

关于《海通期货-海新1号集合资产管理计划资产管理合同（2023年3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1号集合资产管理计划”因投资管理需要及法律法规变化，现需对《海通期货-海新1号集合资产管理计划资产管理合同（2023年3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。

一、本次变更主要涉及

1. 本产品新增收益分配日为业绩报酬计提日、信息披露方式；
2. 合同变更方式；
3. 本产品就《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）及其配套规则《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）的最新要求进行内容修订。

具体变更内容请见附件《海通期货-海新1号集合资产管理计划资产管理合同（2023年3月修订版）调整说明》

二、变更方式

根据《资产管理合同》“二十四、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：

“资产管理合同条款需发生变更，管理人、托管人首先就本合同拟变更事项书面达成一致。管理人就本合同变更事项以书面或电子方式向份额持有人发送合同变更征询意见函（或通知），但是该合同变更征询意见函（或通知）的内容须事先征得托管人同意。份额持有人应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复意见。

份额持有人不同意变更的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内明确回复。份额持有人未在指定日期内回复意见或回复意见不明确的，视为计划份额持有人同意合同变更。征询意见期满，由管理人安排退出日并强制退出所有不同意合同变更的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）。变更事项自该退出日的次交易日起开始生效，对合同各方均具有法律效力。关于所变更事项，本合同另有约定的，以相关约定为准。

变更事项生效后，管理人应及时向托管人出具盖章的合同变更生效通知，并于5个工作日内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6月9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6月9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6月12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1号集合资产管理计划资产管理合同（2023年5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1号集合资产管理计划资产管理合同（2023年5月修订版）》。



章节	修订前正文	修订后正文
期货公司资产管理业务风险揭示书	二、风险揭示 （一）特殊风险揭示 1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险 7、合同预授权风险 本计划因投资运作需求，存在部分合同条款需要委托人预授权，请投资人仔细阅读合同，注意相关预授权范围。如签署本合同即代表委托人同意该项预授权，请委托人关注自身权益，防范风险。 （二）一般风险揭示 1、本金损失风险 管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认购/参与资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。 8、关联交易风险 本计划可能进行如下关联交易：①投资管理人、托管人及与管理人、托管人有关联关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，②与资产管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方互为交易对手方，③接受资产管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方为发行主体的证券作为质押标的的，④投资于由管理人或其关联方管理的产品或者与托管人或其关联方管理的其他产品等其他监管认可的关联交易，管理人确认已建立防范利益输送和利益冲突的机制，确认该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行为，但该等交易仍构成关联交易，可能存在利益冲突风险。	二、风险揭示 （一）特殊风险揭示 1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险 7、合同预授权风险 本计划因投资运作需求，存在部分合同条款需要委托人预授权，请投资人仔细阅读合同，注意相关预授权范围。如签署本合同即代表委托人同意该项预授权，请委托人关注自身权益，防范风险。 8、信息披露风险 本计划因投资运作需求，管理人有权根据计划实际运作情况对资产管理合同相关条款进行调整或补充明确，并及时予以公告。本计划的开放期及参与退出安排、管理人自有资金参与退出、合同变更、信息披露报告等管理人需要向投资者披露的信息采用管理人网站公告、代销机构网站公告的方式进行披露，可能存在投资者没有及时查阅管理人网站或代销机构网站相关信息带来的风险。 特殊情况下，管理人有权根据披露事项的性质、时间、情形及对投资者的影响情况等，决定将公告方式改为电话、短信、邮件等其他方式向投资者披露，可能存在投资者没有及时查阅相关信息而带来的风险。此外，若投资者在管理人或代销机构留存的通讯信息不准确、未能及时更新的，将导致管理人或代销机构无法及时通知到投资者、投资者无法及时获知披露信息的风险。 （二）一般风险揭示 1、本金损失风险 管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产

管理计划财产中的认购/参与资金本金不受损失,也不保证一定盈利及最低收益。

.....

