

海通期货-金澹远洋固收增强 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-金澹远洋固收增强 1 号集合资产管理计划”（以下简称“本产品”或“本计划”）因投资管理需要，现需对《海通期货-金澹远洋固收增强 1 号集合资产管理计划资产管理合同（2024 年 11 月修订版）》（以下简称原《资管合同》）的部分内容进行修订及变更。

一、本次变更主要涉及

- 1、解聘投资顾问，上海金澹资产管理有限公司不再担任本计划投资顾问；
- 2、修改开放规则、投资范围、投资策略、投资比例及限制、预警止损线；
- 3、本计划风险等级由【R4】调整为【R2】，最低参与金额由【30 万】调整为【100 万】（最低持有金额保持【30 万】不变）；
- 4、管理费由【1%】降至【0.4%】，业绩报酬计提基准由【4%】调整为【2.6%】，业绩报酬计提比例由【30%】调整为【60%】；
- 5、变更合同变更方式。

具体变更内容详见附件《海通期货-金澹远洋固收增强 1 号集合资产管理计划资产管理合同（2024 年 11 月修订版）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。”

我司已和托管人就本次变更事项达成一致，现征询委托人意见：

如您不同意本次变更，请务必在临时开放日 2026 年 1 月 26 日当日退出本计划（本次退出份额不受原《资产管理

合同》“资产管理计划的参与、退出和转让”中关于计划退出的期限限制)；如您未在 2026 年 1 月 26 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 1 月 27 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-金澹远洋固收增强 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-金澹远洋固收增强 1 号集合资产管理计划资产管理合同（2026 年 1 月修订版）》。

三、 风险揭示及特别提醒

1、因投资运作需求，海通期货-金澹远洋固收增强 1 号集合资产管理计划调整了投资范围、投资策略、投资比例及限制，请您务必仔细阅读变更后投资相关条款，确认是否符合您的投资需求。

2、因本次变更了业绩报酬计提基准及业绩报酬计提比例，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及业绩报酬计提比例计提业绩报酬，自本次变更生效日（含）起按照变更后的业绩报酬计提基准及业绩报酬计提比例计提业绩报酬。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及业绩报酬计提比例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。

3、本计划降低了业绩报酬计提基准、提高了业绩报酬计提比例，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。

请您仔细阅读《海通期货-金澹远洋固收增强 1 号集合资产管理计划资产管理合同（2024 年 11 月修订版）调整说明》，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。



附：《海通期货-金瀚远洋固收增强1号集合资产管理计划资产管理合同（2024年11月修订版）调整说明》

管理人拟对《资产管理合同》的部分条款进行变更；未列举的文本表述变更请仔细阅读《资产管理合同》。

合同章节	修订前正文	修订后正文
<p>《海通期货-金瀚远洋固收增强1号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</p> <p>（一） 特殊风险揭示</p> <p>……</p> <p>5、资产管理计划份额转让所涉风险</p> <p>本计划委托人可以在监管机构认可的场所按相关规定办理资产管理计划份额转让业务，由于转让价格不公允、系统故障、交易场所规则变化等原因，可能会给投资者带来一定风险。</p> <p>6、参与高收益债风险</p> <p>因本计划可能投资于高收益债券，风险远高于一般债券，可能存在包括但不限于如下风险：</p> <p>（1）由于高收益债投资标的条款较为复杂，债券的流动性较差，即使市场流动性比较好的情况下，也存在着可能不能及时变现的风险。因此一旦本计划遇到变现压力，需要较高成本才能实现。</p> <p>（2）高收益债券资产的信用等级一般较低，存在着发行人不能按时足额还本付息的违约风险。此外，当发行人信用评级降低时，本计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。</p> <p>（3）若本计划所持有单只高收益债券比例过高，一旦该债券出现停牌、暂停上市、到期未偿付等情形而造成债券违约，可能导致投资者本金及收益造成重大损失的风险。</p> <p>（4）在对高收益债券资产的估值中，可能因估值结果与其真实价值的偏离，导致投资者申购赎回本计划份额时本金及收益受到损失的风险。</p> <p>（5）在高收益债券资产出现违约的情况下，管理人代表投资者进行债权追索时，由于追索过程中所需</p>	<p>二、风险揭示</p> <p>（一） 特殊风险揭示</p> <p>……</p> <p>5、资产管理计划份额转让所涉风险</p> <p>本计划委托人可以在监管机构认可的场所按相关规定办理资产管理计划份额转让业务，由于转让价格不公允、系统故障、交易场所规则变化等原因，可能会给投资者带来一定风险。</p>

