

海通期货股份有限公司关于旗下资产管理计划适用证监会令
【第 203 号】和证监会公告[2023]2 号文的说明

尊敬的委托人、托管人：

证监会于 2023 年 1 月修订了《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令【第 203 号】，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》（证监会公告[2023]2 号，以下简称“《运作管理规定》”），并于 2023 年 3 月 1 日起施行。为适应该项修订，自 2023 年 3 月 1 日起，我司作为管理人发起设立的所有资产管理计划，包括但不限于杠杆比例、业绩报酬提取方式（如涉及）等将参照以下条款执行：

一、《运作管理规定》第二十九条，“资产管理计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，该资产管理计划的总资产不得超过其净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、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不受前述规定限制。”

二、《运作管理规定》第四十一条，“业绩报酬应当从分红资金、退出资金或清算资金中提取，从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次。业绩报酬的提取比例不得超过计提基准以上投资收益的 60%。”

除上述内容，我司发行的资产管理计划均需按照《管理办法》及《运作管理规定》规定的相关要求执行。如届时中国证监会及其相关派出机构、证券投资基金业协会、期货业协会另行发布指引的，我司将从其规定，履行相应的合同变更程序。

特此说明。