8、关联交易风险

本计划可能进行如下关联交易：①投资管理人、托管人及与管理人、托管人有关联关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，②与资产管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方互为交易对手方，③接受资产管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方为发行主体的证券作为质押标的的，④投资于由管理人或其关联方管理的产品或者与托管人或其关联方管理的其他产品等其他监管认可的关联交易，⑤其他依据法律法规、监管规定可能存在关联交易的情形。管理人确认已建立防范利益输送和利益冲突的机制，确认该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行为，但该等交易仍构成关联交易，可能存在利益冲突风险。

按照关联交易的分类，本计划如进行关联交易还存在一般关联交易风险和重大关联交易风险：

(1) 一般关联交易风险

委托人签署本合同即代表同意本计划可从事一般关联交易，交易前无需另行取得份额持有人的同意或通知份额持有人。管理人运用计划财产从事一般关联交易的，在交易完成后的合理时间内将交易的情况向委托人披露。委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知关联交易事项，从而存在风险。

(2) 重大关联交易风险

若本计划从事重大关联交易的，应事前逐笔征得委托人同意，在交易完成后的合理时间内将交易的情况向委托人披露。委托人可能因为未能有效获知重大关联交易的风险即同意管理人进行重大关联交易，从而存在风险。

管理人运用计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使，进而可能影响计划份额持有人的利益。此外，若将来法律、行政法规及中国证监会的规定对于计划的关联交易做出新的监管要求的，本计划将按照届时最新的监管要求进行调整，该等调整可能会对计划的投资收益造成影响。

“八、资产管理计划的参与、退出、份额转让和非交易过户”	(十四) 资产管理人以自有资金参与本计划的情况 1、认购、参与条件 资产管理人以自有资金参与本资产管理计划的持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时，资产管理人、资产托管人首先就资产管理人自有资金参与、退出事项达成一致。征得资产托管人同意后，资产管理人应当提前 5 个工作日就自有资金参与、退出事项通过管理人网站、代销机构或本合同约定的其他方式向委托人发送征询意见函（或通知）。委托人不同意管理人自有资金参与、退出的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内退出本计划（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）；委托人未在指定的日期内退出本计划的，视为资产委托人同意管理人自有资金参与、退出。征询期满，管理人自有资金即可进行参与、退出，无需再另行通知委托人及托管人。 资产管理人及其子公司以自有资金参与本资产管理计划的份额合计不得超过该计划总份额的 50%。中国证监会对自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因本资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，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。对在开放期内由于委托人退出份额导致的管理人自有资金投资“被动超标”的情形，无需提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意，但事后应当及时披露。 为应对集合资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，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，资产管理人及其子公司以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受上述条款规定的限制，但应当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。 2、认购、参与、退出方式 资产管理人或其资产管理子公司的自有资金和董事、监事、高级管理人员、从业人员及其配偶，参与本计划的，其认购、参与、退出方式应遵循本合同有关条款规定。	(十四) 资产管理人及其控股股东、子公司以自有资金参与本计划的情况 1、认购、参与条件 资产管理人及其控股股东、子公司以自有资金参与本资产管理计划的持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时，资产管理人、资产托管人首先就资产管理人及其控股股东、子公司自有资金参与、退出事项达成一致。征得资产托管人同意后，资产管理人应当提前 5 个工作日就自有资金参与、退出事项通过管理人网站、代销机构或本合同约定的其他方式向委托人发送征询意见函（或通知）。委托人不同意资产管理人及其控股股东、子公司自有资金参与、退出的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内退出本计划（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）；委托人未在指定的日期内退出本计划的，视为资产委托人同意资产管理人及其控股股东、子公司自有资金参与、退出。征询期满，资产管理人及其控股股东、子公司自有资金即可进行参与、退出，无需再另行通知委托人及托管人。 资产管理人及其控股股东、子公司以自有资金参与其自身或其子公司管理的单个集合资产管理计划的份额合计不得超过该资产管理计划总份额的 50%。中国证监会对自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因本资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，资产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。对在开放期内由于委托人退出份额导致的资产管理人及其控股股东、子公司自有资金投资“被动超标”的情形，无需提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意，但事后应当及时披露。 为应对集合资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，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，资产管理人及其控股股东、子公司以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受上述条款规定的限制，但应当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。 2、认购、参与、退出方式 资产管理人及其控股股东、子公司的自有资金和董事、监事、高级管理人员、从业人员及其配偶，
------------------------------------	--	--

