

关于《海通期货利达 1 号集合资产管理计划资产管理合同》 变更征询意见函

尊敬的委托人：

由我司担任管理人的“海通期货利达 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《海通期货利达 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（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. 本产品业绩报酬计提日、信息披露方式；
2. 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《海通期货利达 1 号集合资产管理计划资产管理合同调整说明》

二、变更方式

根据《资产管理合同》“二十五、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：

“资产管理人、资产托管人首先就本合同拟变更事项达成一致。资产管理人就本合同变更事项向资产委托人发送合同变更征询意见函（或通知）。资产委托人应在征询意见函（或通知）指定的日期内按指定的形式回复意见。资产委托人不同意变更的，应在征询意见函（或通知）指定的日期内明确回复；资产委托人未在指定日期内回复意见或未在指定的日期内退出本计划的，视为资产委托人同意合同变更。征询意见期满，由管理人安排临时开放日并强制退出所有不同意合同变更的计划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）。变更事项自临时开放日的次工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。变更事项生效后，管理人应及时向资产委托人、托管人出具盖章的合同变更生效通知，并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 27 日当日退出本计划（本次退出份额如持有期限不满 30 天的，管理人免收退出费）；如您未在 2023 年 6 月 27 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 28 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《海通期货利达 1 号集合资产管理计划资产管理合同（2023 年 6 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《海通期货利达 1 号集合资产管

理计划资产管理合同（2023年6月修订版）》。

三、 风险揭示

本计划因投资运作需求，新增部分合同条款需要委托人预授权，请您仔细阅读《海通期货利达1号集合资产管理计划资产管理合同调整说明》，注意相关预授权范围。如您未在临时开放期内退出本计划即代表您同意该项预授权，请您关注自身权益，防范风险。



章节	修订前正文	修订后正文
海通期货利达 1 号集合资产管理计划资产管理业务风险揭示书	<p>“二、风险揭示</p> <p>（一）特殊风险揭示</p> <p>……</p> <p>7、参与债券回购风险</p> <p>债券回购为提升整体投资组合收益提供了可能，其主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。</p>	<p>“二、风险揭示</p> <p>（一）特殊风险揭示</p> <p>……</p> <p>7、参与债券回购风险</p> <p>债券回购为提升整体投资组合收益提供了可能，其主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。</p> <p>8、合同预授权风险</p> <p>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。</p> <p>9、信息披露风险</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>.....</p> <p>8、关联交易风险</p> <p>本计划除可能投资于管理人、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外，还可能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，管理人确认其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。”</p>	<p>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。</p> <p>(二) 一般风险揭示</p> <p>.....</p> <p>8、关联交易风险</p> <p>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。</p> <p>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：</p> <p>(1) 一般关联交易风险</p> <p>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。</p> <p>(2) 重大关联交易风险</p> <p>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。</p> <p>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</p>
--	--	--

		<p>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。”</p>
一、前言	<p>“（一）订立本合同的目的、依据和原则： ……</p> <p>2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《期货交易管理条例》、《期货经营机构资产管理业务备案管理规则》、《私募投资基金监督管理暂行办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》”）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》及其他法律法规的有关规定。 ……</p> <p>（二）资产管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。</p> <p>中国证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除资产管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表中国证券投资基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。”</p>	<p>“（一）订立本合同的目的、依据和原则： ……</p> <p>2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国期货和衍生品法》、《期货交易管理条例》、《期货经营机构资产管理业务备案管理规则》、《私募投资基金监督管理暂行办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》”）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》及其他法律法规的有关规定。 ……</p> <p>（二）资产管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为按法规要求向监管机构进行报备。</p> <p>中国证券投资基金业协会接受资产管理计划备案不能免除资产管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表中国证券投资基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。”</p>
四、当事人及权利义务	<p>“2、资产管理人的权利 ……</p> <p>（4）根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会； ……</p> <p>3、资产管理人的义务</p>	<p>“2、资产管理人的权利 ……</p> <p>（4）根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构； ……</p> <p>3、资产管理人的义务</p>

