

《海通期货-步步增集合资产管理计划资产管理合同》 变更公告（一）

尊敬的投资者：

中国证监会于 2023 年 1 月 12 日发布《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会公告〔2023〕2 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》（证监会令第 203 号）（统称“资管规定”）并从 2023 年 3 月 1 日起施行。我司作为海通期货-步步增集合资产管理计划的管理人已于 2023 年 2 月 28 日发布《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》。

鉴于资管规定内容有所变化，依照《海通期货-步步增集合资产管理计划资产管理合同》“二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算”的规定“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。”我司已于 2023 年 9 月 13 日同托管人广发证券股份有限公司就变更事项达成一致，现对《海通期货-步步增集合资产管理计划资产管理合同》进行变更（详见附件《海通期货-步步增集合资产管理计划资产管理合同调整说明》）。

本次变更内容自公告发布之日起生效。即日起我司将启用整合更新后的《海通期货-步步增集合资产管理计划资产管理合同（2023 年 9 月修订版）》，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-步步增集合资产管理计划资产管理合同（2023 年 9 月修订版）》。

特此公告。



附件：海通期货-步步增集合资产管理计划资产管理合同调整说明

具体调整事项如下：

章节	修订前正文	修订后正文
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 13、固定日期计提业绩报酬的风险 本计划除在委托人赎回日、收益分配日、计划终止日提取管理人业绩报酬，还设置在每年的固定日期提取业绩报酬，固定日期提取业绩报酬是通过扣减委托人持有之计划份额的方式进行的。固定日期计提业绩报酬时，会扣减委托人持有的份额，但不会导致计划份额净值产生变化。故委托人需注意其持有的计划财产可能会因持有的计划份额数量的减少而减少。 （二）一般风险揭示 1、本金损失风险 资产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 本计划可能投资于由管理人或其关联方管理的产品或者与管理人或其关联方管理的其他产品或管理人自身进行交易，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	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 13、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 资产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

违规行为。但该等交易仍构成管理人与本计划的关联交易，可能存在利益冲突风险。	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。
--	--

资产合法性及投资者适当性承诺书	本人/本单位符合期货公司资产管理业务合格投资者相关标准，符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》第三条规定的“最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位”、“具有2年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元的个人”条件，或符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》第三条规定的其他情形。	本人/本单位符合期货公司资产管理业务合格投资者相关标准，符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》第三条规定的“具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元”、“最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位”、“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）登记的资产管理人、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”、“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”、“基本养老保险金、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）”条件，或符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》第三条规定的其他情形。
一、前言	（一）订立本合同的目的、依据和原则： 1、订立本合同的目的是明确本合同当事人的权利义务、规范本计划的运作、保护资产委托人的合法权益。 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	（一）订立本合同的目的、依据和原则： 1、订立本合同的目的是明确本合同当事人的权利义务、规范本计划的运作、保护资产委托人的合法权益。 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

	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。 （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。	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。 （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。
四、当事人及权利义务	（二）资产管理人 1、资产管理人概况 名称：海通期货股份有限公司 住所：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1589号17楼、6楼01、03、04单元、25楼、2楼05、03单元 3、资产管理人的义务 （1）依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜； （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； （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； （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、	（二）资产管理人 1、资产管理人概况 名称：海通期货股份有限公司 住所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号第5层、第11层04单元、第12层 3、资产管理人的义务 （1）依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜； （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； （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； （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；

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； （22）办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项； （23）建立并保存投资者名单； （24）组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配； （25）按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年； （26）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者； （27）本合同的签署采用纸质合同的方式进行的，应妥善保管并按托管人要求，于合同签署完成后的 60 日内，及时向托管人移交委托人签署的合同原件； （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。 （三）资产托管人 3、资产托管人的义务 （1）安全保管资产管理计划财产； （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；	（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； （23）办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项； （24）建立并保存投资者名单； （25）组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配； （26）按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年； （27）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者； （28）本合同的签署采用纸质合同的方式进行的，应妥善保管并按托管人要求，于合同签署完成后的 60 日内，及时向托管人移交委托人签署的合同原件； （29）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。 （三）资产托管人 3、资产托管人的义务 （1）安全保管资产管理计划财产； （9）编制托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构；
---	--

