

关于广发期货期胜全天候二期集合资产管理计划资产管理合同 的变更公告

尊敬的广发期货期胜全天候二期集合资产管理计划投资者：

根据贵我双方与资产托管人共同签署的《广发期货期胜全天候二期集合资产管理计划资产管理合同》（下称资产管理合同），我司与托管人协商一致，对资产管理合同做如下变更，特向全体委托人公告。

一、《广发期货期胜全天候二期集合资产管理计划资产管理合同》变更内容对照表

涉及条款位置	变更前	变更后
“风险揭示书” 第二条第（一） 款第 9 项第 1 点	<p>1、关联交易风险</p> <p>投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人将委托财产投资于管理人、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承销期内承销的证券，或从事其他关联交易，同意豁免管理人进行该等交易时另行征求投资者同意的义务。托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方以托管人提供的清单为准，因托管人未及时提供或更新清单导致管理人未按合同约定进行关联交易控制或披露的，管理人不承担责任，由此给投资者造成的损失，由托管人承担。本合同所称重大关联交易指单笔投资金额超过人民币 3000 万元的关联交易，法律法规或中国证监会另有规定的，依照其规定执行。管理人变更前述重大关联交易标准的，应当及时告知投资者。</p> <p>本计划不得与广发证券股份有限公司自营账户、广发证券股份有限公司作为投资顾问的产品账户、管理人管理的其他资产管理账户、投资顾问账户之间进行交易，有充分证据证明进行有效隔离并且价格公允的除外。</p>	<p>1、关联交易风险</p> <p>投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人运用受托管理资产从事一般关联交易，同意豁免管理人进行该等交易时另行征求投资者同意的义务。对于重大关联交易，管理人将提前进行公告，并给予投资者退出的权利，投资者未按规定时间退出的，视为同意该重大关联交易。托管人的关联方以公开信息披露为准（披露网址：www.cmbchina.com），因托管人未更新导致管理人未按合同约定进行关联交易控制或披露的，管理人不承担责任。</p> <p>本计划不得与广发证券股份有限公司自营账户、广发证券股份有限公司作为投资顾问的产品账户、管理人管理的其他资产管理账户、投资顾问账户之间进行交易，有充分证据证明进行有效隔离并且价格公允的除外。</p>
“风险揭示书” 第二条第	（一）商品及金融衍生品类产品的风险	（一）期货和衍生品类产品的风险

<p>(二) 款第 1 项</p>	<p>本计划属于商品及金融衍生品类，其中投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产 80%，且衍生品账户权益超过资产管理计划总资产 20%。产品的实际投向不得违反合同约定，但非因管理人主观因素或建仓期导致突破前述比例限制的，管理人应当在建仓期结束后、流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整至符合要求。法律、行政法规、金融管理部门另有规定的，从其规定。本计划可能面临因监管规范变化引起持仓策略和产品类别调整的风险。投资者购买本计划，可能面临本计划投向的所有投资品种的特定风险，包括但不限于：股票、债券面临的利率与汇率变化等市场风险；股票、债券价格波动的风险；衍生品挂钩资产价格波动引起衍生品价格波动的风险；标的资产持仓情况及其变化可能造成本计划净值波动的风险；本计划通过持仓比例、投资限制、预警止损等措施进行风险控制，但不排除非因管理人主观因素导致的被动超限情形，以及遇市场极端行情造成无法平仓调整的情形；衍生品公允价值变化也可能造成本计划净值波动的风险。</p>	<p>本计划属于期货和衍生品类，其中投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产 80%，且期货和衍生品账户权益超过资产管理计划总资产 20%。产品的实际投向不得违反合同约定，但非因管理人主观因素或建仓期导致突破前述比例限制的，管理人应当在建仓期结束后、流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合要求。法律、行政法规、金融管理部门另有规定的，从其规定。本计划可能面临因监管规范变化引起持仓策略和产品类别调整的风险。投资者购买本计划，可能面临本计划投向的所有投资品种的特定风险，包括但不限于：股票、债券面临的利率与汇率变化等市场风险；股票、债券价格波动的风险；衍生品挂钩资产价格波动引起衍生品价格波动的风险；标的资产持仓情况及其变化可能造成本计划净值波动的风险；本计划通过持仓比例、投资限制、预警止损等措施进行风险控制，但不排除非因管理人主观因素导致的被动超限情形，以及遇市场极端行情造成无法平仓调整的情形；衍生品公允价值变化也可能造成本计划净值波动的风险。</p>
<p>“风险揭示书” 第二条第 (二) 款第 3 项增加 第 3 点</p>	<p>无</p>	<p>3、股票投资风险</p> <p>股票投资风险主要包括：</p> <p>1) 国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险；</p> <p>2) 宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险；</p>

