

**创元周周开 2 号集合资产管理计划资产管理合同  
因法律法规变动而变更并启用新版合同的公告**

创元期货股份有限公司作为管理人发行并管理的创元周周开 2 号集合资产管理计划，因《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（2018 年 10 月 22 日证监会令第 151 号公布，2023 年 1 月 12 日证监会令第 203 号修订）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（2018 年 10 月 22 日证监会公告（2018）31 号公布，2023 年 1 月 12 日证监会公告（2023）2 号修订）的相关条款修订，为保证产品合法合规运作，根据相关法律法规及《创元周周开 2 号集合资产管理计划资产管理合同》“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”项下第（一）条约约定的相关规定，经托管人同意，以公告方式对创元周周开 2 号集合资产管理计划资产管理合同部分条款进行修改，并启用《创元周周开 2 号集合资产管理计划资产管理合同（第三版）》新版合同。

创元周周开 2 号集合资产管理计划设置临时开放日为 2024 年 1 月 9 日，资产委托人不同意变更的，应在 2024 年 1 月 9 日及之前的开放日赎回全部份额并退出本计划，管理人不得拒绝该次赎回申请；资产委托人未在 2024 年 1 月 9 日及之前的固定开放日赎回全部份额退出本计划的，视为资产委托人默认同意本次变更及启用《创元周周开 2 号集合资产管理计划资产管理合同（第三版）》新版合同。

本次变更将于 2023 年 1 月 10 日生效。《创元周周开 2 号集合资产管理计划资产管理合同（第三版）》新版合同的具体启用时间将以公告方式另行告知投资者。

具体变更内容如下：

章节	变更前	变更后
合同全文	委托财产	受托财产
合同全文	委托资产	受托资产
合同《创元周周开 2 号集合资产管理计划资产管理业务风险揭示书》第二条第（二）款第 8 项	<b>8、关联交易风险</b> 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。	<b>8、关联交易风险</b> 本计划可投资于由管理人、托管人或其关联方管理的产品或者与管理人、托管人或其关联方进行交易，这构成管理人与本计划的关联交易，单笔交易金额超过人民币 2000 万元且占该资产管理计划资产净值 25%以上（不含本数）的交易构成重大关联交易，存在重大利益冲突、严重损害委托人合法权益的情形；重大关联交易以外的其他关联交易构成一般关联交易，存在一般利益冲突、损害委托人合法权益的情形。 虽然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。但该等交易仍构成重大关联交易或一般关联交易，可能存在重大利益冲突风险或一般利益冲突风险



