

# 海通期货海辰 1 号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（一）

尊敬的委托人、托管人，

因投资管理需要，由我司担任管理人的“海通期货海辰 1 号集合资产管理计划”拟对以下内容进行变更：

将“资产管理计划的投资”中

“（十）资产管理计划的预警与止损

为保护资产委托人的利益，本计划将管理人估算的计划份额净值（未经管理人与托管人核对一致，下同）0.8500 元设置为预警线，将管理人估算的计划份额净值 0.8000 元设置为止损线。

当管理人估算的计划份额净值低于或等于预警线 0.8500 元时，管理人应主动对本计划所持有的投资标的采取以下风险控制措施：若 T 日收盘后经管理人估算的计划份额净值低于或等于预警线 0.8500 元，无论 T+1 日及之后的本计划份额净值是否高于预警线，管理人须于 T+2 日（含）前以邮件、短信或者合同约定的其他方式向本计划份额持有人发出预警通知，通过代销机构购买本计划的委托人，管理人将预警通知发送给代销机构，由代销机构向委托人披露。

当管理人估算的计划份额净值低于或等于止损线 0.8000 元时，无论 T+1 日及之后的本计划份额净值是否高于 0.8000 元，管理人于两个工作日内开始止损操作，逐步将持仓的投资标的卖出，在十个工作日内将持仓的投资标的平仓变现。该平仓操作不可逆，在所持全部非现金类资产变现前不可停止。对于已变现部分，根据本合同清算程序对计划进行清算。如遇因持有流通受限证券等原因导致本计划财产无法及时变现的，则变现时间顺延，待全部变现完成之日，管理人进行二次清算。

本计划的预警、止损线为管理人估算的计划份额净值（未经托管人复核），由资产管理人自行负责监控并执行。即使管理人和托管人复核一致的计划份额净值高于管理人估算的计划份额净值，管理人仍将按照其估算的计划份额净值作为执行预警止损机制的依据；

但如经托管人复核后的计划份额净值低于预警线/止损线，管理人也应当按照合同约定进行预警或止损。管理人未按照本合同的约定进行预警止损操作，给计划财产或委托人造成损失的，由管理人自行承担责任。



资产管理人特别提示：本计划设置 **0.8000** 元为止损线，并不代表资产管理人完成止损后计划份额净值等于 **0.8000** 元，根据资产管理人变现操作的交易执行情况，本计划终止日计划份额净值可能低于 **0.8000** 元。”

#### 修改为

##### “（十）资产管理计划的预警与止损

为保护资产委托人的利益，本计划将管理人估算的计划份额净值（未经管理人与托管人核对一致，下同）0.7000元设置为预警线，将管理人估算的计划份额净值 0.6000元设置为止损线。

当管理人估算的计划份额净值低于或等于预警线 0.7000元时，管理人应主动对本计划所持有的投资标的采取以下风险控制措施：若 T 日收盘后经管理人估算的计划份额净值低于或等于预警线 0.7000元，无论 T+1 日及之后的本计划份额净值是否高于预警线，管理人须于 T+2 日（含）前以邮件、短信或者合同约定的其他方式向本计划份额持有人发出预警通知，通过代销机构购买本计划的委托人，管理人将预警通知发送给代销机构，由代销机构向委托人披露。

当管理人估算的计划份额净值低于或等于止损线 0.6000元时，无论 T+1 日及之后的本计划份额净值是否高于 0.6000元，管理人于两个工作日内开始止损操作，逐步将持仓的投资标的卖出，在十个工作日内将持仓的投资标的平仓变现。该平仓操作不可逆，在所持全部非现金类资产变现前不可停止。对于已变现部分，根据本合同清算程序对计划进行清算。如遇因持有流通受限证券等原因导致本计划财产无法及时变现的，则变现时间顺延，待全部变现完成之日，管理人进行二次清算。

本计划的预警、止损线为管理人估算的计划份额净值（未经托管人复核），由资产管理人自行负责监控并执行。即使管理人和托管人复核一致的计划份额净值高于管理人估算的计划份额净值，管理人仍将按照其估算的计划份额净值作为执行预警止损机制的依据；

但如经托管人复核后的计划份额净值低于预警线/止损线，管理人也应当按照合同约定进行预警或止损。管理人未按照本合同的约定进行预警止损操作，给计划财产或委托人造成损失的，由管理人自行承担责任。

资产管理人特别提示：本计划设置 **0.6000** 元为止损线，并不代表资产管理人完成止损后计划份额净值等于 **0.6000** 元，根据资产管理人变现操作的交易执行情况，本计划终止日计划份额净值可能低于 **0.6000** 元。”

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”约定，“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）。征询意见函（或书面通知）的变更事项自上述临时开放日后管理人指定的生效之日起生效，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 23 日给予不同意变更的委托人退出。本次变更事项自 2024 年 1 月 24 日（含）开始生效。

特此公告。



1911