		<p>3) 上市公司的经营状况受多种因素影响,如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化,从而导致股票价格变动的风险;</p> <p>4) 本资产管理计划可投资于科创板及创业板股票,科创板及创业板股票发行采用注册制,在上市门槛、公司盈利能力、发行价格、减持制度、交易机制、涨跌幅限制以及退市制度等方面与其他 A 股板块的股票不同,可能导致本资产管理计划净值波动更大。</p>
<p>“风险揭示书” 第二条第(二) 款第 3 项增加 第 9 点-第 12 点</p>	无	<p>9、新股申购风险</p> <p>新股申购风险是指获配新股上市后其二级市场交易价格下跌至申购价以下的风险。由于网下获配新股有一定的锁定期,锁定期股票价格受各种市场因素、宏观政策因素等的影响,股票价格有可能下跌到申购价以下。</p> <p>10、证券回购交易风险</p> <p>计划在进行回购操作时,可能由于回购利率大于证券投资收益以及由于回购操作导致投资总量放大,致使整个组合风险放大。此外,在进行回购操作对组合收益进行放大的同时,也对组合的波动性进行了放大,致使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,对组合造成损失的可能性也就越大。</p> <p>11、北交所股票投资风险</p> <p>(1) 项目企业经营风险</p> <p>北交所股票中大多数企业为初创型公司,相比主板和创业板公司,北交所上市公司典型特征为资产规模小、业绩波动大,在经营管理上会存在一定的波动性和不确定性。北交所上市公司其主营业务收入、营业利润、每股净收益等财务指标低于上市公司,抗市场和行业风险的能力较弱。</p>

		<p>(2) 流动性风险</p> <p>北交所的投资者准入门槛较高，各类交易模式的活跃程度和市场流动性可能相对偏弱，故北交所投资可能存在一定的流动性风险。</p> <p>(3) 交易规则风险</p> <p>北交所股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制（具体交易规则以北交所相关交易规则为准），可能产生较大的股价波动的风险；同时还可能引入做市机制，实行混合交易，交易规则与主板市场存在差异的风险。</p> <p>(4) 退市风险</p> <p>北交所公司存在主动或被强制摘牌的退市风险，本质上是基于流动性差衍生出的另一种风险。退市后公司股票将丧失或缺乏流动性、股价将有大幅波动的可能，可能对本计划的投资收益造成不利影响，并可能影响本计划到期清算。</p> <p>12、创业板投资风险</p> <p>本计划可根据投资策略需要投资于创业板上市公司股票，因创业板股票上市、交易、退市等规则与主板股票不同，会存在创业板股票股价波动较大、退市的风险。</p>
风险揭示书”第二条第（二）款第 9 项 第 2 点	<p>本计划存续期间，为规避特定风险（主要指市场趋势性下跌、巨额退出、预警止损等风险），投资者同意：投资于商品及金融衍生品类资产持仓合约价值的比例可低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。法律、行政法规、金融管理部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>本计划存续期间，为规避特定风险（主要指市场趋势性下跌、巨额退出、预警止损等风险），投资者同意：投资于期货和衍生品类资产持仓合约价值的比例可低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%。法律、行政法规、金融管理部门另有规定的，从其规定。</p>
风险揭示书”第二条第（二）款第 10 项	<p>(十) 特殊业绩报酬计提方式的风险</p> <p>在每个投资年度最后一个工作日，若投资者无退出情形或仅部分退出，对该投资者未退出部分，将以相应扣减投资者份额的形</p>	无

