

海通期货-通利未来 FOF 一期集合资产管理计划

资产管理合同变更公告（五）

尊敬的委托人、托管人：

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）（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-通利未来 FOF 一期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》。

因法律法规变化及产品运作需要，现需对《海通期货-通利未来 FOF 一期集合资产管理计划资产管理合同（2022 年 5 月修订）》的部分条款进行变更，本次变更主要涉及：

1、本计划就《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）的要求进行内容修订。

2、本计划对估值内容进行调整，本次调整对资产委托人利益无实质性不利影响。

依照《海通期货-通利未来 FOF 一期集合资产管理计划资产管理合同（2022 年 5 月修订）》“二十四、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。”及“当出现下列情形时，资产管理人有权单独变更合同内容的情形”中的“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。”我司已于 2023 年〔 月 〕日同托管人华泰证券股份有限公司就变更事项达成一致，现对《海通期货-通利未来 FOF 一期集合资产管理计划资产管理合同（2022 年 5 月修订）》的内容进行变更（详见附件《海通期货-通利未来 FOF 一期集合资产管理计划资产管理合同（2022 年 5 月修订）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-通利未来 FOF 一期集合资产管理计划资产管理合同（2023 年 11 月修订）》，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-通利未来 FOF 一期集合资产管理计划资

产管理合同（2023 年 11 月修订）》。

特此公告。

海通期货股份有限公司

2023 年 11 月 6 日



附件：海通期货-通利未来 FOF 一期集合资产管理计划资产管理合同（2022 年 5 月修订）调整说明

具体调整事项如下：

章节	修订前正文	修订后正文
海通期货-通利未来 FOF 一期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>5、份额锁定期风险</p> <p>本计划针对每一参与份额设锁定期，可能对份额持有人自身的流动性造成不利影响，如市场出现大幅波动且投资者无法及时赎回，存在导致份额持有人损失进一步扩大的风险。</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。”</p>	<p>“二、风险揭示</p> <p>（一）特殊风险揭示</p> <p>……</p> <p>5、份额锁定期风险</p> <p>本计划针对每一参与份额设锁定期，可能对份额持有人自身的流动性造成不利影响，如市场出现大幅波动且投资者无法及时赎回，存在导致份额持有人损失进一步扩大的风险。</p> <p>6、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>（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>若本计划投资于管理人所设立的资产管理产品，可能会造成管理人对本计划及本计划所投资的资产管理产品均收取管理费、业绩报酬（如有）等费用的情况，进而影响计划的收益水平。</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>一、前言</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总则》、《中华人民共和国合同法》、《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》、《期货公司资产管理业务管理规则（试行）》、《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</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</p>

	<p>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》、《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>.....</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>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》、《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>.....</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>四、当事人及权利义务</p>	<p>“（二）资产管理人</p> <p>1、资产管理人概况</p> <p>.....</p> <p>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</p> <p>2、资产管理人的权利</p> <p>.....</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>.....</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>.....</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</p>	<p>“（二）资产管理人</p> <p>1、资产管理人概况</p> <p>.....</p> <p>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</p> <p>2、资产管理人的权利</p> <p>.....</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>.....</p> <p>3、资产管理人的义务</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>中国证监会相关派出机构；” 余项序号顺延</p> <p>“（三）资产托管人 3、资产托管人的职责 …… （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； …… （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； （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。”</p>	<p>余项序号顺延</p> <p>“（三）资产托管人 3、资产托管人的职责 …… （9）编制托管年度报告，并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； （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。”</p>
<p>五、资产管理计划基本情况</p>	<p>“（六）主要投资方向：资产管理产品类、权益类、固定收益类、商品及金融衍生品类、现金管理类资产。 （七）投资比例：投资于资产管理产品类资产的比例不得低于资产总资产的 80%；按照穿透原则合并计算，投资于权益类资产、固定收益类、商品及金融衍生品类资产的任一资产比例不超过计划总资产的 80%。”</p>	<p>“（六）主要投资方向：资产管理产品类、权益类、固定收益类、期货和衍生品类、现金管理类资产。 （七）投资比例：投资于资产管理产品类资产的比例不得低于资产总资产的 80%；按照穿透原则合并计算，投资于权益类资产、固定收益类、期货和衍生品类的任一资产比例不超过计划总资产的 80%。”</p>
<p>六、资产管理计划的募集</p>	<p>“（一）资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限 1、募集对象 …… （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； （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>“（一）资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限 1、募集对象 …… （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； （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>(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> <p>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。</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、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>(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> <p>(6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> <p>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。</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、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</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>“(十四) 资产管理人及其控股股东、子公司以自有资金参与本管理计划的情况</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</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>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>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>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： …… 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>（七）投资限制与比例</p> <p>1、投资于资产管理产品的比例不得低于总资产的 80%。</p> <p>2、按照穿透原则合并计算，投资于固定收益类资产、权益类资产、商品及金融衍生品类且任一资产类别的投资比例不超过计划总资产 80%。</p> <p>3、本计划存续期内，计划总资产与净资产的比例不得超过 200%。</p> <p>4、投资于同一资产的资金不得超过本计划资</p>	<p>“（二）投资范围： …… 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>（七）投资限制与比例</p> <p>1、投资于资产管理产品的比例不得低于总资产的 80%。</p> <p>2、按照穿透原则合并计算，投资于固定收益类资产、权益类资产、期货和衍生品类且任一资产类别的投资比例不超过计划总资产 80%。</p> <p>3、本计划存续期内，计划总资产与净资产的比例不得超过 200%。</p> <p>4、投资于同一资产的资金不得超过本计划资</p>