的费用（包括但不限于律师费、诉讼费、保全费等）以计划资产费用列支，一旦该类费用超过追索债权收益，会导致投资者本金及收益造成重大损失的风险。

（6）在高收益债券资产因出现违约或估值方法调整等需确认委托资产受损的情况下，若投资者申请退出了本计划，但投资者申请退出后出现问题的债券资产本金及收益实现偿付，则已退出的投资者将无法获取已兑现偿付的债权权益，从而导致投资者本金及收益损失的风险。

（7）本计划持有的高收益债券资产可能因出现停牌、暂停上市、到期未偿付等情形而造成债券违约，使得资产无法及时全部变现，从而导致本计划到期终止后的清算期相应延长，投资者无法及时获取本金及收益的风险。

7、管理人不能及时或放弃债权追索的风险

若本计划出现债券违约，且本计划当期现金资产部分不足以支付债券违约时管理人为实现债权所需要的费用（包括但不限于律师费、诉讼费、保全费等），则管理人有权代表本计划暂不对债权进行追索，从而导致投资者本金及收益当期受到损失的风险，同时可能导致债券追索诉讼时效经过的风险。

8、资产管理计划聘请投资顾问所涉风险

在符合法律法规、监管规定和本合同约定的前提下，资产管理人有权采纳并执行投资顾问的投资建议及意见进行本计划的投资管理。在资产管理计划财产管理运作过程中，投资顾问的研究水平、投资管理水平直接影响资产管理计划财产收益水平。资产管理人不保证该投资顾问的所有建议都正确无误，也不保证该投资顾问的所有建议都能够得到执行。计划资产可能因投资顾问的故意或过失行为导致计划资产以及投资者的损失。

<p>9、参与债券回购风险</p> <p>.....</p> <p>10、合同预授权风险</p> <p>.....</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、代销机构网站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网站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>6、参与债券回购风险</p> <p>.....</p> <p>7、合同预授权风险</p> <p>.....</p> <p>8、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>9、份额锁定期风险</p> <p>本计划针对每一参与份额设锁定期，可能对份额持有人自身的流动性造成不利影响，如市场出现大幅波动且投资者无法及时赎回，存在导致份额持有人损失进一步扩大的风险。</p> <p>10、合同条款变更的风险</p> <p>因监管规则及投资管理需要，资产管理人可能进行合同变更。合同变更方式为与托管人协商一致变更，全体委托人与管理人、托管人签署补充协议变更，向委托人征询变更，管理人单独变更，请委托人务必</p>
---	---

	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>1、 本金损失风险</p> <p>.....</p> <p>本计划由管理人评定为【R4】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【C5、C4】的普通合格投资者和专业投资者。通过代销机构购买本计划的客户，以代销机构的风险评级结果为准。参与本计划的普通合格投资者和专业投资者必须为满足本计划所适用的法律法规、监管规定、自律规则等规定的合格投</p>	<p>仔细阅读“资产管理合同的变更、终止与财产清算”章节的约定，知晓相关风险。同时因合同变更而带来的产品运作方式变更，可能存在与委托人预期不一致的风险。另外，向委托人征询方式变更的，部分投资者可能因为未能提供有效的联系方式、未能将变动后的联系方式及时通知管理人或者销售机构、或者未能及时查看相关公告等原因，而无法及时获知资产管理合同变更事项，如果投资者因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意资产管理合同变更，从而存在风险。</p> <p>11、购买资产管理产品或者私募基金双层收费的风险</p> <p>本计划可能投资于其他资产管理产品或私募基金，其他资产管理产品或私募基金本身也存在管理费、托管费、管理人业绩报酬等费用，所以本集合计划委托人会承担双层费用。</p> <p>此外，如果所有资产管理产品或私募基金约定在一定条件下其管理人有权提取业绩报酬，估值日资产管理产品或私募基金的管理人所提供的单位净值未扣除业绩报酬的，将导致本集合计划的净值中也包含资产管理产品或私募基金管理人未提取的业绩报酬。</p> <p>(二) 一般风险揭示</p> <p>1、 本金损失风险</p> <p>.....</p> <p>本计划由管理人评定为【R2】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【C5、C4、C3、C2】的普通合格投资者和专业投资者。通过代销机构购买本计划的客户，以代销机构的风险评级结果为准。参与本计划的普通合格投资者和专业投资者必须为满足本计划所适用的法律法规、监管规定、自律规则等规定</p>
--	--	---

