

海通期货利达 1 号集合资产管理计划资产管理合同（2025 年 3 月修订版）

变更征询意见函

尊敬的委托人：

由我司担任管理人的“海通期货利达 1 号集合资产管理计划”因产品投资运作需要，现需对《海通期货利达 1 号集合资产管理计划资产管理合同（2025 年 3 月修订版）》（以下简称《资产管理合同》）的部分内容进行变更：

一、本次变更内容

1、将《资产管理合同》“五、资产管理计划基本情况”中“（六）投资比例及限制”的以下表述：

“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 160%。

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（可转换债券、可交换债券除外），债项或主体评级或担保人评级需在 AA 级（含）以上（若有多个评级机构进行评级的，以届时最新评级为准，中债资信评级除外。若持有债券期间发生债券评级下调或重大舆情，由管理人依据市场情况、发行人情况等综合评估后择机进行调整）。

5、信用债逆回购质押标的的主体评级或债项评级不低于 AA 级（债券评级剔除中债资信评级）。

6、按照所在交易场所估值计算，逆回购质押标的的债项 AAA（含）不超过 9.5 折质押，债项 AA+（含）不超过 8.5 折质押，债项 AA（含）不超过 8 折质押。

7、经中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人及其备案的私募基金作为交易对手方的，其信用债质押比例不得高于 5 折。

8、所选择的交易对手方若为产品，则该产品杠杆率不得超过 150%。

9、禁止接受正回购方质押发行主体为民营企业的债券。

10、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。

11、期货和衍生品类持仓市值（非轧差）合并计算不超过计划净资产的 1%。

12、参与债券、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。”

修改为：

“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 160%。

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（可转换债券、可交换债券除外），债项或主体评级或担保人评级需在 AA 级（含）以上（若有多个评级机构进行评级的，以届时最新评级为准，中债资信评级除外。若持有债券期间发生债券评级下调或重大舆情，由管理人依据市场情况、发行人情况等综合评估后择机进行调整）。

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。

6、参与债券、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。”

2、将《资产管理合同》“十一、资产管理计划的投资”中“（六）投资比例及限制”的以下表述：

“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 160%。

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（可转换债券、可交换债券除外），债项或主体评级或担保人评级需在 AA 级（含）以上（若有多个评级机构进行评级的，以届时最新评级为准，中债资信评级除外。若持有债券期间发生债券评级下调或重大舆情，由管理人依据市场情况、发行人情况等综合评估后择机进行调整）。

5、信用债逆回购质押标的的主体评级或债项评级不低于 AA 级（债券评级剔除中债资信评级）。

6、按照所在交易所估值计算，逆回购质押标的的债项 AAA（含）不超过 9.5 折质押，债项 AA+（含）不超过 8.5 折质押，债项 AA（含）不超过 8 折质押。

7、经中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人及其备案的私募基金作为交易对手方的，其信用债质押比例不得高于 5 折。

8、所选择的交易对手方若为产品，则该产品杠杆率不得超过 150%。

9、禁止接受正回购方质押发行主体为民营企业的债券。

10、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。

11、期货和衍生品类持仓市值（非轧差）合并计算不超过计划净资产的 1%。

12、参与债券、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。

资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者及托管人同意，并按规定履行合同变更程序。”

修改为：

“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 160%。

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（可转换债券、可交换债券除外），债项或主体评级或担保人评级需在 AA 级（含）以上（若有多个评级机构进行评级的，以届时最新评级为准，中债资信评级除外。若持有债券期间发生债券评级下调或重大舆情，由管理人依据市场情况、发行人情况等综合评估后择机进行调整）。

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。

6、参与债券、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。

资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者及托管人同意，并按规定履行合同变更程序。”

5、将《资产管理合同》“附件一：《海通期货利达 1 号集合资产管理计划管理合同》投资监督事项表”中“投资比例、投资限制”的以下表述：

“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 160%。

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（可转换债券、可交换债券除外），债项或主体评级或担保人评级需在 AA 级（含）以上（若有多个评级机构进行评级的，以届时最新评级为准，中债资信评级除外。若持有债券期间发生债券评级下调或重大舆情，由管理人依据市场情况、发行人情况等综合评估后择机进行调整）。

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%（期货按单合约保证金占用计算）；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。

6、期货和衍生品类持仓市值（非轧差）合并计算不超过计划净资产的 1%。

7、参与债券、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。由于托管人无法获取申报数据，该事项由管理人负责监控。”

修改为：

“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 160%。

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（可转换债券、可交换债券除外），债项或主体评级或担保人评级需在 AA 级（含）以上（若有多个评级机构进行评级的，以届时最新评级为准，中债资信评级除外。若持有债券期间发生债券评级下调或重大舆情，由管理人依据市场情况、发行人情况等综合评估后择机进行调整）。

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%（期货按单合约保证金占用计算）；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。

6、参与债券、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。由于托管人无法获取申报数据，该事项由管理人负责监控。”

6、将《资产管理合同》“二十九、其他事项”添加以下表述：

“（二）针对重大风险事件、投资者重大投诉、信息泄露等突发情况，资产管理人、资产托管人应制定应急处置预案，妥善处置突发情况。

资产管理人、资产托管人应保证在合作期间严格履行各自职责和义务，确保服务连续性。

资产管理人、资产托管人应建立健全信息安全管理机制，保障业务持续和数据安全。

资产委托人、资产管理人、资产托管人应就集合计划财产及相关信息承担保密责任；除法律、法规的规定和本合同另有约定外，不得以任何方式披露或利用该信息。任何一方对于在本合同履行过程中获知的对方数据和信息，未经该方事先书面同意，不得用于本合同外的目的，不得告知非本合同当事方或允许非本合同当事方使用，法律法规另有规定、监管及审计要求或本合同另有约定的除外。”

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 2026 年 / 月 / 3 日当日退出本计划（本次退出份额如持有期限不满 90 天的，管理人免收退出费）；如您未在 2026 年 / 月 / 3 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 2026 年 / 月 / 4 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《海通期货利达 1 号集合资产管理计划资产管理合同（2026 年 1 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《海通期货利达 1 号集合资产管理计划资产管理合同（2026 年 1 月修订版）》。

三、 风险揭示

- 1.因投资运作需求，本计划修改了调整投资限制。请您务必仔细阅读变更后投资限制，确认是否符合您的投资需求。
- 2.请您仔细阅读，注意本次变更涉及的具体条款和内容。如您未在临时开放期内退出本计划即代表您同意本次变更内容，请您关注自身权益，防范风险。