	<p>产净值的 25%；本管理人所管理的全部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。</p> <p>“（八）投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>资产管理计划存续期间，管理人应当严格按照法律、行政法规、中国证监会规定以及合同约定的投向和比例进行资产管理计划的投资运作。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。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>产净值的 25%；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。</p> <p>5、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。</p> <p>（八）投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>资产管理计划存续期间，管理人应当严格按照法律、行政法规、中国证监会规定以及合同约定的投向和比例进行资产管理计划的投资运作。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。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</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>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、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>(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：</p> <p>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华泰证券专业机构服务平台</p> <p>(https://pb.htsc.com.cn/disclosure.html) 为准，委托人可进行查询。</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：</p> <p>委托人签署本合同即视为已经充分理解并同</p>

		<p>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</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>本计划投资管理人和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者和托管人披露关联交易具体情况。</p> <p>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</p>
--	--	--

		<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
	<p>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>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>（二） 本计划存在利益冲突的信息披露</p> <p>1、披露方式</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>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 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 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>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。</p> <p>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。”</p>
<p>十八、越权交易</p>	<p>“（二）对越权交易的处理程序</p> <p>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</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导致资产管理计划投资不符合投资比例要求的，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，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>托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。</p> <p>托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。</p> <p>管理人应向托管人主动报告越权交易。托管人有权督促管理人在限期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。</p> <p>……</p> <p>（三）托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、托管人对管理人的投资行为行使监督权，资产托管人对资产管理人具体投资监督事项以本</p>	<p>“（二）对越权交易的处理程序</p> <p>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</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导致资产管理计划投资不符合投资比例要求的，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，应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构。</p> <p>托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构。</p> <p>管理人应向托管人主动报告越权交易。托管人有权督促管理人在限期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构。</p> <p>……</p> <p>（三）托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、托管人对管理人的投资行为行使监督权，资产托管人对资产管理人具体投资监督事项以本章约定为准，具体投资监督事项如下：</p>

<p>章约定为准,具体投资监督事项如下:</p> <p>(1) 本计划的投资范围</p> <p>.....</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>.....</p> <p>(2) 投资限制与比例</p> <p>①投资于资产管理产品的比例不得低于总资产的 80%。</p> <p>②按照穿透原则合并计算,投资于固定收益类资产、权益类资产、商品及金融衍生品类任一资产类别的投资比例不超过本计划总资产 80%。</p> <p>③本计划存续期内,计划总资产与净资产的比例不得超过 200%。</p> <p>④投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 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。</p>	<p>(1) 本计划的投资范围</p> <p>.....</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>.....</p> <p>(2) 投资限制与比例</p> <p>①投资于资产管理产品的比例不得低于总资产的 80%。</p> <p>②按照穿透原则合并计算,投资于固定收益类资产、权益类资产、期货和衍生品类任一资产类别的投资比例不超过本计划总资产 80%。</p> <p>③本计划存续期内,计划总资产与净资产的比例不得超过 200%。</p> <p>④投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 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。</p> <p>⑤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。如若发现本计划的发行人及其关联方的界定有歧义的,管理人和托管人协商确认口径,如未达成一致则以管理人监控口径为准。</p> <p>本合同当事人知悉且确认,按穿透原则计算的监控频率将依赖于所投资资产管理产品披露组合投资的频率,托管人将按管理人提供的数据进行事后监督。管理人应确保所提供数据的真实性、完整性、准确性。</p>
<p>资产管理计划存续期间,管理人应当严格按照法律、行政法规、中国证监会规定以及合同约定的投向和比例进行资产管理计划的投资运作。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。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</p>	<p>资产管理计划存续期间,管理人应当严格按照法律、行政法规、中国证监会规定以及合同约定的投向和比例进行资产管理计划的投资运作。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。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</p>

