

海通期货-灵曜1号固收增强集合资产管理计划资产管理合同 变更生效通知暨变更公告（三）

尊敬的委托人：

由我司担任管理人的“海通期货-灵曜1号固收增强集合资产管理计划”因投资管理需要及法律法规变化，现需对《海通期货-灵曜1号固收增强集合资产管理计划资产管理合同（修订版）》（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、本计划对投资比例及限制、投资比例超限处理方式条款进行调整。
- 2、本计划对资产管理人义务、资产管理计划财产相关账户的开立和管理等条款进行补充。
- 3、本计划对信息披露方式进行调整。
- 4、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。

具体变更内容请见附件《海通期货-灵曜1号固收增强集合资产管理计划资产管理合同（修订版）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，并按合同约定安排临时开放日2024年1月15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2024年1月16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-灵曜1号固收增强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-灵曜1号固收增强集合资产管理计划

资产管理合同（2023年12月修订版）》。

特此公告。



附件：海通期货-灵曜1号固收增强集合资产管理计划资产管理合同（修订版）调整说明

具体调整事项如下：

| 章节 | 修订前正文 | 修订后正文 |
|---|---|--|
| <p>海通期货-灵曜1号固收增强集合资产管理计划资产管理业务风险揭示书</p> | <p>“二、风险揭示 （一）特殊风险揭示 …… 7、参与债券回购风险 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 （一）特殊风险揭示 …… 7、参与债券回购风险 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 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、通过第三方基金销售机构投资开放式基金的风险 本资产管理计划可通过第三方基金销售机构投资开放式基金，资产管理人负责选择销售机构，并确保在销售机构预留的备案回款账户为银行托管账户。资产托管人对于通过第三方基金销售机构投资开放式基金不承担任何风险。 由于通过第三方销售平台购买，可能会存在认（申）购、赎回（现金分红）基金时资金被挪用的风险；第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资人持有基金份额不准确的风险；认</p> |

(申) 购款未能用于购买指定基金的风险；以及第三方基金销售平台无基金销售资质的风险。

10、浮动业绩报酬计提基准调整的风险

本计划的浮动业绩报酬计提基准为每运作周期调整一次，管理人有权根据市场情况及集合计划运作情况，浮动调整。委托人可能面临业绩报酬计提基准调整的风险。同时，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。

11、信息披露风险

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、代销机构信披渠道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信披渠道相关信息带来的风险。

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资者、投资者无法及时获知披露信息的风险。

(二) 一般风险揭示

.....

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产品或者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

(二) 一般风险揭示

.....

8、关联交易风险

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>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法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》</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</p> |

| | | |
|--------------------------|---|---|
| | <p>(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>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>名称: 海通期货股份有限公司</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>.....</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, 并抄报中国证监会相关派出机构;</p> <p>(22) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项;</p> <p>(23) 建立并保存投资者名单;</p> <p>(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</p> | <p>“ (二) 资产管理人</p> <p>1、资产管理人概况</p> <p>名称: 海通期货股份有限公司</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>.....</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>.....</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>(23) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项;</p> <p>(24) 建立并保存投资者名单;</p> <p>(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;</p> |

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；

(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) 按照我国有关反洗钱法律、行政法规，履行客户身份识别反洗钱义务，识别、核实资产委托人的身份及资产管理计划的受益所有人，并按监管规定保存相关身份信息、资料；在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分，对高风险的客户采取适当的风控措施；在法律允许范围内，配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作，并提供必要客户信息、资料等；履行可疑交易报告义务，并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规，要求资产委托人积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序。根据《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知（银发【2017】235号）》（以下称“235号文”）、《中国人民银行关于进一步做好受益所有人身份识别工作有关问题的通知（银发【2018】164号）》（以下称“164号文”）的相关要求，单一资产管理计划、集合资产管理计划将直接持有或穿透后持有超过 25% 权益份额的自然人作为托管产品的受益所有人；不存在上述条件自然人的，将基金经理或者直接操作管理基金的自然人判定为托管产品受益所有人；不存在上述条件自然人的，将主要负责人、主要管理人或者主要发起人等作为托管产品的受益所有人。

(29) 采取了适当的措施，确保资产管理计划的委托人、受益所有人等不得被列入我国公安部等有权部门发布的恐怖活动组织及恐怖活动人员名单，不得被列入联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的反洗钱和反恐怖融资名单，或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单。