	<p>.....</p> <p>(19) 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；</p> <p>(20) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；</p> <p>(21) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；”</p> <p>余项序号顺延。</p>	<p>.....</p> <p>(19) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；</p> <p>(20) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；</p> <p>(21) 保证向投资者支付的受托资金及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；</p> <p>(22) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，并报送中国证监会相关派出机构；”</p> <p>余项序号顺延。</p>
五、资产管理计划基本情况	<p>“（六）投资比例及限制：</p> <p>.....</p> <p>9、商品及金融衍生品类持仓市值（非轧差）合并计算不超过计划净资产的1%。</p> <p>.....</p> <p>11、参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过本资产管理计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。”</p>	<p>“（六）投资比例及限制：</p> <p>.....</p> <p>9、期货和衍生品类持仓市值（非轧差）合并计算不超过计划净资产的1%。</p> <p>.....</p> <p>11、参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过本资产管理计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。”</p>
六、资产管理计划的募集	<p>“1、募集对象</p> <p>.....</p> <p>(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、在中国证券投资基金业协会（以下简称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；</p> <p>(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；</p> <p>(5) 基本养老保险、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）；</p> <p>.....</p> <p>其中所称金融资产包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、</p>	<p>“1、募集对象</p> <p>.....</p> <p>(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、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、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；</p> <p>(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；</p> <p>(5) 基本养老保险、社会保障基金、年金基金等养老基金，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）；</p> <p>.....</p> <p>其中所称金融资产包括银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、</p>

	<p>信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债。”</p>	<p>信托计划、保险产品、期货和衍生品等。家庭金融净资产是指家庭金融总资产减去全体家庭成员的全部负债。”</p>
<p>八、资产管理计划的参与、退出和转让</p>	<p>“(十五) 资产管理人以自有资金参与本计划的情况</p> <p>1、认购、参与条件</p> <p>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，应当提前5个工作日告知资产委托人和资产托管人。资产管理人以自有资金参与本资产管理计划的份额不得超过该计划总份额的20%。资产管理人及其附属机构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%。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。</p> <p>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，证券期货经营机构及其附属机构以自有资金参与及其</p>	<p>“(十五) 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</p> <p>1、认购、参与条件</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	<p>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，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。</p> <p>2、认购、参与、退出方式</p> <p>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。</p>	<p>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。</p> <p>2、认购、参与、退出方式</p> <p>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，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。</p>
	<p>3、自有资金责任承担方式和金额</p> <p>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。”</p>	<p>3、自有资金责任承担方式和金额</p> <p>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。”</p>
<p>十一、 资产管理计划的 投资</p>	<p>“（二）投资范围：</p> <p>权益类：股票型公募基金；</p> <p>固定收益类：银行间市场或证券交易所债券回购、国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、可转换债券、可交换债券、各类债务融资工具（如短期融资券和超短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、PPN等）、资产支持证券、债券型公募基金、货币市场基金、同业存单、大额可转让定期存单、活期存款、现金；</p> <p>商品及金融衍生品类：证券及期货交易所上市的期货和期权品种。</p> <p>其他：除股票型、债券型、货币类以外的公募基金等。</p> <p>.....</p> <p>特别提示：本计划可投资于债券回购。”</p> <p>“（六）投资比例及限制</p> <p>.....</p> <p>9、商品及金融衍生品类持仓市值（非轧差）合并计算不超过计划净资产的1%。</p> <p>.....</p> <p>（八）投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>本计划存续期间，为规避特定风险，经全体投资者同意后，投资于固定收益类资产的比例可以低于计划总资产80%，但不得持续6个月低于计划总资产80%。特定风险主要指趋势性风险，包括但不限于对股市、债市、衍生品市场风险的</p>	<p>“（二）投资范围：</p> <p>权益类：股票型公募基金；</p> <p>固定收益类：银行间市场或证券交易所债券回购、国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、可转换债券、可交换债券、各类债务融资工具（如短期融资券和超短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、PPN等）、资产支持证券、债券型公募基金、货币市场基金、同业存单、大额可转让定期存单、活期存款、现金；</p> <p>期货和衍生品类：证券及期货交易所上市的期货和期权品种。</p> <p>其他：除股票型、债券型、货币类以外的公募基金等。</p> <p>.....</p> <p>特别提示：本计划可投资于债券回购。”</p> <p>“（六）投资比例及限制</p> <p>.....</p> <p>9、期货和衍生品类持仓市值（非轧差）合并计算不超过计划净资产的1%。</p> <p>.....</p> <p>（八）投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>投资人签署本合同即在此同意：本计划存续期间，为规避特定风险，投资于固定收益类资产的比例可以低于计划总资产80%，但不得持续6个月低于计划总资产80%。特定风险主要指趋势性风险，包括但不限于对股市、债市、衍生品市</p>