	3、自有资金责任承担方式和金额 管理人自有资金参与的份额与其他委托人持有的同类份额享有相同的权利和义务。	参与本计划的，其认购、参与、退出方式应遵循本合同有关条款规定。 3、自有资金责任承担方式和金额 资产管理人及其控股股东、子公司所持的集合资产管理计划份额与其他委托人持有的同类份额享有相同的权利和义务。
“十四、利益冲突及关联交易”	(一) 本计划存在的或可能存在利益冲突的情形及处理方式： 1、本计划存在的或可能存在利益冲突的情形： 1) 本计划投资于资产管理人、资产托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券； 2) 本计划投资于资产管理人、资产托管人及其关联方或者与前述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品； 3) 本计划与资产管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方互为交易对手方的，本计划接受资产管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方为发行主体的证券作为质押标的的。 2、委托人在此对上述列举的存在的或可能存在的利益冲突情形表示知悉，其中，涉及关联交易的，按以下约定进行处理： 委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事一般关联交易，管理人无需就具体的一般关联交易分别取得委托人的个别授权。管理人运用受托资产从事一般关联交易的，应遵循客户利益优先的原则，事后及时、全面、客观地向委托人和托管人进行披露。 管理人运用委托资产从事重大关联交易的，应事先取得委托人同意，并有充分证据证明未损害委托人利益，事后及时、全面、客观地向委托人和托管人进行披露。管理人应通过销售机构网站或本合同约定的联系方式，在事项发生之日起五日内告知委托人和托管人。 关联方按照《企业会计准则》的规定确定，托管人的关联方名单以托管人向资产管理人披露的名单为准，管理人的关联方名单以公开年报信息为准。	(一) 本计划存在的或可能存在利益冲突的情形、关联交易的情形及关联交易处理方式： 1、本计划存在的或可能存在关联交易的情形： 1) 本计划投资于资产管理人、资产托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券； 2) 本计划与资产管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方互为交易对手方的，本计划接受资产管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方为发行主体的证券作为质押标的的。 3) 本计划投资于由资产管理人或其关联方管理的产品或者与资产托管人或其关联方管理的其他产品等其他监管认可的关联交易； 4) 其他依据法律法规、监管规定可能存在关联交易的情形。 2、本计划存在的或可能存在利益冲突的情形：本计划存在的或可能存在利益冲突的情形除本条第1款所列情形外，还包括： 1) 本计划投资于资产管理人、资产托管人及其关联方或者与前述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的投资产品的情形； 2) 其他依据法律法规、监管规定可能存在利益冲突的情形。 3、管理人对一般关联交易与重大关联交易的认定标准如下： 以上本计划存在的或可能存在关联交易的情形中，单笔交易金额超过5亿元人民币或单笔交易金额占该资产管理计划资产净值20%以上（不含本数）的1)、2)、4)类交易属于重大关联交易，其他交易属于一般关联交易。 如法律法规、中国证监会和证券投资基金业协会另有规定，以其最新规定为准，届时管理人在管理人官网 www.htfutures.com 予以披露及更新，请委托人注意查询。 4、本计划的关联方范围及披露方式：

一般关联交易与重大关联交易的认定标准以证券投资基金业协会及资产管理人发布的最新规定为准，管理人在管理人官网 www.htfutures.com 予以披露及更新，请委托人注意查询。 3、除前款规定外，资产管理人不得将本计划直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为资产管理人、资产托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部资产委托人均符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得资产委托人同意的除外。 4、管理人承诺不以资产管理计划的资金与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。管理人承诺不利用资产管理计划，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，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资。管理人承诺不为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利。 5、资产管理人运用本计划财产从事关联交易的，应当建立健全内部审批机制和评估机制，遵循资产委托人利益优先原则，采取切实有效措施，防范利益冲突，保护资产委托人合法权益。相关交易按照法律法规或本合同约定进行信息披露，并向中国证监会相关派出机构报告。	本计划的关联方范围包括但不限于按照《企业会计准则》规定确定的管理人、托管人及其的控股股东、实际控制人或者其他关联方。 管理人、托管人的关联方名单以公开年报信息为准，委托人可通过公开年报进行查询。管理人应及时向托管人提供关联方名单，如因管理人未及时提供关联方名单导致托管人监控不及时，托管人不承担责任。 5、对上述列举的存在的或可能存在的关联交易情形，管理人按以下约定进行处理： 委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事一般关联交易，管理人无需就具体的一般关联交易分别取得委托人的个别授权。管理人运用受托资产从事一般关联交易的，应遵循客户利益优先的原则，事后及时、全面、客观地向委托人和托管人进行披露。 管理人运用委托资产从事重大关联交易的，应事先取得委托人同意，并有充分证据证明未损害委托人利益，事后及时、全面、客观地向委托人和托管人进行披露。管理人应通过销售机构网站或本合同约定的联系方式，在事项发生之日起五日内告知委托人和托管人。 6、关联交易的审批与内控机制 本计划进行一般关联交易的，在管理人常规的交易审批流程上还需完成关联交易的评审流程。关联交易的评审流程由管理人交易岗准备相关材料并发起，然后由管理人资产管理部的投资决策小组进行评估和确认。评估时遵循投资者利益优先原则，重点关注该笔交易的必要性，拟成交价格对比基准价格的偏离度是否位于相关法规约定的合理范围内等。关联交易的评审和常规的交易审批均通过后，由管理人风控岗检查评审流程完成后，方能执行交易。一般关联交易完成后，应及时告知投资者和托管人，并按要求向监管机构报送。
（二）资产委托人签署本合同即表明其已经知晓本计划存在上述关联交易。资产委托人不得因本计划投资收益劣于管理人、投资顾问（如有）及其关联方管理的其他类似投资产品，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。 （三）本计划存在利益冲突的信息披露 1、披露方式 资产管理人应当通过邮递、传真、电话、短信、电子邮件、官网公告、微信、QQ 等本合同约定的方式之一向资产委托人、资产托管人进行信息披露。 2、披露内容	本计划进行重大关联交易的，需上报管理人的资产管理业务投资决策委员会审批。经资产管理业务投资决策委员会审批通过的重大关联交易，还应事先取得全体投资者同意，由管理人风控岗检查所有流程完成后，方能执行交易。重大关联交易完成后，应及时告知投资者和托管人，并按要求向监管机构报送。 本计划投资管理人关联方设立的资产管理产