(30) 资产管理计划的投资行为不得违反我

| | | |
|---------------------|--|--|
| | <p>(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。</p> <p>(三) 资产托管人</p> <p>1、资产托管人概况</p> <p>名称：招商银行股份有限公司上海分行</p> <p>住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1088 号招商银行上海大厦 1 幢一至四层、B2 层、2 幢十至十三层、十四层一单元 03 号、二十五至二十七层</p> <p>负责人：施顺华</p> <p>联系人：李钦”</p> | <p>国、联合国及其他可适用的经济制裁或反洗钱法律法规，不得被用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途。</p> <p>(31) 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。</p> <p>(三) 资产托管人</p> <p>1、资产托管人概况</p> <p>名称：招商银行股份有限公司上海分行</p> <p>住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1088 号招商银行上海大厦 1 幢一至四层、B2 层、2 幢十至十三层、十四层一单元 03 号、二十五至二十七层</p> <p>负责人：雷财华</p> <p>联系人：李钦”</p> |
| <p>五、资产管理计划基本情况</p> | <p>“（六）投资比例及限制：</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 140%。</p> <p>3、投资于信用债券或资产支持证券，债项或主体评级需在 AAA 级（含）以上（中债资信评级除外）；</p> <p>4、信用债投资组合久期不超过 5 年；</p> <p>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%（期货期权按单合约保证金占用计算）；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；</p> <p>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；”</p> | <p>“（六）投资比例及限制：</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 140%。</p> <p>3、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>4、投资于信用债券或资产支持证券，债项或主体评级需在 AAA 级（含）以上（中债资信评级除外）；</p> <p>5、信用债（除永续债）投资组合久期不超过 5 年；</p> <p>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%（期货期权按单合约保证金占用计算）；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；</p> <p>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，申报的金额原则上不得超过本资产管理计划的总资产，申报的</p> |

| | | |
|-------------------|---|---|
| | | 数量 原则上 不得超过拟发行公司本次发行的总量；” 余项序号顺延 |
| 六、资产管理计划的募集 | <p>“(一) 资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限</p> <p>1、募集对象</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>“(一) 资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限</p> <p>1、募集对象</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> |
| 八、资产管理计划的参与、退出和转让 | <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</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</p> |

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。

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。

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。”

(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

“(二) 投资范围：
权益类：证券交易所上市的股票(含网上和

“(二) 投资范围：
权益类：证券交易所上市的股票(含网上和

| | | |
|----------------------|---|---|
| <p>理计划的投资</p> | <p>网下新股申购)、股票型公募基金;</p> <p>固定收益类: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、债券回购、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>.....</p> <p>(六) 投资比例及限制</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 140%。</p> <p>3、投资于信用债券或资产支持证券,债项或主体评级需在 AAA 级(含)以上(中债资信评级除外);</p> <p>4、信用债投资组合久期不超过 5 年;</p> <p>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%(期货期权按单合约保证金占用计算);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;</p> <p>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;</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</p> | <p>网下新股申购)、股票型公募基金;</p> <p>固定收益类: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、债券回购、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>.....</p> <p>(六) 投资比例及限制</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 140%。</p> <p>3、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>4、投资于信用债券或资产支持证券,债项或主体评级需在 AAA 级(含)以上(中债资信评级除外);</p> <p>5、信用债(除永续债)投资组合久期不超过 5 年;</p> <p>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%(期货期权按单合约保证金占用计算);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;</p> <p>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,申报的金额原则上不得超过本资产管理计划的总资产,申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量;</p> <p>余项序号顺延</p> |
|----------------------|---|---|

| | | |
|----------------------------|---|--|
| | <p>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。”</p> | <p>(七) 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，投资者签署本合同即在此同意，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。”</p> <p>余项序号顺延</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</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</p> |

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。

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。

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。

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、托管人及其的控股股东、实际控制人或者其他关联方。

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。

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。

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。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。