<p>合同 《创元周周开2号集合资产管理计划资产管理业务风险揭示书》第二条第(二)款第12项</p>	<p>(5) 您应特别关注投资期货类品种具有的特有特定风险,包括但不限于因保证金交易方式可能导致投资损失大于计划资产价值的风险,因市场流动性不足、交易所暂停某合约的交易、修改交易规则或采取紧急措施等原因,导致未平仓合约可能无法平仓或现有持仓无法继续持有的风险。</p> <p>(9) 您应当知晓期货公司既往的资产管理业绩并不预示其未来表现,不构成对计划资产可能收益的承诺或暗示。</p> <p>(11) 您必须了解如您提供的信息发生重要变化、可能影响您的投资者分类的,应当及时书面告知期货公司;因您未及时将信息变化情况书面告知期货经营机构,导致经营机构对您的投资者适当性管理不准确的,您需承担相应责任。</p> <p>(12) 您必须了解期货公司履行投资者适当性职责不能取代您的投资判断,不会降低您参与资产管理业务的固有风险,也不会降低您应当承担的投资风险、履约责任以及费用。</p>	<p>(5) 您应特别关注投资期货类品种(如有)具有的特有特定风险,包括但不限于因保证金交易方式可能导致投资损失大于计划资产价值的风险,因市场流动性不足、交易所暂停某合约的交易、修改交易规则或采取紧急措施等原因,导致未平仓合约可能无法平仓或现有持仓无法继续持有的风险。</p> <p>(9) 您应当知晓资产管理人既往的资产管理业绩并不预示其未来表现,不构成对计划资产可能收益的承诺或暗示。</p> <p>(11) 您必须了解如您提供的信息发生重要变化、可能影响您的投资者分类的,应当及时书面告知资产管理人及销售机构;因您未及时将信息变化情况书面告知资产管理人及销售机构,导致其对您的投资者适当性管理不准确的,您需承担相应责任。</p> <p>(12) 您必须了解资产管理人及销售机构履行投资者适当性职责不能取代您的投资判断,不会降低您参与资产管理业务的固有风险,也不会降低您应当承担的投资风险、履约责任以及费用。</p>
<p>合同 《资产合法性及投资者适当性承诺书》</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>(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>(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>(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>合同正文第一节前言</p>	<p>鉴于前期本计划份额持有人、管理人、托管人已签订了《创元周周开2号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“原合同”）、《创元周周开2号集合资产管理计划资产管理合同补充协议（一）》（以下简称“原补充协议”），设立“创元周周开2号集合资产管理计划”。现各方同意合并原合同及原补充协议，形成《创元周周开2号集合资产管理计划资产管理合同（第二版）》（以下简称“本合同”）供签署。</p> <p>本合同的生效不影响其生效之前本计划份额持有人、管理人、托管人依据原合同所享有的各项权利、履行的各项义务、承担的各项职责，本计划份额持有人、管理人、托管人依据原合同的约定所进行的各项行为仍然有效。</p>	<p>删除</p>
<p>合同正文第一节前言第(一)条第2款</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》）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《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）》（以下简称《格式指引》）及其他法律法规的有关规定。</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》）、《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国电子签名法》《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《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）》（以下简称《格式指引》）及其他法律法规的有关规定。</p>
<p>合同正文第一节前言第(二)条</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>(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或报告。</p>
<p>合同正文第四节当事人及权利义务第(一)条第3款第(5)项</p>	<p>(5) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、运营服务费、投资顾问费、审计费、税费等合理费用；</p>	<p>(5) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、运营服务费、审计费、税费等合理费用；</p>
<p>合同正文第四节</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>(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>当事人及权利义务第(二)条第3款第(19)项及第(21)项,并新增第(27)项</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>(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,根据监管要求进行报送;</p> <p>(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;</p>
<p>合同正文第四节当事人及权利义务第(三)条第1款,第3款第(9)项及第(14)项,并新增第(10)项及第(16)项</p>	<p>1、资产托管人概况  名称:华泰证券股份有限公司  住所:南京市江东中路228号  法定代表人:张伟  联系人:尹鹏  联系电话:025-83387210  传真:025-83387215  网址:www.htsc.com</p> <p>(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。</p> <p>(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,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;</p>	<p>1、资产托管人概况  名称:华泰证券股份有限公司  住所:南京市江东中路228号  法定代表人:张伟  联系人:李欣然  联系电话:025-83387210  传真:025-83387215  网址:www.htsc.com</p> <p>(9) 编制托管年度报告,并报送中国证监会相关派出机构。</p> <p>(10) 建立与管理人的对账机制,复核、审查管理人计算的资产管理计划资产净值和资产管理计划参与、退出价格。</p> <p>(15) 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,通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构;</p> <p>(16) 投资于《管理办法》第三十八条第(五)项规定的非标准化资产时(如有),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;</p>
<p>合同正文第七节资产管理计划的成立与备案第(二)条</p>	<p>(二) 资产管理计划的备案与成立</p> <p>1、本计划募集期限届满后,将全部募集资金划入托管账户。资产管理人应当自募集金额缴足之日起10个工作日内,委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告,资产管理人应在取得验资报告后及时公告资产管理计划成立。管理人以邮件形式向托管人发送《起始运作通知书》,本计划成立日即为起始运作日。资产托管人自计划成立日开始履行托管职责。</p>	<p>(二) 资产管理计划的成立与备案</p> <p>1、本计划募集期限届满后,将全部募集资金划入托管账户。资产管理人应当自募集金额缴足之日起10个工作日内,委托符合《证券法》规定会计师事务所进行验资并出具验资报告,资产管理人应在取得验资报告后及时公告资产管理计划成立。管理人以邮件形式向托管人发送《起始运作通知书》,本计划成立日即为起始运作日。资产托管人自计划成立日开始履行托管职责。</p>
<p>合同正文第八节</p>	<p>(十五) 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</p>	<p>(十五) 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</p>