	<p>判断，调整资产配置比例的情形，以及发生巨额退出、预警止损等特殊风险。</p> <p>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证券期货经营机构之外的因素导致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的十五个工作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，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。”</p>	<p>场风险的判断，调整资产配置比例的情形，以及发生巨额退出、预警止损等特殊风险。</p> <p>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证券期货经营机构之外的因素导致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的二十个工作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，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。”</p>
<p>十四、利益冲突及关联交易</p>	<p>“（一）本计划存在的或可能存在利益冲突的情形及处理方式：</p> <p>1、资产管理人将本计划财产投资于资产管理人、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，应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循资产委托人利益优先原则，事先取得投资者的同意，事后告知投资者和托管人，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护资产委托人合法权益。</p> <p>2、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。</p> <p>3、在符合本计划投资范围及中国证监会监管要求的前提下，资产管理人可运用本计划财产买卖资产管理人、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，但需要遵循资产委托人利益优先的原则、防范利益冲突。</p> <p>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。</p>	<p>“（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：</p> <p>1、本计划存在的或可能存在关联交易的情形：</p> <p>（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；</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（4）其他依据法律法规、监管规定可能存在关联交易的情形。</p> <p>2、本计划存在的或可能存在利益冲突的情形：</p> <p>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：</p> <p>（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；</p> <p>（2）其他依据法律法规、监管规定可能存在利益冲突的情形。</p> <p>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：</p> <p>以上本计划存在的或可能存在关联交易的情</p>

	<p>(二) 资产管理人运用受托管理资产从事关联交易的，应事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露。运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>4、本计划的关联方范围及披露方式： 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。</p> <p>管理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。托管人的关联方名单以公开信息披露信息为准（包括但不限于年报），委托人可通过公开信息进行查询。</p> <p>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。</p> <p>管理人运用委托资产从事重大关联交易的，应通过逐笔征求意见或公告确认等方式取得投资者同意，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。</p> <p>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</p>
--	---	--

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。

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

	<p>(三) 资产委托人签署本合同即表明其已经知晓本计划可进行上述关联交易。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。</p> <p>(四) 本计划存在利益冲突的信息披露</p> <p>1、披露方式</p> <p>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。</p> <p>2、披露内容</p> <p>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。</p> <p>3、披露频率</p> <p>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。”</p>	<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(三) 本计划存在利益冲突的信息披露</p> <p>1、披露方式</p> <p>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。</p> <p>2、披露内容</p> <p>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。</p> <p>3、披露频率</p> <p>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。”</p>
<p>二十一、资产管理计划的费用与税收</p>	<p>“3、管理人的业绩报酬</p> <p>(1) 浮动业绩报酬计提基准</p> <p>本计划的浮动业绩报酬计提基准仅用于计算本计划业绩报酬,并不构成对委托财产可能收益的承诺或暗示。</p> <p>本计划的首个运作周期为产品成立日至2022年12月24日。自2022年12月25日(含)起,每半年为一运作周期,每自然半年度的末月24日(即每年6月24日和12月24日,如遇非工作日顺延)为该运作周期的期末,直至计划终止。首个运作周期的浮动业绩报酬计提基准为4%,固定业绩报酬计提比例为50%。此后,管理人于每运作周期结束前10个工作日公布下一个运作周期的浮动业绩报酬计提基准并通知托管人。托管人对于浮动业绩报酬计提基准不进行复核和监督,也不对此承担任何其他形式的责任。</p> <p>若管理人未按照合同约定及时公布下一运作周期的浮动业绩报酬计提基准,则参考上一运作周期浮动业绩报酬计提基准。</p> <p>(2) 业绩报酬的提取原则</p> <p>1) 采用单个投资者单笔投资年化收益差额</p>	<p>“3、管理人的业绩报酬</p> <p>(1) 浮动业绩报酬计提基准</p> <p>本计划的浮动业绩报酬计提基准仅用于计算本计划业绩报酬,并不构成对委托财产可能收益的承诺或暗示。</p> <p>本计划的首个运作周期为产品成立日至2022年12月24日。自2022年12月25日(含)起,每半年为一运作周期,每自然半年度的末月24日(即每年6月24日和12月24日,如遇非工作日顺延)为该运作周期的期末,直至计划终止。首个运作周期的浮动业绩报酬计提基准为4%,固定业绩报酬计提比例为50%。此后,管理人于每运作周期结束前10个工作日公布下一个运作周期的浮动业绩报酬计提基准并通知托管人。托管人对于浮动业绩报酬计提基准不进行复核和监督,也不对此承担任何其他形式的责任。</p> <p>若管理人未按照合同约定及时公布下一运作周期的浮动业绩报酬计提基准,则参考上一运作周期浮动业绩报酬计提基准。</p> <p>(2) 业绩报酬的提取原则</p> <p>1) 采用单个投资者单笔投资年化收益差额</p>

