

关于《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）》 变更生效通知暨变更公告（二）

尊敬的委托人、托管人：

由我司担任管理人的“海通期货-步步增集合资产管理计划”因投资管理需要，现需对《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）》（以下简称《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

本计划降低业绩报酬计提基准（原8%调整至7%）。

1. 将《资产管理合同》“二十一、资产管理计划的费用与税收”中“（二）费用计提方法、计提标准和支付方式”的以下表述：

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。

... ..”

修改为

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 7% 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 7% 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 $r \leq 7\%$ ，则 $R = 0$

21日给予不同意变更的委托人退出。本次变更事项自临时开放日的次工作日即2023年12月22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-步步增集合资产管理计划资产管理合同（2023年12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-步步增集合资产管理计划资产管理合同（2023年12月修订版）》。

三、风险揭示及特别提醒

1.因本次变更涉及降低业绩报酬计提基准，委托人存量资产管理计划份额在本次变更生效日前按照原业绩报酬计提基准计提业绩报酬，自本次变更生效日（含）起按照变更后的业绩报酬计提基准计提业绩报酬。在本次变更生效日之后的业绩报酬计提日，管理人将分别计算变更生效日前后计划份额的年化收益率，然后对应不同的业绩报酬计提基准分别计算可计提的业绩报酬，最后加总得出管理人的业绩报酬。

2.本计划降低了业绩报酬计提基准，可能会提高管理人的业绩报酬。提高业绩报酬有助于激励管理人更好地管理本产品、为投资者创造更高的产品收益，但如在产品收益率没有明显提高的情况下，也可能造成投资者获得的投资收益减少。

请您关注自身权益，防范风险。