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

| | | |
|-------------------------|--|--|
| | <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>义融资安排等方式,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>(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>余项序号顺延</p> |
| <p>十六、资产管理计划的财产</p> | <p>“(二) 资产管理计划财产相关账户的开立和管理</p> <p>.....</p> <p>3、证券账户和期货账户的持有人名称应当符合《运作管理规定》的有关规定,由托管人或管理人按照规定开立。与计划投资运作有关的其他账户由管理人与托管人协商后办理。”</p> | <p>“(二) 资产管理计划财产相关账户的开立和管理</p> <p>.....</p> <p>3、证券账户和期货账户的持有人名称应当符合《运作管理规定》的有关规定,由托管人或管理人按照规定开立。与计划投资运作有关的其他账户由管理人与托管人协商后办理。</p> <p>4、除法律法规另有规定外,投资账户户名与本资产管理计划银行托管账户户名一致,投资本金及收益回款账户应指定为本资产管理计划的银行托管账户。”</p> |
| <p>十七、划款指令的发送、确认和执行</p> | <p>“(九) 相关责任</p> <p>对资产管理人在没有充足资金的情况下向资产托管人发出的指令致使资金未能及时清算所造成的损失由资产管理人承担。因资产管理人原因造成的传输不及时、未能留出足够执行时间、未能及时与资产托管人进行指令确认致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失由资产管理人承担。资产托管人正确执行资产管理人发送的有效指令,委托财产发生损失的,资产托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内,因资产托管人过错造成未能及时或正确执行合法合规的指令而导致委托财产受损的,资产托管人应承担相应的责任,但如遇到不</p> | <p>“(九) 相关责任</p> <p>对于因银行托管账户没有充足资金致使资产管理人向资产托管人发出的指令未能及时清算所造成的损失,由资产管理人承担。因资产管理人原因造成的指令发送不及时、指令发送错误、未能留出足够执行时间、未能及时与资产托管人进行指令确认、未提供符合资产托管人要求的指令附件等致使资金未能及时清算或交易失败所造成的损失由资产管理人承担。资产托管人正确执行资产管理人发送的有效指令,委托财产发生损失的,资产托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内,因资产托管人故意或重大过失造成未能及时或正确执行合法</p> |

| | | |
|--------------------------------|---|--|
| | <p>可抗力的情况除外。</p> <p>资产托管人根据本协议相关规定履行印鉴和签名的表面一致性形式审核职责，如果资产管理人的指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能及时提供授权通知等情形，资产托管人不承担因执行有关指令或拒绝执行有关指令而给资产管理人或基金资产或任何第三方带来的损失，全部责任由资产管理人承担，但资产托管人未按合同约定尽形式审核义务执行指令而造成损失的情形除外。”</p> | <p>合规的有效指令而导致资产管理计划财产受损的，资产托管人应承担相应的责任，但如遇到不可抗力情况除外。</p> <p>资产托管人根据本合同相关规定履行印鉴和签名的表面一致性形式审核职责，如果资产管理人的指令存在事实上未经授权、越权、欺诈、伪造、变造或未能及时提供授权通知书等情形，资产托管人不承担因执行有关指令或拒绝执行有关指令而给资产管理人或委托财产或任何第三方带来的损失，相关责任由资产管理人承担，但资产托管人未按本合同约定尽形式审核义务执行指令而造成损失的情形除外。”</p> |
| <p>十九、越权交易</p> | <p>“(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>根据有关法律法规规定、本合同约定，托管人应对涉及本计划资产的投资范围、投资比例、投资限制、本计划资产的核算、资产净值的计算、托管费和其他相关费用的计提和支付、计划收益分配及计划清算等事项进行监督和核查。具体投资监督事项，见附件《投资监督事项表》。”</p> | <p>“(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>根据有关法律法规规定、本合同约定，托管人应对涉及本计划资产的投资范围、投资比例、投资限制、本计划资产的核算、资产净值的计算、托管费和其他相关费用的计提和支付、计划收益分配及计划清算等事项进行监督和核查。具体投资监督事项，见附件《投资监督事项表》。</p> <p>资产托管人发现资产管理人可能存在违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定，但难以明确界定时，应立即通知资产管理人，通知管理人即视为托管人已经完全履行了监督和托管职责。”</p> |
| <p>二十一、资产管理计划的费用与税收</p> | <p>“(二) 费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>3、管理人的业绩报酬</p> <p>(2) 业绩报酬的提取原则</p> <p>a) 采用单个投资者单笔投资年化收益差额法，委托人不同时间多次追加的，对计划份额持有人每笔追加份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p>b) 本计划的业绩报酬计提日为委托人赎回日、收益分配日、计划终止日和每个运作周期的期末（即每年12月15日，如遇非交易日顺延至下一交易日）。当计划份额持有人每笔所持份额或赎回份额在持有期的年化收益率大于浮动业绩报酬计提基准Y%时，分别计算每笔份额在上一业报计提日至本次计提日持有期间的年化收益率（r），对超出浮动业绩报酬计提基准Y%的持有期差额收益按比例进行计提。计提频率不得超过</p> | <p>“(二) 费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>3、管理人的业绩报酬</p> <p>(2) 业绩报酬的提取原则</p> <p>a) 采用单个投资者单笔投资年化收益差额法，委托人不同时间多次追加的，对计划份额持有人每笔追加份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p>b) 本计划的业绩报酬计提日为委托人赎回日、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赎回份额在持有期的年化收益率大于浮动业绩报酬计提基准Y%时，分别计算每笔份额在上一业报计提日至本次计提日持有期间的年化收益率（r），对超出浮动业绩报酬计提基准Y%的持有期差额收益按比例进行计提。计提频率不得超过每6个月一次，因投资者赎回、计划终止，不受前述提取频率的限制。</p> |

每6个月一次，因投资者赎回、计划终止，不受前述提取频率的限制。

c) 在赎回、收益分配、计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金、拟分配收益和清算资产中扣除。**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，如固定提取时点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。**

d) 在计划份额持有人申请赎回时计算业绩报酬的，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提取顺序，计算赎回份额对应的业绩报酬。

(2) 业绩报酬提取的方法

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单位累计净值**或本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）的份额单位累计净值；

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运作周期期末的天数**；

.....