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。

2) 本计划的业绩报酬计提日为委托人退出日、计划终止日和每个运作周期的期末（即每年6月24日和12月24日，如遇非工作日顺延）。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。

3) 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。在运作周期期末提取业绩报酬的，业绩报酬以扣减存续委托人份额的方式提取，如运作周期期末有委托人赎回份额的，赎回份额对应的业绩报酬从赎回资金中扣除。

4) 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

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/本运作周期期末的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。年化收益率的计算公式如下：

$$r = \frac{P_1 - P_0}{P_0^*} \times \frac{\text{当年天数}}{D} \times 100\%$$

P_1 为本次业绩报酬计提日的份额累计净值或本次业绩报酬计提运作周期期末的份额累计净值；

P_0 为某笔份额上个业绩报酬计提日（首次计提时，则为认购/参与日）的份额累计净值；

P_0^* 为某笔份额上个业绩报酬计提日（首次计提时，则为认购/参与日）的份额单位净值；

D 为某笔份额上个业绩报酬计提日（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的天数或上个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提运作周期期末的天数；

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。

2) 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。

3) 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）。

4) 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

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：

$$r = \frac{P_1 - P_0}{P_0^*} \times \frac{\text{当年天数}}{D} \times 100\%$$

P_1 为本次业绩报酬计提日的份额累计净值；

P_0 为某笔份额上个业绩报酬计提日（首次计提时，则为认购/参与日）的份额累计净值；

P_0^* 为某笔份额上个业绩报酬计提日（首次计提时，则为认购/参与日）的份额单位净值；

D 为某笔份额上个业绩报酬计提日（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的天数；

r 为某笔份额在业绩报酬计提期间的年化收益率。

r 为某笔份额在业绩报酬计提期间的年化收益率。

业绩报酬计提规则如下：

年化收益率 (r)	计提比例	业绩报酬 (R) 的计提公式
$r \leq Y\%$	0	$R = 0$
$r > Y\%$	50%	$R = (r - Y\%) \times 50\% \times P_0^* \times S \times \frac{D}{\text{当年天数}}$

r 为某笔份额在业绩报酬计提期间的年化收益率；

$Y\%$ 为每个运作周期的浮动业绩报酬计提基准；

R 为某笔份额 S 应计提的业绩报酬；

S 为计提业绩报酬对应的某笔份额数；

R 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。

$$\Delta S_{ij} = R / NAV$$

ΔS_{ij} ：固定时点提取业绩报酬时，第 i 个计划份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬对应的应调减份额；

NAV ：本次业绩报酬计提日计划份额单位净值。

如果上述计算投资人单位计划份额获得的收益为负或者为零，则业绩报酬为零。

(4) 业绩报酬的支付

上述业绩报酬在份额赎回、合同约定的运作周期期末及计划终止清算后 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，托管人不承担复核职责。

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”

“(四) 费用调整

资产管理人与资产托管人协商一致，可下调管理费率、托管费率和业绩报酬计提比例(如有)。

对上述费率的调整生效后，资产管理人按照

业绩报酬计提规则如下：

年化收益率 (r)	计提比例	业绩报酬 (R) 的计提公式
$r \leq Y\%$	0	$R = 0$
$r > Y\%$	50%	$R = (r - Y\%) \times 50\% \times P_0^* \times S \times \frac{D}{\text{当年天数}}$

r 为某笔份额在业绩报酬计提期间的年化收益率；

$Y\%$ 为每个运作周期的浮动业绩报酬计提基准；

R 为某笔份额 S 应计提的业绩报酬；

S 为计提业绩报酬对应的某笔份额数；

R 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。

如果上述计算投资人单位计划份额获得的收益为负或者为零，则业绩报酬为零。

(4) 业绩报酬的支付

上述业绩报酬在份额赎回、收益分配及计划终止清算后 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，托管人不承担复核职责。

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”

“(四) 费用调整

资产管理人与资产托管人协商一致，可下调托管费率。资产管理人可自行下调管理费率和业绩报酬计提比例(如有)。

对上述费率的调整生效后，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。”