	 （14）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本合同《投资监督事项表》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会； （15）国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。	（14）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本合同《投资监督事项表》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权报告中国证监会相关派出机构； （15）国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。
五、资产管理计划基本情况	（五）投资范围： 1、权益类：国内证券交易所上市的股票（含网上和网下新股申购）、港股通、融资融券、股票型公募基金。 3、商品及金融衍生品类：国内证券及期货交易所上市的期货和期权品种。 4、其他：除股票型公募基金、债券型公募基金以及货币市场基金以外的公募基金。 （六）投资比例及限制： 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%。 2、本计划存续期内，计划总资产与净资产的比例不得超过 150%。 3、投资于债券或资产支持证券，债项或主体评级需在 AA 级（含）以上（若有多个评级机构进行评级的，以届时最新评级为准，中债资信评级除外。）； 4、不得主动投资“S”、“ST”、“*ST”、“S*ST”及“SST”类股票。 5、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	（五）投资范围： 1、权益类：国内证券交易所上市的股票（含网上和网下新股申购）、港股通、融资融券、股票型公募基金。 3、期货和衍生品类：国内证券及期货交易所上市的期货和期权品种。 4、其他：除股票型公募基金、债券型公募基金以及货币市场基金以外的公募基金。 （六）投资比例及限制： 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%。 2、本计划存续期内，计划总资产与净资产的比例不得超过 150%。 3、投资于债券或资产支持证券，债项或主体评级需在 AA 级（含）以上（若有多个评级机构进行评级的，以届时最新评级为准，中债资信评级除外。）； 4、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%时，本计划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

	金占用计算，期权权利方按权利金市值计算、义务方按保证金计算）；本管理人所管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金不得超过该资产规模的 25%。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； 6、参与股票、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。 7、管理人发行的全部资产管理计划投资于单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%。 8、法律法规及监管机构规定的其他限制。	等中国证监会认可的投资品种不受前述规定限制。 5、不得主动投资“S”、“ST”、“*ST”、“S*ST”及“SST”类股票。 6、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，期权权利方按权利金市值计算、义务方按保证金计算）；本管理人所管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金不得超过该资产规模的 25%。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； 7、参与股票、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。 8、管理人发行的全部资产管理计划投资于单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%。 9、法律法规及监管机构规定的其他限制。
六、资产管理计划的募集	1、募集对象 本计划仅向符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》规定的合格投资者发售，即具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。 （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	1、募集对象 本计划仅向符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》规定的合格投资者发售，即具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。 （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

	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； （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； （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）； （6）中国证监会视为合格投资者的其他情形。 投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。 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、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。	会）登记的私募基金管理人、商业银行、商业银 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； （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； （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）； （6）中国证监会视为合格投资者的其他情形。 投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。 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、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。
八、资产管理计划的参与、退出和转让	（十四）资产管理人以自有资金参与资产管理计划的条件、方式、金额、比例以及管理人自有资金退出的条件 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，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	（十四）资产管理人及其控股股东、子公司以自有资金参与资产管理计划的条件、方式、金额、比例以及资产管理人及其控股股东、子公司自有资金退出的条件 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。本合同当事人一致同意，该条款由资产管理人自行监控。 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。 2、认购、参与、退出方式 资产管理人或其关联方的自有资金和董事、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。资产管理人应当向投资者进行披露，对该资产管理计划账户进行监控，并及时向监管机构报告。 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。	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，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。
十一、资产管理计划的投资	（二）投资范围 1、权益类：国内证券交易所上市的股票（含网上和网下新股申购）、港股通、融资融券、股票型公募基金。 3、商品及金融衍生品类：国内证券及期货交易所上市的期货和期权品种。 4、其他：除股票型公募基金、债券型公募基金以及货币市场基金以外的公募基金。 资产管理计划改变投向和投资比例的，应当事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。 （六）投资比例及限制 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%。 2、本计划存续期内，计划总资产与净资产的比例不得超过 150%。 3、投资于债券或资产支持证券，债项或主体评级需在 AA 级（含）以上（若有多个评级机构进行评级的，以届时最新评级为准，中债资	（二）投资范围 1、权益类：国内证券交易所上市的股票（含网上和网下新股申购）、港股通、融资融券、股票型公募基金。 3、期货和衍生品类：国内证券及期货交易所上市的期货和期权品种。 4、其他：除股票型公募基金、债券型公募基金以及货币市场基金以外的公募基金。 资产管理计划改变投向和投资比例的，应当事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。 （六）投资比例及限制： 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%。 2、本计划存续期内，计划总资产与净资产的比例不得超过 150%。 3、投资于债券或资产支持证券，债项或主体评级需在 AA 级（含）以上（若有多个评级机构进行评级的，以届时最新评级为准，中债资信评级除外。）；