	<p>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>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>十九、资产管理计划财产的估值和会计核算</p>	<p>“（一）计划财产的估值 8、估值方法 本计划按以下方式进行估值： （1）证券交易所上市的有价证券的估值 D、交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。 （2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： A、送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值。 B、首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。 （3）全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，主要采用第三方机构提供的估值价格和估值技术。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，按成本估值。 （4）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。 （5）上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。其他基金按最近交易日的计划份额净值估值。场外交易的货币基金以成本估值，每日按前一交易日的万份收益计提红利。</p>	<p>“（一）计划财产的估值 8、估值方法 本计划按以下方式进行估值： （1）证券交易所上市的有价证券的估值 D、交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。 （2）处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： A、送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值；该日无交易的，以最近一日的收盘价估值。 B、首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值。 （3）全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，主要采用第三方机构提供的估值价格和估值技术。 （4）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。 （5）上市流通的基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。其他基金按最近交易日的计划份额净值估值。场外交易的货币基金以成本估值，每日按前一交易日的万份收益计提红利。 （6）期货以估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的，从其规定。 （7）计划持有的衍生工具等其他有价证券，</p>

	<p>(6) 期货以估值日的结算价估值，若估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。法律法规另有规定的，从其规定。</p> <p>(7) 计划持有的衍生工具等其他有价证券，上市交易的按估值日的结算价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的结算价估值；未上市交易的，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量的情况下，按成本估值；停止交易、但未行权的有价证券，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>(8) 债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。</p> <p>(9) 银行存款、债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收、应付利息，在结息日以实收、实付利息入账。</p> <p>(10) 中小企业私募债按照成本估值。</p> <p>(11) 对于投资的基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、私募投资基金等场外产品（以下简称“标的产品”），按如下方式进行估值：“</p>	<p>上市交易的按估值日的结算价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的结算价估值；未上市交易的，采用估值技术确定公允价值；停止交易、但未行权的有价证券，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>(8) 债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。</p> <p>(9) 银行存款、债券、回购等计息资产按照约定利率在持有期内逐日计提应收、应付利息，在结息日以实收、实付利息入账。</p> <p>(10) 对于投资的基金管理公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、信托计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、私募投资基金等场外产品（以下简称“标的产品”），按如下方式进行估值：“</p>
<p>二十二、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>……</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>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。”</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</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>……</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>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。”</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</p>

	监会和基金业协会的要求履行报告义务。”	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。”
二十三、 风险揭示	<p>“资产管理计划投资可能面临下列各项风险，包括但不限于：</p> <p>（八）关联交易的风险</p> <p>在本计划运作过程中，相关当事人违反规定，以本计划的财产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场等引致的风险。</p>	<p>“资产管理计划投资可能面临下列各项风险，包括但不限于：</p> <p>（八）关联交易的风险</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>若本计划投资于管理人所设立的资产管理产品，可能会造成管理人对本计划及本计划所投资的资产管理产品均收取管理费、业绩报酬（如有）等费用的情况，进而影响计划的收益水平。</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</p>

	<p>.....</p> <p>（十一）本计划本身面临的风险</p> <p>6、份额锁定期风险</p> <p>本计划针对每一参与份额设锁定期，可能对份额持有人自身的流动性造成不利影响，如市场出现大幅波动且投资者无法及时赎回，存在导致份额持有人损失进一步扩大的风险。”</p>	<p>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>.....</p> <p>（十一）本计划本身面临的风险</p> <p>6、份额锁定期风险</p> <p>本计划针对每一参与份额设锁定期，可能对份额持有人自身的流动性造成不利影响，如市场出现大幅波动且投资者无法及时赎回，存在导致份额持有人损失进一步扩大的风险。</p> <p>7、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>二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算</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>.....</p> <p>（五）资产管理合同终止的情形包括下列事项：</p> <p>.....</p> <p>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 7 项约定的情形除外。</p> <p>（六）资产管理计划的清算</p> <p>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</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>.....</p> <p>（五）资产管理合同终止的情形包括下列事项：</p> <p>.....</p> <p>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，前述第 6 项约定的情形除外。</p> <p>（六）资产管理计划的清算</p> <p>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</p> <p>.....</p>

<p>.....</p> <p>2、清算程序</p> <p>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；</p> <p>3) 对资产管理计划财产进行估值和变现；</p> <p>4) 制作清算报告；</p> <p>5) 对资产管理计划财产进行分配；</p> <p>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。</p> <p>.....</p> <p>5、未能变现的资产处理</p> <p>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十九章的规定计算。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、清算程序</p> <p>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；</p> <p>3) 对资产管理计划财产进行估值和变现；</p> <p>4) 制作清算报告；</p> <p>5) 对资产管理计划财产进行分配；</p> <p>6) 将清算报告报证券投资基金业协会并披露给资产委托人。</p> <p>.....</p> <p>5、未能变现的资产处理</p> <p>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十九章的规定计算。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>
---	--