<p>资产管理计划的参与、退出和转让第（十五）条</p>	<p>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计划的份额合计不得超过该计划总份额的50%。因本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>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>退出的条件</p> <p>1、自有资金参与的条件和方式:资产管理人以自有资金参与本计划，应符合《管理办法》《运作规定》和中国证监会及基金业协会的相关规定。</p> <p>2、自有资金的参与比例：证券期货经营机构及其子公司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%。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>3、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划的，持有期限不得少于6个月。证券期货经营机构及其子公司自有资金在募集期间认购集合资产管理计划的，投资者和托管人在此同意并授权管理人可以以自有资金参与本集合计划。管理人自有资金存续期参与、退出集合资产管理计划的，应当提前5个工作日通过合同约定的信息披露方式通知全体投资者和托管人，征得全体投资者和托管人同意，并设置临时开放日供不同意的投资者退出，未退出的投资者视为同意本次自有资金的参与或退出安排。</p> <p>4、为应对本计划巨额退出以解决流动性风险，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其后续退出本计划可不受上述第2、3款规定的限制，但应当及时告知投资者和资产托管人，并按监管要求报告相关机构。</p> <p>5、因本计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划比例被动超标的处理原则及处理措施：管理人可以临时开放退出自有资金，具体退出份额以管理人决定为准，豁免“持有期限不少于6个月”和“提前5个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意”的规定。管理人应及时通过合同约定的信息披露方式通知全体投资者和托管人自有资金参与被动超限情况。</p> <p>6、自有资金的收益分配：资产管理人自有资金参与的份额按照本合同的规定享有收益分配，并承担相应责任。</p>
<p>合同正文第十一节资产管理计划的投资第（四）条</p>	<p>（四）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、</p>	<p>（四）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</p>



	<p>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>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>合同正文第十一节资产管理计划的投资第（七）条</p>	<p>新增</p>	<p>2、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本计划净资产 50%的，本计划的总资产不得超过本计划净资产的 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。如对本计划的发行人及其关联方的界定有歧义的，管理人和托管人应当协商确认口径，如未达成一致则以管理人监控口径为准。</p>
<p>正文第十四节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，应当遵循资产委托人利益优先原则，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。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。</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>（二）本计划存在利益冲突的信息披露</p> <p>1、披露方式</p>	<p>（一）本资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形</p> <p>1、本资产管理计划可能投资于管理人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者在承销期内承销的证券；</p> <p>2、本资产管理计划可能投资于托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者在承销期内承销的证券；</p> <p>3、本资产管理计划可能投资于管理人、托管人及其关联方或者与上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、或者从事其他重大关联交易的；</p> <p>4、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，存在利益冲突风险；</p> <p>5、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>（二）资管计划的关联方范围</p> <p>本资产管理计划的关联方包括资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人以及法律法规认定的其他关联方，具体以法律法规或监管要求为准。</p> <p>（三）利益冲突和关联交易处理方式</p> <p>委托人在此对上述列举的存在的或可能存在的利益冲突情形、关联方等内容表示知悉，其中，涉及</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(www.cyqh.com.cn)、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

发生关联交易时,资产管理人应当按照资产管理合同的约定在资产管理计划年度报告和季度报告中予以披露,同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。

(三)资产管理人运用本计划财产从事关联交易的,事后及时、全面、客观的向资产委托人和资产托管人进行披露。资产管理人运用本计划财产从事重大关联交易的,应事先取得资产委托人同意,并有充分证据证明未损害资产委托人利益。