信用评级除外。)； 4、不得主动投资“S”、“ST”、“*ST”、“S*ST”及“SST”类股票。 5、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，期权权利方按权利金市值计算、义务方按保证金计算）；本管理人所管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金不得超过该资产规模的25%。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； 6、参与股票、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。 7、管理人发行的全部资产管理计划投资于单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的30%。 8、法律法规及监管机构规定的其他限制。 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，并按规定履行合同变更程序。 （七）投资比例超限的处理方式及流程 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或限制的，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	4、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%时，本计划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。 5、不得主动投资“S”、“ST”、“*ST”、“S*ST”及“SST”类股票。 6、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，期权权利方按权利金市值计算、义务方按保证金计算）；本管理人所管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金不得超过该资产规模的25%。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； 7、参与股票、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。 8、管理人发行的全部资产管理计划投资于单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的30%。 9、法律法规及监管机构规定的其他限制。 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，并按规定履行合同变更程序。 （七）投资比例超限的处理方式及流程 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
--	---

	十五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。	中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例或限制的，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，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。
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、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。 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。 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	（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一款所列情形外，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。

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。 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。 （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，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。 （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。 （四）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	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： 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。 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
---	---

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。	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。 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。资产委托人为符合中国证监会规定的专业投资者且投资金额不低于 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。 （二）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。 （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。
十九、越权交易	（二）对越权交易的处理程序 1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为 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资产管理计划投资不符合投资比例或限制要求的，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，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。	（二）对越权交易的处理程序 1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为 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资产管理计划投资不符合投资比例或限制要求的，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，应当及时向中国证监会相关派出机构报告。
二十一、资产管理业务的费用与税收	3、管理人的业绩报酬 （1）业绩报酬提取的时点与方式 1）采用单个资产委托人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，资产管理人对计划份额持有人每笔参与份额分别计提业绩报酬。 2）本计划的业绩报酬计提日为委托人退出日、收益分配日、计划终止日和固定时点（即每年6月10日，如遇非工作日顺延至下一工作日）。当计划份额持有人每笔所持份额或退出份额在持有期的年化收益率大于8%时，分别计算每笔份额在上一成功计提日至本次计提日持有期间的年化收益率（r），对超出8%的持有期差额收益按30%比例进行计提。计提频率不得超过每6个月一次，因投资者退出或终止，不受前述提取频率的限制。 3）在赎回、计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金、清算资产中扣除。在固定时点提取业绩报酬的，业绩报酬以扣减存续委托人份额的方式提取，在固定提取时点委托人有赎回份额的，对应的业绩报酬从赎回资金中扣除。 收益分配业绩报酬从委托人收益分配资金	3、管理人的业绩报酬 （1）业绩报酬提取的时点与方式 1）采用单个资产委托人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，资产管理人对计划份额持有人每笔参与份额分别计提业绩报酬。 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。当计划份额持有人每笔所持份额或退出份额在持有期的年化收益率大于8%时，分别计算每笔份额在上一成功计提日至本次计提日持有期间的年化收益率（r），对超出8%的持有期差额收益按30%比例进行计提。计提频率不得超过每6个月一次，因投资者退出或终止，不受前述提取频率的限制。 3）在赎回、计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金、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