	<p>式计提业绩报酬。在此种业绩报酬计提方式下，本计划份额净值不因业绩报酬的计提而降低，投资者持有份额将因此降低。由于投资者权益是通过持有份额和份额净值进行计算，该种情况下的业绩报酬通过扣减份额方式实现，故投资者应关注由此引起的份额变动而导致的投资者权益变动。投资者已清楚知悉此安排可能对持有份额和净值造成的影响。</p>	
第一章 第二条 第二款	<p>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，并抄报中国证监会相关派出机构。</p>	<p>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。</p>
第二章 第十一条第（三）款	<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>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>
第二章 第十一条第（五）款	<p>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）；</p>	<p>5、基本养老金、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>
第四章 第二条第（三）款第19项	<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>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>
第四章 第二条第（三）款第21项	<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>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；</p>

第四章第二条第（三）款第27项	27、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。	27、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； 28、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。
第四章第三条第（三）款第9项	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；	9、编制托管年度报告，并报送中国证监会相关派出机构；
第四章第三条第（三）款第14项	14、根据法律法规规定和合同约定的监督内容和监督方式，监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会；	14、根据法律法规规定和合同约定的监督内容和监督方式，监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构；
第四章第三条第（三）款第15项	15、投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；	15、投资于《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；
第五章第二条	二、资产管理计划的类别 商品及金融衍生品类集合资产管理计划。	二、资产管理计划的类别 期货和衍生品类集合资产管理计划。
第八章第一条第（三）款	（三）临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排 在资产管理合同变更、资产管理计划展期等情况下，为保障投资者选择退出资产管理计划的权利，管理人有权设置临时开放期（封闭期内也可增设临时开放期）开放份额退出。具体以管理人公告为准。管理人提前3个工作日在网站上发布公告即视为履行了告知义务。临时开放期不受本条第（二）款的限制。	（三）临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排 在资产管理合同变更、资产管理计划展期、证券期货经营机构自有资金参与或退出本计划、管理人运用受托管理资产从事重大关联交易等情况下，为保障投资者选择退出资产管理计划的权利，管理人有权设置临时开放期（锁定期内也可增设临时开放期）开放份额退出。具体以管理人公告为准。管理人提前3个工作日在网站上发布公告即视为履行了告知义务，资产管理合同另有约定除外。临时开放

		期不受本条第（二）款的限制。
第八章第五条	<p>五、管理人自有资金参与及退出</p> <p>若管理人以自有资金持有本计划份额，与投资者所持的份额享有同等权益、承担同等风险。管理人以自有资金参与本计划的，参与份额不得超过本计划总份额的 20%，持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知投资者和托管人。管理人在其网站发布公告即视为履行了告知义务。管理人及其附属机构以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。因计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，管理人有权退出以调整至达标。</p> <p>为应对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，管理人及附属机构以自有资金参与及后续退出计划可不受本条第一款规定的限制，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及证券投资基金业协会报告。</p>	<p>五、证券期货经营机构自有资金参与及退出</p> <p>若证券期货经营机构以自有资金持有本计划份额，与投资者所持的份额享有同等权益、承担同等风险。证券期货经营机构以自有资金参与本计划的，持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人，并给予投资者退出的权利，投资者未在规定时间内退出的，视为同意证券期货经营机构自有资金参与、退出本计划。管理人在其网站发布公告即视为履行了告知义务。证券期货经营机构及其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计划总份额的 50%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，证券期货经营机构有权退出以调整至达标，在此情况下，投资者和托管人同意豁免管理人提前告知并取得同意的义务，但管理人事后应及时告知投资者和托管人。</p> <p>为应对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子公司以自有资金参与及后续退出计划可不受本条第一款规定的限制，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>本条所称证券期货经营机构的范围根据中国证监会、证券投资基金业协会要求确定。</p>
第十一章第二条	<p>二、投资范围及比例</p> <p>本计划投资范围及各类资产的配置比例</p>	<p>二、投资范围及比例</p> <p>本计划投资范围及各类资产的配置比例</p>

