, 本资产管理计划各类份额对应 的资产净值的总和低于人民币一千万 元的情况下, 本资产管理计划并不必然 终止, 届时管理人可酌情决定是否终止 本资产管理计划并在管理人网站进行 公告);	25.4 (6)	本资产管理计划各类份额对应的 资产净值的总和低于人民币一千万元, 且管理人决定终止本资产管理计划(为 免歧义, 本资产管理计划各类份额对应 的资产净值的总和低于人民币一千万 元的情况下, 本资产管理计划并不必然 终止, 届时管理人可酌情决定是否终止 本资产管理计划并在管理人网站进行 公告);
25.4 (8)	法律、行政法规、中国证监会规定 及资产管理合同约定的其他情形。 管理人应自资产管理计划终止之 日起五个工作日内报证券投资基金业 协会备案, 前述情形(7)除外。	25.4 (8)	法律、行政法规、中国证监会规定 及资产管理合同约定的其他情形。 管理人应自资产管理计划终止之 日起五个工作日内报告证券投资基 金业协会备案, 前述情形(7)除外。
25.5.3	清算期间, 本计划仍需收取管理 费、托管费。	25.5.3	清算期间, 本计划仍需收取 <u>固定</u> 管 理费、托管费。
25.5.6	管理人应当在资产管理计划清算 结束后5个工作日内将清算结果报证券 基金业协会备案。因资产管理计划财 产流动性受限等原因延期清算的, 管理 人应当及时向中国证监会相关派出机 构报告	25.5.6	管理人应当在资产管理计划清算 结束后5个工作日内将清算结果报告报 证券投资基 <u>金</u> 业协会备案。因资产管 理计划财产流动性受限等原因延期清 算的, 管理人应当及时向中国证监会相 关派出机构报告
25.5.7	资产管理计划财产清算账册及文 件由管理人自资产管理计划终止之日 起不得少于 20年。	25.5.7	资产管理计划财产清算账册及文 件由管理人保存自资产管理计划终止 之日起不得少于 20年。
第29节 其他事项			
29.1	如将来中国证监会或中国证 券基金业协会对资产管理合同的内容		如将来中国证监会或中国证 券基金业协会对资产管理合同的内容

	与格式有其他要求的,管理人将根据中国证监会或中国证券投资基金业协会的相关要求修改本合同的内容和格式。		与格式有其他要求的,管理人将根据中国证监会或中国证券投资基金业协会的相关要求修改本合同的内容和格式。
附件3: 投资监督事项表			
1 (3)	商品及金融衍生品类资产:指依法在交易所市场交易的股指期货、股指期权、交易所ETF期权、国债期货,以及公开募集证券投资基金之商品型基金	1 (3)	<u>商品及金融衍生品类期货及衍生品类资产</u> :指依法在交易所市场交易的股指期货、股指期权、交易所ETF期权、国债期货,以及公开募集证券投资基金之商品型基金
2 (4)	经过穿透合并计算,本计划投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值占计划总资产比例0%~80%(不含)或衍生品账户权益占计划总资产比例0%~20%(不含),且投资于商品及金融衍生品类中商品基金资产占计划总资产比例0%~80%(不含)	2 (4)	经过穿透合并计算,本计划投资于 <u>商品及金融衍生品类期货及衍生品类</u> 的持仓合约价值占计划总资产比例0%~80%(不含)或 <u>期货及衍生品</u> 账户权益占计划总资产比例0%~20%(不含),且投资于 <u>商品及金融衍生品类期货及衍生品类</u> 中商品基金资产占计划总资产比例0%~80%(不含)