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，计算赎回份额对应的业绩报酬。 (2) 业绩报酬提取的方法 业绩报酬（R）的计提方法： 如果 $r \leq 8\%$，则 $R = 0$ 如果 $8\% < r$，则 $R = F \times C \times (r - 8\%) \times 30\% \times T / 365$ $r = \frac{C_T - C_0}{C} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ $\Delta S_{ij} = R / NAV$ C_T = 本次业绩报酬计提日提取业绩报酬前的份额累计单位净值； C_0 = 上一次业绩报酬成功计提日提取业绩报酬后的份额累计单位净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为该笔份额对应的认购价格或追加时参与日的份额累计净值； C = 上一次业绩报酬成功计提日提取业绩报酬后的份额单位净值； F = 本次业绩报酬计提日对应提取业绩报酬的份额数量； r = 资产委托人每笔份额年化收益率； R 为业绩报酬计提期间某笔份额应计提的业绩报酬，计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入； T = 上一次业绩报酬成功计提日至本次业绩报酬计提日的自然日天数；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为成立日或追加确认日至本次业绩报酬计提日的自然日天数（计尾不计头）； 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。 （特别提示：固定时点提取业绩报酬通过	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，计算赎回份额对应的业绩报酬。 (2) 业绩报酬提取的方法 业绩报酬（R）的计提方法： 如果 $r \leq 8\%$，则 $R = 0$ 如果 $8\% < r$，则 $R = F \times C \times (r - 8\%) \times 30\% \times T / 365$ $r = \frac{C_T - C_0}{C} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ C_T = 本次业绩报酬计提日提取业绩报酬前的份额累计单位净值； C_0 = 上一次业绩报酬成功计提日提取业绩报酬后的份额累计单位净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为该笔份额对应的认购价格或追加时参与日的份额累计净值； C = 上一次业绩报酬成功计提日提取业绩报酬后的份额单位净值； F = 本次业绩报酬计提日对应提取业绩报酬的份额数量； r = 资产委托人每笔份额年化收益率； R 为业绩报酬计提期间某笔份额应计提的业绩报酬，计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入； T = 上一次业绩报酬成功计提日至本次业绩报酬计提日的自然日天数；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为成立日或追加确认日至本次业绩报酬
---	---

	扣减委托人持有份额的方式进行提取，此种方式会减少委托人的持有份额，但不会影响计划份额净值的变化。业绩报酬提取后委托人持有份额=业绩报酬计提基准日委托人持有份额-委托人应扣减的计划份额。) 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。 本计划的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。 (3) 业绩报酬的支付 上述业绩报酬在赎回计划份额、收益分配日、合同约定固定时点及计划终止清算后 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。固定提取日所计提业绩报酬通过扣减委托人持有份额的方式提取应计提的业绩报酬。业绩报酬由【管理人】负责计算及复核，业绩报酬从计划财产中划付给管理人。	计提日的自然日天数（计尾不计头）； 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。 本计划的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。 (3) 业绩报酬的支付 上述业绩报酬在赎回计划份额、收益分配日、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。固定提取日所计提业绩报酬通过扣减委托人持有份额的方式提取应计提的业绩报酬。业绩报酬由【管理人】负责计算及复核，业绩报酬从计划财产中划付给管理人。
二十三、信息披露与报告	(3) 年度报告 管理人应当在每年度结束之日起四个月内，编制完成年度报告并经托管人复核其中财务数据后，向资产委托人披露包括但不限于下列信息： 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。 计划成立不足 3 个月以及存续期间不足 3 个月的，管理人可以不编制当期年度报告。如基金业协会制定了相关信息披露规则，则从其规则执行。 (三) 向监管机构提供的报告 管理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。	(3) 年度报告 管理人应当在每年度结束之日起四个月内，编制完成年度报告并经托管人复核其中财务数据后，向资产委托人披露包括但不限于下列信息： 集合资产管理计划年度财务会计报告应当符合《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。 计划成立不足 3 个月以及存续期间不足 3 个月的，管理人可以不编制当期年度报告。如基金业协会制定了相关信息披露规则，则从其规则执行。 (三) 向监管机构提供的报告 管理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。 中国证监会对上述信息披露内容另有规定的，从其规定。