资产管理人应当将本计划当期涉及的关联交易内容、关联方、处理方式等进行披露。 3、披露频率 资产管理人应当至少每季度对关联交易的相关情况进行一次披露。 管理人应及时向托管人提供关联方名单，如因管理人未及时提供关联方名单导致托管人监控不及时，托管人不承担责任。	品的情形，可豁免发起一般关联交易的评审流程。在交易完成后，需在定期报告中向投资人和托管人披露关联交易具体情况。 管理人对关联交易的审批与内控机制将按照管理人关联交易制度以及监管要求进行。管理人可根据最新监管要求及公司内控要求对关联交易制度进行修订。届时管理人在管理人官网 www.htfutures.com 予以披露及更新，请委托人注意查询。 7、除前款规定外，资产管理人不得将本计划直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为资产管理人、资产托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。全部资产委托人均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得资产委托人同意的除外。 8、管理人承诺不以资产管理计划的资金与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。管理人承诺不利用资产管理计划，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，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资。管理人承诺不为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利。 9、资产管理人运用本计划财产从事关联交易的，应当建立健全内部审批机制和评估机制，遵循资产委托人利益优先原则，采取切实有效措施，防范利益冲突，保护资产委托人合法权益。相关交易按照法律法规或本合同约定进行信息披露，并向中国证监会相关派出机构报告。 （二）资产委托人签署本合同即表明其已经知晓本计划存在上述关联交易。资产委托人不得因本计划投资收益劣于管理人、投资顾问（如有）及其关联方管理的其他类似投资产品，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。 （三）本计划存在利益冲突的信息披露 1、披露方式 资产管理人应当通过邮递、传真、电话、短信、电子邮件、官网公告、微信、QQ 等本合同约定的方式之一向资产委托人、资产托管人进行信息披露。 2、披露内容
--	--