	<p>本合同的约定向资产委托人披露变更的具体内容。”</p>	
<p>二十三、信息披露与报告</p>	<p>“(一) 运作期报告</p> <p>1、管理人向资产委托人提供的报告种类、内容和提供时间</p> <p>(1) 净值报告</p> <p>管理人每周将经托管人复核的上周最后一个交易日的计划份额净值以各方认可的形式提交资产委托人；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。</p> <p>(2) 季度报告</p> <p>.....</p> <p>集合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。</p> <p>.....</p> <p>2、向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式</p> <p>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。</p> <p>(1) 传真、电子邮件或短信</p> <p>如资产委托人留有传真号、电子邮箱或手机号等联系方式，管理人可通过传真、电子邮件或短信等方式将报告信息告知资产委托人。</p> <p>(2) 邮寄服务</p> <p>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。</p> <p>(3) 管理人网站</p> <p>管理人通过管理人网站向资产委托人提供报告和信息查询，内容包括净值报告等。</p> <p>(二) 管理人应当应向投资者充分披露其董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划。</p> <p>(三) 向监管机构提供的报告</p> <p>管理人、托管人应当根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求履行报告义务。”</p>	<p>“(一) 运作期报告</p> <p>1、管理人向资产委托人提供的报告种类、内容和提供时间</p> <p>(1) 净值报告</p> <p>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基金销售机构查阅或者复制前述信息资料。</p> <p>(2) 季度报告</p> <p>.....</p> <p>集合资产管理计划年度财务会计报告应当经符合《证券法》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。</p> <p>.....</p> <p>2、向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式</p> <p>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。</p> <p>(1) 管理人网站（首选）</p> <p>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，内容包括净值报告、季度报告、年度报告、本计划相关公告等。</p> <p>(2) 传真、电子邮件或短信（次选）</p> <p>如资产委托人留有传真号、电子邮箱或手机号等联系方式，管理人可通过传真、电子邮件或短信等方式将报告信息告知资产委托人。</p> <p>(3) 邮寄服务</p> <p>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。</p> <p>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。请委托人务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。</p>

		<p>(二) 管理人应当向投资者充分披露其董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划。</p> <p>(三) 向监管机构提供的报告</p> <p>管理人、托管人应当根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求履行报告义务。</p> <p>中国证监会对上述信息披露内容另有规定的，从其规定。”</p>
<p>二十四、风险揭示</p>	<p>“(一) 特殊风险揭示</p> <p>……</p> <p>7、参与债券回购风险</p> <p>债券回购为提升整体投资组合收益提供了可能，其主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。</p>	<p>“(一) 特殊风险揭示</p> <p>……</p> <p>7、参与债券回购风险</p> <p>债券回购为提升整体投资组合收益提供了可能，其主要风险包括信用风险、投资风险及波动性加大的风险，其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成基金净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个投资组合风险放大的风险；而波动性加大的风险是指在进行回购操作时，在对投资组合收益进行放大的同时，也对投资组合的波动性（标准差）进行了放大，即投资组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对基金净值造成损失的可能性也就越大。</p>
		<p>8、合同预授权风险</p> <p>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。</p> <p>9、信息披露风险</p> <p>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。</p> <p>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</p>

	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>.....</p> <p>8、 关联交易风险</p> <p>本计划除可能投资于管理人、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外，还可能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，管理人确认其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。”</p>	<p>资者、投资者无法及时获知披露信息的风险。</p> <p>(二) 一般风险揭示</p> <p>.....</p> <p>8、 关联交易风险</p> <p>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。</p> <p>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：</p> <p>(1) 一般关联交易风险</p> <p>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。</p> <p>(2) 重大关联交易风险</p> <p>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。</p> <p>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。”</p>
<p>二 十 五、资 产 管 理 合 同 的</p>	<p>“（三）资产管理合同发生变更的，管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。”</p>	<p>“（三）资产管理合同发生变更的，管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案。”</p>