二十四、 风 险 揭 示	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 13、固定日期计提业绩报酬的风险 本计划除在委托人赎回日、收益分配日、计划终止日提取管理人业绩报酬，还设置在每年的固定日期提取业绩报酬，固定日期提取业绩报酬是通过扣减委托人持有之计划份额的方式进行的。固定日期计提业绩报酬时，会扣减委托人持有的份额，但不会导致计划份额净值产生变化。故委托人需注意其持有的计划财产可能会因持有的计划份额数量的减少而减少。 （三）一般风险揭示 2、本金损失风险 资产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 本计划可能投资于由管理人或其关联方管理的产品或者与管理人或其关联方管理的其他产品或管理人自身进行交易，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。但该等交易仍构成管理人与本计划的关联交易，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 13、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。 （三）一般风险揭示 2、本金损失风险 资产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
-----------------------------	--	---

		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。
二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算	（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。 （五）资产管理合同终止的情形包括下列事项：	（三）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金业协会备案。 （五）资产管理合同终止的情形包括下列事项： 1、资产管理计划存续期届满且不展期；

	1、资产管理计划存续期届满且不展期； 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6项约定的情形除外。 （六）资产管理计划财产的清算 3、清算程序 1）资产管理合同终止后，由管理人负责接管非现金类计划财产；由托管人接管现金类计划财产； 6）由管理人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。 6、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规定计算。管理人应在上述证券可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。	 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。 管理人应当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，前述第6项约定的情形除外。 （六）资产管理计划财产的清算 3、清算程序 1）资产管理合同终止后，由管理人负责接管非现金类计划财产；由托管人接管现金类计划财产； 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。 6、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规定计算。管理人应在上述证券可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。
附件一： 投资监督事项	1、投资范围 （1）权益类：国内证券交易所上市的股票（含网上和网下新股申购）、港股通、融资融券、	1、投资范围 （1）权益类：国内证券交易所上市的股票（含网上和网下新股申购）、港股通、融资融券、股票

表	股票型公募基金。 （3）商品及金融衍生品类：国内证券及期货交易所上市的期货和期权品种。 （4）其他：除股票型公募基金、债券型公募基金以及货币市场基金以外的公募基金。 2、投资比例及限制 （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%。 （2）本计划存续期内，计划总资产与净资产的比例不得超过 150%。 （3）投资于债券或资产支持证券，债项或主体评级需在 AA 级（含）以上（若有多个评级机构进行评级的，以届时最新评级为准，中债资信评级除外。）； （4）不得主动投资“S”、“ST”、“*ST”、“S*ST”及“SST”类股票。 （5）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，期权权利方按权利金市值计算、义务方按保证金计算）；本管理人所管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金不得超过该资产规模的 25%。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；	型公募基金。 （3）期货和衍生品类：国内证券及期货交易所上市的期货和期权品种。 （4）其他：除股票型公募基金、债券型公募基金以及货币市场基金以外的公募基金。 2、投资比例及限制 （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%。 （2）本计划存续期内，计划总资产与净资产的比例不得超过 150%。 （3）投资于债券或资产支持证券，债项或主体评级需在 AA 级（含）以上（若有多个评级机构进行评级的，以届时最新评级为准，中债资信评级除外。）； （4）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%时，本计划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。 （5）不得主动投资“S”、“ST”、“*ST”、“S*ST”及“SST”类股票。 （6）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，期权权利方按权利金市值计算、义务方按保证金计算）；本管理人所管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金不得超过该资产规模的 25%。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；
---	---	---