<p>资者。</p> <p>.....</p> <p>9、投资标的风险</p> <p>(1) 投资于股票的风险</p> <p>.....</p> <p>(2) 投资于债券的风险</p> <p>.....</p> <p>(3) 投资于金融衍生品的风险</p> <p>1) 投资于商品期货、股指期货、国债期货、期权等金融衍生品。无论管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资,由于金融衍生品的高杠杆性等特征,若行情向不利方向剧烈变动,可能承受超出保证金甚至委托财产本金的损失;</p> <p>.....</p> <p>(4) 投资于公募基金等标的金融产品的风险</p> <p>.....</p> <p>5) 标的金融产品本身将会收取一定的费用,虽然该等费用可能并非直接在计划项下列支,但相比较于资产委托人直接对标的金融产品进行投资的情况,资产委托人通过投资于计划间接投资于标的金融产品,实质上同时承担了计划、标的金融产品项下的费用。</p>	<p>的合格投资者。</p> <p>.....</p> <p>9、投资标的风险</p> <p>(1) 投资于股票的风险 (如有)</p> <p>.....</p> <p>(2) 投资于债券的风险 (如有)</p> <p>.....</p> <p>(3) 投资于金融衍生品的风险 (如有)</p> <p>1) 投资于商品期货、股指期货、国债期货、期权等金融衍生品。无论管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资,由于金融衍生品的高杠杆性等特征,若行情向不利方向剧烈变动,可能承受超出保证金甚至受托财产本金的损失;</p> <p>.....</p> <p>(4) 投资于公募基金、资产管理计划、私募基金等标的金融产品的风险 (如有)</p> <p>.....</p> <p>5) 标的金融产品本身将会收取一定的费用,虽然该等费用可能并非直接在计划项下列支,但相比较于资产委托人直接对标的金融产品进行投资的情况,资产委托人通过投资于计划间接投资于标的金融产品,实质上同时承担了计划、标的金融产品项下的费用。</p> <p>6) 部分标的金融产品可能存在业绩报酬或者浮动费用,此种情况可能会造成标的金融产品披露的经托管复核后的净值未能真实反应扣除业绩报酬或者浮动费用后的实际净值。为充分反应标的资产的真实净值,本管理人可能会采用标的资管产品管理人提供的虚拟净值,虚拟净值指标的资管产品模拟扣除业绩报酬(如有)及浮动费用(如有)后的单位净值,可能与届时标的资管产品实际支付的业绩报酬、浮动费用存在差异,且标的资管产品管理人披露的虚拟净值可能未经</p>
--	---

	<p>(4) 投资资产支持证券的风险</p> <p>资产支持证券存续期间，可能面临信用评级下调的风险，或增信措施义务人无法履约的风险，将会对资产支持证券的投资价值和投资者的预期收益实现产生不利影响。</p> <p>资产支持证券虽然可以在交易所进行转让流通，但在交易对手有限的情况下，资产支持证券人可能面临无法在合理的时间内以合适价格出售资产支持证券的风险。</p>	<p>标的资管产品托管人复核，可能影响估值的准确度，并产生风险。</p> <p>(5) 投资资产支持证券的风险（如有）</p> <p>资产支持证券存续期间，可能面临信用评级下调的风险，或增信措施义务人无法履约的风险，将会对资产支持证券的投资价值和投资者的预期收益实现产生不利影响。</p> <p>资产支持证券虽然可以在交易所进行转让流通，但在交易对手有限的情况下，资产支持证券人可能面临无法在合理的时间内以合适价格出售资产支持证券的风险。</p> <p>(6) 投资于公开募集基础设施证券投资基金（公募 REITs）的特别风险（如有）</p> <p>公开募集基础设施证券投资基金（以下简称基础设施基金）采用“公募基金+基础设施资产支持证券”的产品结构，主要特点如下：一是基础设施基金与投资股票或债券的公募基金具有不同的风险收益特征，80%以上基金资产投资于基础设施资产支持证券，并持有其全部份额，基金通过基础设施资产支持证券持有基础设施项目公司全部股权，穿透取得基础设施项目完全所有权或经营权利；二是基础设施基金以获取基础设施项目租金、收费等稳定现金流为主要目的，收益分配比例不低于合并后基金年度可供分配金额的90%；三是基础设施基金采取封闭式运作，不开放申购与赎回，在证券交易所上市，场外份额持有人需将基金份额转托管至场内才可卖出或申报预受要约。</p> <p>投资基础设施基金可能面临以下风险，包括但不限于：</p> <p>1) 基金价格波动风险。基础设施基金大部分资产投资于基础设施项目，具有权益属性，受经济环境、运营管理等因素影响，基础设施项目市场价值及现金</p>
--	--	---