	<p>为：</p> <p>（1）商品及金融衍生品类：金融期货、商品期货及场内期权；</p> <p>（2）固定收益类：现金、银行存款、国债回购、货币市场基金、央行票据、短期融资券、在交易所或银行间发行的资产支持证券、可转债、债券、债券型基金；</p> <p>（3）权益类：股票（含新股申购、科创板股票等）、股票型基金、融资融券、转融通；</p> <p>本计划属于商品及金融衍生品类产品，具体投资比例如下：</p> <p>（1）投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不低于计划总资产的 80%，且衍生品账户权益超过计划总资产的 20%；</p> <p>（2）投资于固定收益类资产（按市值计算）的比例低于计划总资产的 80%；</p> <p>（3）投资于权益类资产（按市值计算）的比例低于计划总资产的 80%。</p> <p>本计划可能参与证券回购、融资融券、转融通业务。具体风险详见风险揭示书。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序，并为运营服务机构和托管人相关系统准备留出必要的调整时间后，可以将其纳入本计划的 投资范围。</p> <p>特殊说明，本计划在实际投资场内期权等标的时，需确认管理人、托管人双方交易、估值核算、投资监督等系统确认完善后方可进行相关投资。</p>	<p>为：</p> <p>（1）期货和衍生品类：金融期货、商品期货及场内期权；</p> <p>（2）固定收益类：现金、银行存款、国债回购、货币市场基金、央行票据、短期融资券、在交易所或银行间发行的资产支持证券、可转债、债券、债券型基金；</p> <p>（3）权益类：股票（含新股申购、科创板股票等）、股票型基金、融资融券、转融通；</p> <p>本计划属于期货和衍生品类产品，具体投资比例如下：</p> <p>（1）投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例不低于计划总资产的 80%，且期货和衍生品账户权益超过计划总资产的 20%；</p> <p>（2）投资于固定收益类资产（按市值计算）的比例低于计划总资产的 80%；</p> <p>（3）投资于权益类资产（按市值计算）的比例低于计划总资产的 80%。</p> <p>本计划可能参与证券回购、融资融券、转融通业务。具体风险详见风险揭示书。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序，并为运营服务机构和托管人相关系统准备留出必要的调整时间后，可以将其纳入本计划的 投资范围。</p> <p>特殊说明，本计划在实际投资场内期权等标的时，需确认管理人、托管人双方交易、估值核算、投资监督等系统确认完善后方可进行相关投资。</p>
第十一章第三款第一款	<p>三、投资比例超限的处理方式及流程</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管理人之外的因素</p>	<p>三、投资比例超限的处理方式及流程</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管理人之外的因素</p>

	导致本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，管理人不承担责任，但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交易日内调整至符合相关要求。	导致本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，管理人不承担责任，但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交易日内调整至符合相关要求。
第十一章第七 条第（九）款	9、本计划总资产不得超过净资产的200%。	9、本计划总资产不得超过净资产的200%。 本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，本计划的总资产不得超过其净资产的120%。本计划投资于国债、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。
第十一章第七 条第（十一）款	11、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导致本计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资限制或者合同约定的投资限制的，管理人不承担责任，但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交易日内调整至符合相关要求。	11、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导致本计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资限制或者合同约定的投资限制的，管理人不承担责任，但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交易日内调整至符合相关要求。
第十一章第九 条	九、特定风险下的比例超限 本计划存续期间，为规避特定风险（主要指市场趋势性下跌、巨额退出等风险），投资者同意：投资于商品及金融衍生品类资产持仓合约价值的比例可低于计划总资产的80%，但不得持续6个月低于计划总资产80%。法律、行政法规、金融管理部门另有规定的，从其规定。出现前述特定风险下的比例超限情况的，管理人应当及时向投资者公告披露。	九、特定风险下的比例超限 本计划存续期间，为规避特定风险（主要指市场趋势性下跌、巨额退出、预警止损等风险），投资者同意：投资于期货和衍生品类资产持仓合约价值的比例可低于计划总资产的80%，但不得持续6个月低于计划总资产80%。法律、行政法规、金融管理部门另有规定的，从其规定。出现前述特定风险下的比例超限情况的，管理人应当及时向投资者公告披露。
第十一章第十 一条	十一、资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本计划资产	十一、资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本计划资产