投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意本计划将进行上述关联交易。

投资者不得因本计划投资收益劣于资产管理人及其关联方管理的其他类似投资产品,而向资产管理人或资产托管人提出任何损失或损害赔偿的要求。

关联交易的,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资产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,但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与。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、客观的向委托人和托管人进行披露。管理人应通过管理人网站或者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。

管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的,应事先采取逐笔征求意见取得委托人同意,并有充分证据证明未损害委托人利益,事后及时、全面、客观的向委托人和托管人进行披露。管理人应通过管理人网站或者本合同约定一种或多种联系方式,在事项发生之日起五日内告知委托人和托管人,并按照资产管理合同的约定在资产管理计划年度报告和季度报告中予以披露。

其中一般关联交易与重大关联交易的认定标准如下:

1、管理人的资管计划受托管理关联方的资产,包括但不限于:

(1)管理人董事、监事、从业人员(含高级管理人员)及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与管理人设立的资产管理计划;

(2)管理人以自有资金参与管理人设立的集合资产管理计划。

2、管理人的资管计划投资于关联方发行的证券或者承销期内承销的证券或资产管理计划。

3、根据实质重于形式原则认定的其他应当属于关联交易的情形。

以上情形中,与关联方开展的单笔交易金额超过人民币 2000 万元且占该资产管理计划资产净值 25%以上(不含本数)的第 2、3 类交易属于重大关联交易;其他交易属于一般关联交易。

上述标准如因法律法规或监管机构要求发生变化或与法律法规、监管要求不一致的,以法律法规规定及监管机构的最新要求为准。

### (四) 资管计划的关联交易审批与内控机制

以资管计划的资产从事关联交易的,由管理人根据《创元期货股份有限公司资产管理业务关联交易管理制度》规定进行操作。

#### 1、关联交易审批机制

一般关联交易和重大关联交易的交易定价方



法、审批程序等行为由管理人资产管理总部负责管理，具体审批机制如下：

(1) 交易定价方法：参照市场市价确定公允价值。行业通行的估值方法如无市价，最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，根据最近交易价格确定公允价值。如估值日无市价，但最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易价格或参照第三方最近估价确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

#### (2) 重大关联交易的审批程序

1) 管理人资产管理总部就该重大关联交易提交专项报告，报告内容包括但不限于：关联方基本情况、交易类型、交易金额及标的、交易价格及定价方式、关联方在交易中所占权益的性质及比重等。

2) 管理人资管业务投资决策工作小组在审议重大关联交易事项时，应当对关联交易的出发点、公平性、是否存在对其他委托人的不利影响等进行审查和判断，特别关注交易定价依据，包括估值的公允性、交易标的成交价格是否公平等情况。

3) 重大关联交易须经管理人资管业务投资决策工作小组全体成员表决通过。

#### (3) 一般关联交易的审批程序

1) 管理人资管业务投资决策工作小组授权管理人资产管理总部投资决策工作小组审批一般关联交易。

2) 管理人资产管理总部投资决策工作小组就一般关联交易的可行性作出决策。

#### 2. 关联交易内控机制

管理人制定有《创元期货股份有限公司资产管理业务关联交易管理制度》，主要涉及资产管理计划在期货交易所、证券交易所、银行间市场等各类交易场所的交易行为及对其他交易行为的关联交易监控处理。

《创元期货股份有限公司资产管理业务关联交易管理制度》规定资产管理计划存在或可能存在的利益冲突情形包括：“（一）资产管理计划可能投资于资产管理人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者在承销期内承销的证券；（二）资产管理计划可能投资于资产管理人及其关联方发行的其他金融产品；（三）资产管理计划



可能投资于资产托管人或投资顾问及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等关联方发行的证券或承销期内承销的证券、直接或间接管理的、或者该等主体持有的符合资产管理计划合同投资范围规定的投资产品、或者从事其他重大关联交易的；（四）资产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，存在利益冲突风险；（五）其他依据法律法规、监管规定可能存在利益冲突的情形。”详见本章节第（一）条约定。