<p>变更、终止与财产清算</p>	<p>“（五）资产管理合同终止的情形包括下列事项： 除上述第 6 项情形，管理人应当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，并抄报中国证监会相关派出机构。 （六）资产管理计划的清算 资产管理计划在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划资产 1、清算小组 2、清算程序 1) 资产管理合同终止后，由清算小组统一接管资产管理计划财产；</p>	<p>“（五）资产管理合同终止的情形包括下列事项： 除上述第 6 项情形，管理人应当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。 （六）资产管理计划的清算 资产管理计划在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划资产 1、清算小组 2、清算程序 1) 资产管理合同终止后，由清算小组统一接管资产管理计划财产；</p>
	<p>2) 对资产管理计划财产和债权债务进行清理和确认； 3) 对资产管理计划财产进行估值和变现； 4) 制作清算报告； 5) 对资产管理计划财产进行分配； 6) 将清算报告报证券投资基金业协会、中期协或中国证监会备案并披露给资产委托人。 3、清算费用 5、未能变现的资产处理 若本计划在终止之日有未能流通变现的资产导致计划延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。管理人可对此制定延期清算方案，该方案应经托管人认可，并披露给计划份额持有人。管理人应根据延期清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券等，资产管理人与资产托管人继续按规定计提管理费、托管费、业绩报酬等费用，其估值方法继续按本合同第二十章的规定计算。管理人应在上述证券流通变现时及时变现，并在流通变现后进行再次清算，并将变现后的资产按照计划份额持有人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给计划份额持有人。”</p>	<p>2) 对资产管理计划财产和债权债务进行清理和确认； 3) 对资产管理计划财产进行估值和变现； 4) 制作清算报告； 5) 对资产管理计划财产进行分配； 6) 资产管理人应在清算结束后 5 个工作日内将清算报告报证券投资基金业协会备案并披露给资产委托人。 3、清算费用 5、未能变现的资产处理 若本计划在终止之日有未能流通变现的资产导致计划延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。管理人可对此制定延期清算方案，该方案应经托管人认可，并披露给计划份额持有人。管理人应根据延期清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券等，资产管理人与资产托管人继续按规定计提管理费、托管费、业绩报酬等费用，其估值方法继续按本合同第二十章的规定计算。管理人应在上述证券流通变现时及时变现，并在流通变现后进行再次清算，并将变现后的资产按照计划份额持有人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给计划份额持有人。”</p>
<p>附件一：</p>	<p>“权益类：股票型公募基金； 固定收益类：银行间市场或证券交易所债券回购、国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、可转换债券、可交换债券、各类债务融资工具（如短期融资券和超短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、PPN 等）、资产支持证券、债券型公募基金、货币市场</p>	<p>“权益类：股票型公募基金； 固定收益类：银行间市场或证券交易所债券回购、国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、可转换债券、可交换债券、各类债务融资工具（如短期融资券和超短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、PPN 等）、资产支持证券、债券型公募基金、货币市场</p>

<p>基金、同业存单、大额可转让定期存单、活期存款、现金；</p> <p>商品及金融衍生品类：证券及期货交易所上市的期货和期权品种。</p> <p>其他：除股票型、债券型、货币类以外的公募基金等。”</p> <p>“1、投资于固定收益类资产按市值计不低于计划总资产的 80%。</p> <p>2、本计划存续期内，计划总资产与净资产的比例不得超过 120%。</p> <p>3、投资于同一资产的资金按成本计算不得超过本计划资产净值的 25%（期货按单合约保证金占用计算）；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>4、商品及金融衍生品类持仓市值（非轧差）合并计算不超过计划净资产的 1%。</p> <p>5、信用债券或资产支持证券的债项或主体评级需在 AA 级（含）以上（中债资信评级除外），信用债及资产支持证券持仓市值合并计算不超过计划净资产的 25%。</p> <p>6、参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过本资产管理计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。”</p>	<p>基金、同业存单、大额可转让定期存单、活期存款、现金；</p> <p>期货和衍生品类：证券及期货交易所上市的期货和期权品种。</p> <p>其他：除股票型、债券型、货币类以外的公募基金等。”</p> <p>“1、投资于固定收益类资产按市值计不低于计划总资产的 80%。</p> <p>2、本计划存续期内，计划总资产与净资产的比例不得超过 120%。</p> <p>3、投资于同一资产的资金按成本计算不得超过本计划资产净值的 25%（期货按单合约保证金占用计算）；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>4、期货和衍生品类持仓市值（非轧差）合并计算不超过计划净资产的 1%。</p> <p>5、信用债券或资产支持证券的债项或主体评级需在 AA 级（含）以上（中债资信评级除外），信用债及资产支持证券持仓市值合并计算不超过计划净资产的 25%。</p> <p>6、参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过本资产管理计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。由于托管人无法获取申报数据，该事项由管理人负责监控。”</p>
---	--