	<p>净值的 20%。“流动性受限资产”的定义依照《运作规定》第四十三条第（三）款执行。</p> <p>本计划资产组合的流动性应当与参与、退出安排相匹配，在开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%。“7 个工作日可变现资产”的定义依照《运作规定》第四十三条第（四）款执行。</p>	<p>净值的 20%。“流动性受限资产”的定义依照《运作规定》第四十七条第（三）款执行。</p> <p>本计划资产组合的流动性应当与参与、退出安排相匹配，在开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%。“7 个工作日可变现资产”的定义依照《运作规定》第四十七条第（四）款执行。</p>
第十三章 第二条第一款	<p>二、关联交易</p> <p>管理人运用受托管理资产从事关联交易的，事后应当及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露，本计划将通过临时报告或定期报告的方式向投资者披露关联交易。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。投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人将委托财产投资于管理人、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承销期内承销的证券，或从事其他关联交易，同意豁免管理人进行该等交易时另行征求投资者同意的义务。托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方以托管人提供的清单为准，因托管人未及时提供或更新清单导致管理人未按合同约定进行关联交易控制或披露的，管理人不承担责任，由此给投资者造成的损失，由托管人承担。本合同所称重大关联交易指单笔投资金额超过人民币 3000 万元的关联交易，法律法规或中国证监会另有规定的，依照其规定执行。管理人变更前述重大关联交易标准的，应当及时告知投资者。</p>	<p>二、关联交易</p> <p>管理人运用受托管理资产从事关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，事后应当及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露，本计划将通过临时报告或定期报告的方式向投资者披露关联交易。投资占比超过本计划净值 20%的关联交易为重大关联交易，重大关联交易之外的为一般关联交易。管理人应当建立关联交易内部审批机制，并按照规定的程序履行关联交易审批义务。投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人运用受托管理资产从事一般关联交易，同意豁免管理人进行该等交易时另行征求投资者同意的义务。对于重大关联交易，管理人将提前进行公告，并给予投资者退出的权利，投资者未按规定时间退出的，视为同意该重大关联交易。中国证监会、中国证券基金业协会对关联交易区分标准等另有规定的，从其规定。管理人的关联方范围按照《企业会计准则》的规定确定。托管人的关联方以公开信息披露为准（披露网址：www.cmbchina.com），因托管人未更新导致管理人未按合同约定进行关联交易控制或披露的，管理人不承担责任。</p>
第十九章 第二条第（一）款第	2、业绩报酬	2、业绩报酬

<p>2 项第 1 点、第 2 点</p>	<p>(1) 业绩报酬计提情形：</p> <p>1) 投资者全部或部分退出时，计提基准日为份额退出申请日；</p> <p>2) 固定时点计提，计提基准日为每个投资年度最后一个工作日，无论当日是否有申赎申请发生；</p> <p>3) 收益分配时（如有），计提基准日为分红基准日；</p> <p>4) 产品清算日，计提基准日为清算基准日（如产品发生多次清算，第一次清算时计提，后续清算不再计提业绩报酬）。</p> <p>在固定时点计提业绩报酬时，业绩报酬以扣减持有人份额的方式实现计算，扣减的份额=投资者业绩报酬金额/本计提基准日计划份额净值；在投资者退出时、收益分配时和产品清算时计提业绩报酬的，业绩报酬从退出款、分红款和清算款中扣除。收益分配时，若分红款不足以支付业绩报酬的，以分红款为限计提业绩报酬。</p> <p>(2) 业绩报酬计算方法：</p> <p>绝对收益率 $R = \frac{A - C}{B} \times 100\%$</p> <p>其中，</p> <p>A=计提日（开放日、收益分配基准日、每投资年度最后一个工作日、计划终止日）份额累计净值；</p> <p>C=上次计提日份额累计净值；</p> <p>B=上次计提日份额净值；</p> <p>D=本计提日计划份额净值。</p> <p>当$R \leq 0$时，不计提业绩报酬；</p> <p>当$R > 0$时，按照以下公式计提业绩报酬：</p> <p>业绩报酬= $\sum K \times R \times 20\%$</p> <p>其中，</p>	<p>(1) 业绩报酬计提情形：</p> <p>1) 投资者全部或部分退出时，计提基准日为份额退出申请日；</p> <p>2) 收益分配时（如有），计提基准日为分红基准日；</p> <p>3) 产品清算日，计提基准日为清算基准日（如产品发生多次清算，第一次清算时计提，后续清算不再计提业绩报酬）。</p> <p>在投资者退出时、收益分配时和产品清算时计提业绩报酬的，业绩报酬从退出款、分红款和清算款中扣除。收益分配时，若分红款不足以支付业绩报酬的，以分红款为限计提业绩报酬。</p> <p>(3) 业绩报酬计算方法：</p> <p>绝对收益率 $R = \frac{A - C}{B} \times 100\%$</p> <p>其中，</p> <p>A=计提日（开放日、收益分配基准日、计划终止日）份额累计净值；</p> <p>C=上次计提日份额累计净值；</p> <p>B=上次计提日份额净值；</p> <p>D=本计提日计划份额净值。</p> <p>当$R \leq 0$时，不计提业绩报酬；</p> <p>当$R > 0$时，按照以下公式计提业绩报酬：</p> <p>业绩报酬= $\sum K \times R \times 20\%$</p> <p>其中，</p> <p>K=委托人持有份额×上次计提日份额净值，在委托人退出情形下，K=委托人退出份额×上次计提日份额净值（在计算业绩报酬时针对每个投资者的每笔份额单独计算业绩报酬并进行求和）。</p> <p>T 为上次计提日（不含）至本次计提日（含）之间的天数。</p>
-----------------------	---	--