		资产管理人应当将本计划当期涉及的关联交易内容、关联方、处理方式等进行披露。 3、披露频率 资产管理人应当至少每季度对关联交易的相关情况进行一次披露。																		
“二十、资产管理业务的费用与税收”	(2) 业绩报酬的提取原则 a) 采用单个投资者单笔投资年化收益差额法，同一委托人不同时间多次参与的，对计划份额持有人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。 b) 本计划的业绩报酬计提日为委托人退出日、计划终止日。业绩报酬计提频率不得超过每 6 个月一次，因委托人退出、计划终止，不受前述提取频率的限制。 c) 在退出、计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金和清算资产中扣除。 d) 在计划份额持有人申请退出时计算业绩报酬的，管理人按“先进先出”的原则，即按照计划份额持有人份额参与的先后次序确定退出顺序，计算退出份额对应的业绩报酬。 (3) 业绩报酬提取的方法 ①每笔申购份额以上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。年化收益率的计算公式如下： $\text{年化收益率 } ri = (Pi - P0) / [P0x \times (T \div 365)]$ Pi =本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值 P0 =上一个业绩报酬计提基准日（首次计提时，则为认购/参与日）的份额累计净值 P0x =上一个业绩报酬计提基准日（首次计提时，则为认购/参与日）的份额净值 T =上一个业绩报酬计提日(含)（首次计提时，则为计划成立日/申购确认日）到本次业绩报酬计提日（不含）。 ②每笔份额业绩报酬计提如下： <table border="1"> <tr> <th>运作周期 年化收益率</th><th>收取比例</th><th>浮动管理费计算公式</th></tr> <tr> <td>$ri \leq Y\%$</td><td>0</td><td>$E = 0$</td></tr> <tr> <td>$Y\% < ri$</td><td>X%</td><td>$E = N \times P0x \times (ri - Y\%) \times X\% \times (T \div 365)$</td></tr> </table>	运作周期 年化收益率	收取比例	浮动管理费计算公式	$ri \leq Y\%$	0	$E = 0$	$Y\% < ri$	X%	$E = N \times P0x \times (ri - Y\%) \times X\% \times (T \div 365)$	(2) 业绩报酬的提取原则 a) 采用单个投资者单笔投资年化收益差额法，同一委托人不同时间多次参与的，对计划份额持有人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。 b) 本计划的业绩报酬计提日为委托人退出日、收益分配日、计划终止日。业绩报酬计提频率不得超过每 6 个月一次，因委托人退出、计划终止，不受前述提取频率的限制。 c) 在退出、收益分配、计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金、拟分配收益、清算资产中扣除。 收益分配业绩报酬从委托人收益分配资金中进行扣除（如果委托人本次收益分配的金额小于应计提的业绩报酬时，则本次计提的业绩报酬为该委托人的收益分配资金）。 d) 在计划份额持有人申请退出时计算业绩报酬的，管理人按“先进先出”的原则，即按照计划份额持有人份额参与的先后次序确定退出顺序，计算退出份额对应的业绩报酬。 (3) 业绩报酬提取的方法 ①每笔申购份额以上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。年化收益率的计算公式如下： $\text{年化收益率 } ri = (Pi - P0) / [P0x \times (T \div 365)]$ Pi =本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值 P0 =上一个业绩报酬计提基准日（首次计提时，则为认购/参与日）的份额累计净值 P0x =上一个业绩报酬计提基准日（首次计提时，则为认购/参与日）的份额净值 T =上一个业绩报酬计提日(含)（首次计提时，则为计划成立日/申购确认日）到本次业绩报酬计提日（不含）。 ②每笔份额业绩报酬计提如下： <table border="1"> <tr> <th>运作周期 年化收益率</th><th>收取比例</th><th>浮动管理费计算公式</th></tr> <tr> <td>$ri \leq Y\%$</td><td>0</td><td>$E = 0$</td></tr> <tr> <td>$Y\% < ri$</td><td>X%</td><td>$E = N \times P0x \times (ri - Y\%) \times X\% \times (T \div 365)$</td></tr> </table>	运作周期 年化收益率	收取比例	浮动管理费计算公式	$ri \leq Y\%$	0	$E = 0$	$Y\% < ri$	X%	$E = N \times P0x \times (ri - Y\%) \times X\% \times (T \div 365)$
运作周期 年化收益率	收取比例	浮动管理费计算公式																		
$ri \leq Y\%$	0	$E = 0$																		
$Y\% < ri$	X%	$E = N \times P0x \times (ri - Y\%) \times X\% \times (T \div 365)$																		
运作周期 年化收益率	收取比例	浮动管理费计算公式																		
$ri \leq Y\%$	0	$E = 0$																		
$Y\% < ri$	X%	$E = N \times P0x \times (ri - Y\%) \times X\% \times (T \div 365)$																		