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

c) 在赎回、收益分配、计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金、拟分配收益和清算资产中扣除。

d) 在计划份额持有人申请赎回时计算业绩报酬的，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提取顺序，计算赎回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单位累计净值；

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；

.....

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。”

| | | |
|--------------------|---|--|
| | <p>益为负或者为零，则业绩报酬为零。</p> <p>$\Delta S_{ij} = R / NAV$</p> <p>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；</p> <p>NAV: 本次业绩报酬计提日计划份额单位净值。</p> <p>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。</p> <p>(3) 业绩报酬的支付</p> <p>上述业绩报酬在份额赎回、收益分配、合同约定的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，托管人不承担复核职责。”</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>(3) 年度报告</p> <p>.....</p> <p>10) 中国证监会规定的其他事项。</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方式通知管理人。</p> <p>(3) 管理人网站</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>(3) 年度报告</p> <p>.....</p> <p>10) 中国证监会规定的其他事项。</p> <p>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。</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) 电子邮件或短信（次选）</p> <p>如资产委托人留有电子邮箱或手机号等联系方式，管理人可通过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>……</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>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>……</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、通过第三方基金销售机构投资开放式基金的风险</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</p> | <p>本资产管理计划可通过第三方基金销售机构投资开放式基金，资产管理人负责选择销售机构，并应确保在销售机构预留的备案回款账户为银行托管账户。资产托管人对于通过第三方基金销售机构投资开放式基金不承担任何风险。</p> <p>由于通过第三方销售平台购买，可能会存在认（申）购、赎回（现金分红）基金时资金被挪用的风险；第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资人持有基金份额不准确的风险；认（申）购款未能用于购买指定基金的风险；以及第三方基金销售平台无基金销售资质的风险。</p> <p>10、浮动业绩报酬计提基准调整的风险</p> <p>本计划的浮动业绩报酬计提基准为每运作周期调整一次，管理人有权根据市场情况及集合计划运作情况，浮动调整。委托人可能面临业绩报酬计提基准调整的风险。同时，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>11、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、代销机构信披渠道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信披渠道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</p> |
|--|--|---|

| | | |
|-----------------|---|--|
| | <p>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>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</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</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>合同的变更、终止与财产清算</p> | <p>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>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。</p> <p>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。</p> <p>(六) 资产管理计划的清算</p> <p>2、清算程序</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>.....</p> <p>(五) 资产管理合同终止的情形包括下列事项:</p> <p>.....</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(六) 资产管理计划的清算</p> <p>2、清算程序</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 《海通期货-灵曜1号固收增强集合资产管理计划管理合同》投资监督事项表</p> | <p>“一 投资范围</p> <p>权益类: 证券交易所上市的股票(含网上和网下新股申购)、股票型公募基金;</p> <p>固定收益类: 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、债券回购、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</p> | <p>“一 投资范围</p> <p>权益类: 证券交易所上市的股票(含网上和网下新股申购)、股票型公募基金;</p> <p>固定收益类: 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、债券回购、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</p> |

市的期货和期权品种。

其他：契约式私募证券投资基金、基金公司及其子公司资产管理计划（非标除外）、证券公司及其子公司资产管理计划（非标除外）、期货公司及其子公司资产管理计划、其他类别的公募基金等。

二 投资比例、投资限制

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 140%。

3、投资于信用债券或资产支持证券，债项或主体评级需在 AAA 级（含）以上（中债资信评级除外）；

4、信用债投资组合久期不超过 5 年；

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%。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；”

期货和期权品种。

其他：契约式私募证券投资基金、基金公司及其子公司资产管理计划（非标除外）、证券公司及其子公司资产管理计划（非标除外）、期货公司及其子公司资产管理计划、其他类别的公募基金等。……

二 投资比例、投资限制

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 140%。

3、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。

4、投资于信用债券或资产支持证券，债项或主体评级需在 AAA 级（含）以上（中债资信评级除外）；

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%。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；”