	<p>$K = \text{委托人持有份额} \times \text{上次计提日份额净值}$，在委托人退出情形下，$K = \text{委托人退出份额} \times \text{上次计提日份额净值}$（在计算业绩报酬时针对每个投资者的每笔份额单独计算业绩报酬并进行求和）。</p> <p>T 为上次计提日（不含）至本次计提日（含）之间的天数。</p> <p>若委托人该笔份额为首次提取业绩报酬，则上述“上次提取日”为委托人该笔份额参与日。</p> <p>在每个投资年度最后一个工作日，若委托人无退出情形，将以相应扣减委托人份额的形式计提业绩报酬，每个投资者扣减的份额为：$\Delta S = \frac{\text{每个投资者计提的业绩报酬}}{D}$。</p> <p>在委托人退出本计划时、收益分配时、计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从投资者的赎回款、分红款、清盘款中以扣减分配金额的方式予以扣除。收益分配时，若分红款不足以支付业绩报酬的，以分红款为限计提业绩报酬。</p> <p>业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的 60%。因投资者退出资产管理计划，管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。</p>	<p>若委托人该笔份额为首次提取业绩报酬，则上述“上次提取日”为委托人该笔份额参与日。</p> <p>在委托人退出本计划时、收益分配时、计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从投资者的赎回款、分红款、清盘款中以扣减分配金额的方式予以扣除。收益分配时，若分红款不足以支付业绩报酬的，以分红款为限计提业绩报酬。</p> <p>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业绩报酬计提基准以上投资收益的 60%。</p>
第二十一章第一条第（二）款第 2 项	本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。	本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。
第二十一章第三条	<p>三、向监管机构提供的报告</p> <p>管理人、托管人应当按照《管理办法》、《运作规定》等要求的种类、内容、时间、途径向监管机构报送信息。管理人应向证券</p>	<p>三、向监管机构提供的报告</p> <p>管理人、托管人应当按照《管理办法》、《运作规定》等要求的种类、内容、时间、途径向监管机构报送信息。</p>

	<p>投资基金业协会、中国证监会相关派出机构报送资产管理合同、计划说明书、风险揭示书、资产管理计划净值、参与、退出价格、定期报告、重大事项的临时报告、清算报告以及按照监管规定需要报送的其他信息。</p>	
<p>第二十二章第一条第(九)款第1项</p>	<p>1、关联交易风险</p> <p>投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人将委托财产投资于管理人、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承销期内承销的证券，或从事其他关联交易，同意豁免管理人进行该等交易时另行征求投资者同意的义务。托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方以托管人提供的清单为准，因托管人未及时提供或更新清单导致管理人未按合同约定进行关联交易控制或披露的，管理人不承担责任，由此给投资者造成的损失，由托管人承担。本合同所称重大关联交易指单笔投资金额超过人民币 3000 万元的关联交易，法律法规或中国证监会另有规定的，依照其规定执行。管理人变更前述重大关联交易标准的，应当及时告知投资者。</p>	<p>1、关联交易风险</p> <p>投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人运用受托管理资产从事一般关联交易，同意豁免管理人进行该等交易时另行征求投资者同意的义务。对于重大关联交易，管理人将提前进行公告，并给予投资者退出的权利，投资者未按规定时间退出的，视为同意该重大关联交易。托管人的关联方以公开信息披露为准（披露网址：www.cmbchina.com），因托管人未更新导致管理人未按合同约定进行关联交易控制或披露的，管理人不承担责任。</p>
<p>第二十二章第二条第(一)款</p>	<p>（一）商品及金融衍生品类产品的风险</p> <p>本计划属于商品及金融衍生品类，其中投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产 80%，且衍生品账户权益超过资产管理计划总资产 20%。产品的实际投向不得违反合同约定，但非因管理人主观因素或建仓期导致突破前述比例限制的，管理人应当在建仓期结束后、流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整至符合要求。法律、行政法规、金融管理部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>（一）期货和衍生品类产品的风险</p> <p>本计划属于期货和衍生品类，其中投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产 80%，且期货和衍生品账户权益超过资产管理计划总资产 20%。产品的实际投向不得违反合同约定，但非因管理人主观因素或建仓期导致突破前述比例限制的，管理人应当在建仓期结束后、流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合要求。法律、行政法规、金融管理部门另有规定的，从其规定。本计划可能面临</p>