	Y=每个运作周期的浮动业绩报酬计提基准; X=浮动业绩报酬计提比例; E=某笔份额N对应的业绩报酬,E的计算结果保留到小数点后两位,小数点后第三位四舍五入; N为本次计提基准日对应计提的份额数量。 (4) 业绩报酬的支付 上述业绩报酬在退出计划份额、计划终止清算后 10 个工作日内,由计划托管人根据资产管理人出具的划款指令支付给资产管理人。 账户名称:海通期货股份有限公司 账号:310066726018170157026 开户银行:交通银行上海第一支行	<table><tr><td>$ri \leq Y\%$</td><td>0</td><td>$E = 0$</td></tr><tr><td>$Y\% < ri$</td><td>X%</td><td>$E = N \times P0_x \times (ri - Y\%) \times X\% \times (T \div 365)$</td></tr></table> Y%=每个运作周期的浮动业绩报酬计提基准; X%=浮动业绩报酬计提比例; E=某笔份额N对应的业绩报酬,E的计算结果保留到小数点后两位,小数点后第三位四舍五入; N为本次计提基准日对应计提的份额数量。(4) 业绩报酬的支付 上述业绩报酬在退出计划份额、收益分配、计划终止清算后 10 个工作日内,由计划托管人根据资产管理人出具的划款指令支付给资产管理人。 账户名称:海通期货股份有限公司 账号:310066726018170157026 开户银行:交通银行上海第一支行	$ri \leq Y\%$	0	$E = 0$	$Y\% < ri$	X%	$E = N \times P0_x \times (ri - Y\%) \times X\% \times (T \div 365)$
$ri \leq Y\%$	0	$E = 0$						
$Y\% < ri$	X%	$E = N \times P0_x \times (ri - Y\%) \times X\% \times (T \div 365)$						
	4、资产管理人和资产托管人协商一致后,可根据市场发展情况调低管理费和资产托管费率。	4、资产管理人和资产托管人协商一致后,可根据市场发展情况调低资产托管费率。						
“二十二、信息披露与报告”	(二) 向投资者提供的报告 1、净值披露 资产管理人应当向投资者披露经托管人复核的资产管理计划净值,至少每周披露一次。 (四) 资产管理人向投资者提供报告的方式 资产管理人向投资者提供的报告,将按照相关监管规定通过以下至少一种方式进行。投资者信息查询将通过以下至少一种中国证监会允许的、本合同约定的方式进行。 1、资产管理人网站 定期报告、临时报告等有关本委托财产的信息将在资产管理人网站上披露,投资者可随时查阅,网址:www.htfutures.com。 2、邮寄服务 资产管理人向投资者邮寄定期报告、临时报告等有关委托财产的信息。投资者在资产管	(二) 向投资者提供的报告 1、净值报告 管理人每日将经托管人复核的最近一个交易日的计划份额净值披露给资产委托人,通过代销机构购买本计划的委托人,管理人将净值文件发送给代销机构,由代销机构向委托人披露;同时管理人应当在本合同、说明书或等信息披露文件上载明计划份额参与、退出价格的计算方式及有关参与、退出费率,并保证投资人能够在销售机构查阅或者复制前述信息资料。 (四) 资产管理人向投资者提供报告的方式 除本合同另有约定外,管理人有权采用下列一种或多种方式向资产委托人提供报告或进行相关通知。 (1) 管理人网站(首选) 管理人通过管理人网站(www.htfutures.com)向资产委托人提供报告和信息查询,内容包括净值						

	理合同上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，投资者应当及时通知资产管理人。 3、传真或电子邮件方式 如投资者留有传真号、电子邮箱等联系方式的，资产管理人也可通过传真、电子邮件、电报等方式将报告信息通知投资者。 4、投资者向托管人查询信息的方式 (1) 投资者可通过电话、传真或电子邮件等联系方式，经由管理人向托管人查询有关信息披露资料。 (2) 对于管理人向投资者提供的文件材料中不在托管人复核职责范围内的信息，应由管理人保证该等信息的真实性、有效性、合法性。	报告、季度报告、年度报告、本计划相关公告等。 (2) 电子邮件或短信（次选） 如资产委托人留有电子邮箱或手机号等联系方式，管理人可通过电子邮件或短信等方式将报告信息告知资产委托人。 (3) 邮寄服务 管理人可向资产委托人邮寄年度报告等有关本计划的信息。资产委托人在销售机构留存的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，资产委托人应当及时以书面方式或以管理人规定的其他方式通知管理人。 管理人通过以上方式之一披露法律法规及本合同约定的信息，视为管理人已履行披露、通知义务。请委托人事必注意查阅管理人网站、传真、电子邮件、手机短信、快递等。通过代销机构购买本计划的委托人，管理人将信息披露文件发送给代销机构，由代销机构向委托人披露。
“二十三、风险揭示”	(一) 一般风险揭示 8、关联交易风险 本计划可能进行如下关联交易：①投资管理人、托管人及与管理人、托管人有关联关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，②与资产管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方互为交易对手方，③接受资产管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方为发行主体的证券作为质押标的的，④投资于由管理人或其关联方管理的产品或者与托管人或其关联方管理的其他产品等其他监管认可的关联交易，管理人确认已建立防范利益输送和利益冲突的机制，确认该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行为，但该等交易仍构成关联交易，可能存在利益冲突风险。	(一) 一般风险揭示 8、关联交易风险 本计划可能进行如下关联交易：①投资管理人、托管人及与管理人、托管人有关联关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，②与资产管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方互为交易对手方，③接受资产管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方为发行主体的证券作为质押标的的，④投资于由管理人或其关联方管理的产品或者与托管人或其关联方管理的其他产品等其他监管认可的关联交易，⑤其他依据法律法规、监管规定可能存在关联交易的情形。管理人确认已建立防范利益输送和利益冲突的机制，确认该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行为，但该等交易仍构成关联交易，可能存在利益冲突风险。 按照关联交易的分类，本计划如进行关联交易还存在一般关联交易风险和重大关联交易风险： (1) 一般关联交易风险 委托人签署本合同即代表同意本计划可从事一般关联交易，交易前无需另行取得份额持有人的同意或通知份额持有人。管理人运用计划财产从事一般关联交易的，在交易完成后的合理时间内将交