《创元期货股份有限公司资产管理业务关联交易管理制度》规定管理人“董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与管理人设立的资产管理计划，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。”

《创元期货股份有限公司资产管理业务关联交易管理制度》规定管理人“应公平对待所管理的不同资产和投资组合，包括但不限于在认购申购、投资研究、投资决策、交易执行各环节应得到公平对待。管理人不得有利益输送行为，包括但不限于不公平对待客户、不同资产管理计划混合运作、在不同的资产管理计划账户之间转移收益或亏损的等情形。”

《创元期货股份有限公司资产管理业务关联交易管理制度》规定管理人“应建立健全关联交易管理制度，对关联交易认定标准、交易定价方法、交易审批程序进行规范，不得以资产管理计划的资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。管理人不得以资产管理产品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或者其他不当、违法的证券期货业务活动，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。管理人不得利用资产管理计划，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，违规为管理人及控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；不得为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利。管理人资产管理总部交易人员、风控人员应通过事中盯盘、事后分析的形式对资产管理业务进行风险监控，对资产管理账户日常交易情况发现关联交易的要及时记录，并对上述资产管理账户进行重点监控。”

《创元期货股份有限公司资产管理业务关联交易管理制度》规定关联交易的信息披露方式包括：  
“（一）一般关联交易：可以通过在资产管理合同中



函授同意的方式取得委托人的同意,无需就具体的一般关联交易分别取得委托人的个别授权;(二)重大关联交易:应事先采取逐笔征求意见取得委托人同意,并有充分证据证明未损害委托人利益,事后及时、全面、客观的向委托人和资产托管人进行披露。详见本章节第(三)条和第(五)条约定。”

管理人通过《创元期货股份有限公司资产管理业务关联交易管理制度》,建立有完善的关联交易审批和内控机制。同时,其他未尽事项应按照相关法律法规、监管机构规定和管理人《公司章程》等有关规章及制度执行。通过关联交易审批与内控机制,管理人确保资产管理计划关联交易进行严格的管控,符合法律法规和监管规定要求。

#### (五) 关联交易的信息披露

管理人有义务将可能涉及到关联交易的“管理人关联方名单”在管理人网站、全国中小企业股份转让系统信息披露平台([www.neeq.com.cn](http://www.neeq.com.cn))等公开途径披露;托管人的关联方名单以华泰证券行知·托管外包平台 <https://inst.htsc.com/incos/user/login> 公示信息为准,委托人可登录上述网址进行查询。

特别提示:投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意上述关联交易的相关内容、同意本资产管理计划可进行上述关联交易。

资产委托人知晓并同意本计划的投资对象可能包括资产管理人管理的资产管理计划或者与资产管理人、资产托管人、资产委托人或其关联方进行交易。本计划销售机构可能包含资产管理人的关联方,本计划可能聘请资产管理人、资产托管人或其关联方为本计划经纪机构。虽然管理人积极遵循委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定操作、积极防范利益冲突,但依然不能避免未来可能发生的关联交易风险,进而影响收益甚至发生亏损。投资者签署本合同即代表明确知悉且自愿承担该类风险。提醒投资者务必注意关联交易及利益冲突风险,在充分考量的基础上,审慎参与本计划。