	<p>本计划可能面临因监管规范变化引起持仓策略和产品类别调整的风险。投资者购买本计划，可能面临本计划投向的所有投资品种的特定风险，包括但不限于：股票、债券面临的利率与汇率变化等市场风险；股票、债券价格波动的风险；衍生品挂钩资产价格波动引起衍生品价格波动的风险；标的资产持仓情况及其变化可能造成本计划净值波动的风险；本计划通过持仓比例、投资限制、预警止损等措施进行风险控制，但不排除非因管理人主观因素导致的被动超限情形，以及遇市场极端行情造成无法平仓调整的情形；衍生品公允价值变化也可能造成本计划净值波动的风险。</p>	<p>因监管规范变化引起持仓策略和产品类别调整的风险。投资者购买本计划，可能面临本计划投向的所有投资品种的特定风险，包括但不限于：股票、债券面临的利率与汇率变化等市场风险；股票、债券价格波动的风险；衍生品挂钩资产价格波动引起衍生品价格波动的风险；标的资产持仓情况及其变化可能造成本计划净值波动的风险；本计划通过持仓比例、投资限制、预警止损等措施进行风险控制，但不排除非因管理人主观因素导致的被动超限情形，以及遇市场极端行情造成无法平仓调整的情形；衍生品公允价值变化也可能造成本计划净值波动的风险。</p>
<p>第二十二章 第二条第（三）款 增加第 3 项</p>	<p>无</p>	<p>3、股票投资风险</p> <p>股票投资风险主要包括：</p> <p>1）国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险；</p> <p>2）宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险；</p> <p>3）上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险；</p> <p>4）本资产管理计划可投资于科创板及创业板股票，科创板及创业板股票发行采用注册制，在上市门槛、公司盈利能力、发行价格、减持制度、交易机制、涨跌幅限制以及退市制度等方面与其他 A 股板块的股票不同，可能导致本资产管理计划净值波动更大。</p>
<p>第二十二章 第二条第（三）款 增加第 9-12 项</p>	<p>无</p>	<p>9、新股申购风险</p> <p>新股申购风险是指获配新股上市后其二</p>

	<p>二级市场交易价格下跌至申购价以下的风险。由于网下获配新股有一定的锁定期，锁定期间股票价格受各种市场因素、宏观政策因素等的影响，股票价格有可能下跌到申购价以下。</p> <p>10、证券回购交易风险</p> <p>计划在进行回购操作时，可能由于回购利率大于证券投资收益以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使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，对组合造成损失的可能性也就越大。</p> <p>11、北交所股票投资风险</p> <p>（1）项目企业经营风险</p> <p>北交所股票中大多数企业为初创型公司，相比主板和创业板公司，北交所上市公司典型特征为资产规模小、业绩波动大，在经营管理上会存在一定的波动性和不确定性。北交所上市公司其主营业务收入、营业利润、每股净收益等财务指标低于上市公司，抗市场和行业风险的能力较弱。</p> <p>（2）流动性风险</p> <p>北交所的投资者准入门槛较高，各类交易模式的活跃程度和市场流动性可能相对偏弱，故北交所投资可能存在一定的流动性风险。</p> <p>（3）交易规则风险</p> <p>北交所股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制（具体交易规则以北交所相关交易规则为准），可能产生较大的股价波动的风险；同时还可能引入做市机制，实行混合交易，交易规则与主板市场存在差异的风险。</p> <p>（4）退市风险</p> <p>北交所公司存在主动或被强制摘牌的退</p>
--	--

