

海通期货-步步盈高收益债 1 号集合资产管理计划资产管理合同

变更征询意见函

尊敬的委托人：

由我司担任管理人的“海通期货-步步盈高收益债 1 号集合资产管理计划”拟降低业绩报酬计提基准，现需对《海通期货-步步盈高收益债 1 号集合资产管理计划资产管理合同（2023 年 11 月修订版）》（以下简称《资产管理合同》）的部分内容进行修订及变更。

一、变更内容

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

a) 采用单个投资者单笔投资年化收益差额法，对计划份额持有人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

b) 本计划的业绩报酬计提日为退出日、收益分配日以及计划终止日，如遇非工作日顺延。当计划份额持有人每笔所持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，因投资者退出或计划终止的情形，不受前述提取频率的限制。

.....

（2）业绩报酬提取的方法

业绩报酬（ R ）的计提方法：

如果 $r \leq \underline{7\%}$ ，则 $R = 0$

如果 $\underline{7\%} < r$ ，则 $R = F \times C \times (r - \underline{7\%}) \times 30\% \times T/365$ ”

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

a) 采用单个投资者单笔投资年化收益差额法，对计划份额持有人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

b) 本计划的业绩报酬计提日为退出日、收益分配日以及计划终止日，如遇非工作日顺

延。当计划份额持有人每笔所持份额在持有期的年化收益率大于 5% 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 5% 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，因投资者退出或计划终止的情形，不受前述提取频率的限制。

.....

（2）业绩报酬提取的方法

业绩报酬（ R ）的计提方法：

如果 $r \leq \underline{5\%}$ ，则 $R = 0$

如果 $\underline{5\%} < r$ ，则 $R = F \times C \times (r - \underline{5\%}) \times 30\% \times T/365$ ”

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，现向全体委托人征询意见：

如您不同意本次变更，请务必在临时开放日 2024 年 7 月 12 日当日退出本计划（本次退出份额不受本合同“资产管理计划的参与、退出”中关于计划退出的期限限制）；如您未在 2024 年 7 月 12 日当日退出本计划的，视为您同意此次变更。变更事项自临时开放日的次工作日即 2024 年 7 月 15 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-步步盈高收益债1号集合资产管理计划资产管理合同（2024年6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-步步盈高收益债1号集合资产管理计划资产管理合同（2024年6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。

如您未在临时开放期内退出本计划即代表您同意以上变更内容，请您关注自身权益，防范风险。