合同正文第十八节越权交易第(二)条第1款

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

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。



	<p>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>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>合同正文第十八节越权交易第(三)条第1款第(3)项</p>	<p>新增。</p>	<p>2) 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本计划净资产 50%的，本计划的总资产不得超过本计划净资产的 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。如对本计划的发行人及其关联方的界定有歧义的，管理人和托管人应当协商确认口径，如未达成一致则以管理人监控口径为准；</p>
<p>合同正文第十九节第(一)条第13款</p>	<p>管理人 - 估值信息来往邮箱： liuhq@cyqh.com.cn, liuhl@cyqh.com.cn</p>	<p>管理人 - 估值信息来往邮箱： gaoxd@cyqh.com.cn</p>
<p>合同正文第二十章资产管理计划的费用与税收第(一)条第5款</p>	<p>5、投资顾问费(如有)</p>	<p>删除。</p>
<p>合同正文第二十章资产管理计划的费用与税收第(二)条第5款</p>	<p>5、投资顾问费 本计划不聘请投资顾问。</p>	<p>删除。</p>
<p>合同正文第二十二章信息披露</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</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>露与报告第 (一)条第 1款第(2) 项第二自然 段</p>	<p>净值计算等出具意见。</p>	
<p>合同 正文第二十 二节信息披 露与报告第 (三)条</p>	<p>(四) 向监管机构提供的报告            资产管理人、资产托管人应当根据法律法            规、中国证监会和证券投资基金业协会的要求            履行报告义务。            1、资产管理人应按照《指导意见》的规            定，向中国人民银行报送本计划信息，并接受            中国人民银行对本计划统计工作的监督检查。            2、资产管理人向资产委托人提供的信息            披露文件，应当及时报送中国证监会相关派出            机构、证券投资基金业协会。            3、资产管理人应当将其按照《管理办法》            规定报送的本计划信息抄报期货市场监控中            心。            4、资产托管人应按照法律法规及本合同            约定及时向中国证监会相关派出机构、证券投            资基金业协会提交相关报告。</p>	<p>(四) 向监管机构提供的报告            资产管理人、资产托管人应当根据法律法规、            中国证监会和证券投资基金业协会的要求履行报告            义务。            1、资产管理人应按照《指导意见》的规定，向            中国人民银行报送本计划信息，并接受中国人民            银行对本计划统计工作的监督检查。            2、资产管理人应当将其按照《管理办法》规定            报送的本计划信息抄报期货市场监控中心。            3、资产托管人应按照法律法规及本合同约定及            时向中国证监会相关派出机构、证券投资基金协            会提交相关报告。</p>
<p>合同 正文第二十 三节风险揭 示第二条第 8款</p>	<p>8、关联交易的风险            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>8、本计划可投资于由管理人、托管人或其            关联方管理的产品或者与管理人、托管人或            其关联方进行交易，这构成管理人与本计划            的关联交易，单笔交易金额超过人民币 2000            万元且占该资产管理计划资产净值 25%以            上(不含本数)的交易构成重大关联交易，            存在重大利益冲突、严重损害委托人合法            权益的情形；重大关联交易以外的其他关联            交易构成一般关联交易，存在一般利益冲            突、损害委托人合法权益的情形。            虽然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            该等交易仍构成重大关联交易或一般关联            交易，可能存在重大利益冲突风险或一般            利益冲突风险。</p>
<p>合同 正文第二十 四节资产管 理合同的变 更、终止与 财产清算第 (二)条第 2款第二自 然段第(1)</p>	<p>(1) 调低参与退出费率、管理费率、投            资顾问费率、咨询服务费率、业绩报酬计            提比例；</p>	<p>(1) 调低参与退出费率、管理费率、咨询服            务费率、业绩报酬计提比例；</p>



项		
合同正文第二十四节资产管理合同的变更、终止与财产清算第(四)条	(四) 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。	(四) 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。
合同正文第二十四节资产管理合同的变更、终止与财产清算第(六)条	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。	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。
合同正文第二十四节资产管理合同的变更、终止与财产清算第(七)条第2款第6)项	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。	6) 将清算报告报证券投资基金业协会、中期协备案并披露给资产委托人。
合同正文第二十四节资产管理合同的变更、终止与财产清算第(七)条第4款第二自然段	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。管理人可对此制定二次清算方案, 该方案应经托管人认可, 并披露给计划份额持有人。管理人应根据二次清算方案的规定, 对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算, 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。	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。管理人可对此制定二次清算方案, 该方案应经托管人认可, 并披露给计划份额持有人。管理人应根据二次清算方案的规定, 对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算, 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。