		<p>市风险，本质上是基于流动性差衍生出的另一种风险。退市后公司股票将丧失或缺乏流动性、股价将有大幅波动的可能，可能对本计划的投资收益造成不利影响，并可能影响本计划到期清算。</p> <p>12、创业板投资风险</p> <p>本计划可根据投资策略需要投资于创业板上市公司股票，因创业板股票上市、交易、退市等规则与主板股票不同，会存在创业板股票股价波动较大、退市的风险。</p>
第二十二章第二条第（九）款第2项	<p>本计划存续期间，为规避特定风险（主要指市场趋势性下跌、巨额退出、预警止损等风险），投资者同意：投资于商品及金融衍生品类资产持仓合约价值的比例可低于计划总资产的80%，但不得持续6个月低于计划总资产80%。法律、行政法规、金融管理部门另有规定的，从其规定。</p>	<p>本计划存续期间，为规避特定风险（主要指市场趋势性下跌、巨额退出、预警止损等风险），投资者同意：投资于期货和衍生品类资产持仓合约价值的比例可低于计划总资产的80%，但不得持续6个月低于计划总资产80%。法律、行政法规、金融管理部门另有规定的，从其规定。</p>
第二十二章第二条第（十）款	<p>（十）特殊业绩报酬计提方式的风险</p> <p>在每个投资年度最后一个工作日，若投资者无退出情形或仅部分退出，对该投资者未退出部分，将以相应扣减投资者份额的形式计提业绩报酬。在此种业绩报酬计提方式下，本计划份额净值不因业绩报酬的计提而降低，投资者持有份额将因此降低。由于投资者权益是通过持有份额和份额净值进行计算，该种情况下的业绩报酬通过扣减份额方式实现，故投资者应关注由此引起的份额变动而导致的投资者权益变动。投资者已清楚知悉此安排可能对持有份额和净值造成的影响。</p>	无
第二十三章第一条第（二）款	<p>（二）合同变更的备案</p> <p>资产管理合同发生变更的，管理人应依照证券投资基金业协会要求及时向证券投资</p>	<p>（二）合同变更的备案</p> <p>资产管理合同发生变更的，管理人应依照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基</p>

	基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。	金业协会备案。
第二十三章第三条第（十一）款	（十一）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，前述第（七）项约定的情形除外。	（十一）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。
第二十三章第四条第（二）款第4项	4、本计划终止时，如因委托财产流动性受限等原因尚未全部变现的，可进行二次（或后续多次）清算，未能变现的计划财产在变现后再进行清算。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，并向投资者披露相关清算报告。在计划终止后的清算期间，不再计提固定管理费、托管费、运营服务费。	4、本计划终止时，如因委托财产流动性受限等原因尚未全部变现的，可进行二次（或后续多次）清算，未能变现的计划财产在变现后再进行清算。管理人应当及时向证券投资基金业协会报告，并向投资者披露相关清算报告。资产管理计划因受托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。在计划终止后的清算期间，不再计提固定管理费、托管费、运营服务费。

二、变更流程

本次合同变更因中国证监会相关规定发生变化而变更，对投资者利益无实质性不利影响，根据资产管理合同的约定，管理人与托管人协商一致对资产管理合同作出如上变更，现特向全体投资者公告披露，需要退出本计划的投资者可在本计划开放期 2023 年 7 月 5 日提出全部份额退出申请（需提前预约赎回，预约赎回期为 2023 年 6 月 28 日至 2023 年 7 月 3 日，管理人将按 2023 年 7 月 5 日净值确认退出金额），本次开放不受锁定期限制，变更后的新合同自 2023 年 7 月 5 日起正式生效。

如有疑问，请与我司联系。联系电话：020-88830716。

特此公告。



THE UNIVERSITY OF CHICAGO
DIVISION OF THE PHYSICAL SCIENCES
DEPARTMENT OF PHYSICS
530 SOUTH EAST ASIAN AVENUE
CHICAGO, ILLINOIS 60607-7080
TEL: 773-936-5429 FAX: 773-936-5428
WWW.PHYSICS.UCHICAGO.EDU

RECEIVED
JAN 10 1997
PHYSICS DEPARTMENT
CHICAGO, ILLINOIS 60607-7080