		易的情况向委托人披露。委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知关联交易事项，从而存在风险。 (2) 重大关联交易风险 若本计划从事重大关联交易的，应事前逐笔征得委托人同意，在交易完成后的合理时间内将交易的情况向委托人披露。委托人可能因为未能有效获知重大关联交易的风险即同意管理人进行重大关联交易，从而存在风险。 管理人运用计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使，进而可能影响计划份额持有人的利益。此外，若将来法律、行政法规及中国证监会的规定对于计划的关联交易做出新的监管要求的，本计划将按照届时最新的监管要求进行调整，该等调整可能会对计划的投资收益造成影响。
“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”	(一) 资产管理合同变更的条件、程序 1、各方一致同意，以下事项可由资产管理人和资产托管人协商后变更： (1) 调低资产管理人或资产托管人的报酬标准； (2) 资产管理人、托管人的银行收款账号的变更； (3) 调低参与费、退出费的费率； (4) 对本资产管理计划的认购、参与、退出、非交易过户的原则、时间、业务规则，资产管理计划份额转让的业务规则(包括但不限于总规模、单个投资者首次认购、参与金额及持有的本资产管理计划总金额限制等)进行调整； (5) 因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变化需要变更本资产管理合同，对资产管理合同的变更不涉及合同当事人权利义务关系发生变化的，资产管理人可以与资产托管人协商后修改本资产管理合	(一) 资产管理合同变更的条件、程序 1、当出现下列情形时，资产管理人有权单独变更合同内容： (1) 调低认购、参与退出费率(如有)、管理费率； (2) 资产管理人的银行收款账号的变更； (3) 投资经理的变更； (4) 资产管理计划认购、参与、退出、非交易过户的原则、时间、业务规则等变更； (5) 对资产管理合同的变更不涉及合同当事人权利义务关系发生重大变化； (6) 对资产管理合同的变更对资产委托人利益无实质性不利影响的情形。 对上述资产管理人有权单独变更合同的内容进行变更后，资产管理人按照本合同的约定向资产委托人披露变更的具体内容，同时应及时将变更内容通知资产托管人。 2、因法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管

同，并由资产管理人按照本资产管理合同约定及时向投资者披露变更的具体内容； （6）法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。 2、除上述事项外，如资产管理合同条款需发生变更，管理人、托管人首先就本合同拟变更事项书面达成一致。管理人就本合同变更事项以书面或电子方式向份额持有人发送合同变更征询意见函（或通知），但是该合同变更征询意见函（或通知）的内容须事先征得托管人同意。份额持有人应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复意见。 3、管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利，具体以资产管理人届时安排并以公告为准。	理合同的，管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。 3、除上述事项外，如资产管理合同条款需发生变更，管理人、托管人首先就本合同拟变更事项书面达成一致。管理人就本合同变更事项以书面或电子方式向份额持有人发送合同变更征询意见函（或通知），但是该合同变更征询意见函（或通知）的内容须事先征得托管人同意。份额持有人应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复意见。 4、管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利，具体以资产管理人届时安排并以公告为准。
---	---