	<p>10、税收风险</p> <p>契约式产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。</p>	<p>流情况可能发生变化，可能引起基础设施基金价格波动，甚至存在基础设施项目遭遇极端事件（如地震、台风等）发生较大损失而影响基金价格的风险。</p> <p>2) 基础设施项目运营风险。基础设施基金投资集中度高，收益率很大程度依赖基础设施项目运营情况，基础设施项目可能因经济环境变化或运营不善等因素影响，导致实际现金流大幅低于测算现金流，存在基金收益率不佳的风险，基础设施项目运营过程中租金、收费等收入的波动也将影响基金收益分配水平的稳定。此外，基础设施基金可直接或间接对外借款，存在基础设施项目经营不达预期，基金无法偿还借款的风险。</p> <p>3) 流动性风险。基础设施基金采取封闭式运作，不开通申购赎回，只能在二级市场交易，存在流动性不足的风险。</p> <p>4) 终止上市风险。基础设施基金运作过程中可能因触发法律法规或交易所规定的终止上市情形而终止上市，导致投资者无法在二级市场交易。</p> <p>5) 税收等政策调整风险。基础设施基金运作过程中可能涉及基金持有人、公募基金、资产支持证券、项目公司等多层面税负，如果国家税收等政策发生调整，可能影响投资运作与基金收益。</p> <p>10、税收风险</p> <p>契约式产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。</p>
<p>资产委托人承诺</p>	<p>作为《海通期货-金澹远洋固收增强1号集合资产管理计划资产管理合同》资产委托人，特此承诺如下：</p> <p>.....</p> <p>2、本人/本机构保证委托财产的来源及用途符合中华人民共和国法律法规的相关规定。</p>	<p>作为《海通期货-金澹远洋固收增强1号集合资产管理计划资产管理合同》资产委托人，特此承诺如下：</p> <p>.....</p> <p>2、本人/本机构保证受托财产的来源及用途符合中华人民共和国法律法规的相关规定。</p>

	<p>.....</p> <p>4、本人/本机构已充分理解委托财产投资将可能面临下列各项风险：政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、信用风险、购买力风险、债券收益率曲线风险、再投资风险、波动性风险、管理风险、流动性风险、信用风险、特定的投资办法及委托资产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险以及其他风险。</p> <p>.....</p> <p>6、本人/本机构确认，资产管理人、资产托管人未对委托财产的收益状况作出任何承诺或担保。</p> <p>7、本人/本机构确认，资产管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，但不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益。</p>	<p>.....</p> <p>4、本人/本机构已充分理解受托财产投资将可能面临下列各项风险：政策风险、经济周期风险、利率风险、上市公司经营风险、信用风险、购买力风险、债券收益率曲线风险、再投资风险、波动性风险、管理风险、流动性风险、信用风险、特定的投资办法及受托财产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险以及其他风险。</p> <p>.....</p> <p>6、本人/本机构确认，资产管理人、资产托管人未对受托财产的收益状况作出任何承诺或担保。</p> <p>7、本人/本机构确认，资产管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用受托财产，但不保证受托财产一定盈利，也不保证最低收益。</p>
资产合法性及投资者适当性承诺书	<p>本人/本单位以真实身份委托海通期货股份有限公司运用委托资产进行投资。本人/本单位承诺委托资产来源及用途合法，不属于违反规定的公众集资，符合有关反洗钱法律法规的要求。海通期货股份有限公司有权要求本人/本单位提供资产来源及用途合法性证明，对资产来源及用途及合法性进行调查，本人/本单位愿意配合。</p> <p>.....</p> <p>本人/本单位将严格遵守以上承诺，否则海通期货股份有限公司有权解除资产管理合同，本人/本单位违反委托资产来源及用途合法性承诺的，海通期货股份有限公司还有权依法限制本人/本单位提取该委托资产。本人/本单位承担因此造成的全部损失和法律责任。</p>	<p>本人/本单位以真实身份委托海通期货股份有限公司运用受托资产进行投资。本人/本单位承诺受托资产来源及用途合法，不属于违反规定的公众集资，符合有关反洗钱法律法规的要求。海通期货股份有限公司有权要求本人/本单位提供资产来源及用途合法性证明，对资产来源及用途及合法性进行调查，本人/本单位愿意配合。</p> <p>.....</p> <p>本人/本单位将严格遵守以上承诺，否则海通期货股份有限公司有权解除资产管理合同，本人/本单位违反受托资产来源及用途合法性承诺的，海通期货股份有限公司还有权依法限制本人/本单位提取该受托资产。本人/本单位承担因此造成的全部损失和法律责任。</p>
二、释义	<p>5、资产托管人、托管人：国泰君安证券股份有限公司。</p> <p>6、资产委托人、委托人、份额持有人：签署本合</p>	<p>5、资产托管人、托管人：国泰海通证券股份有限公司。</p> <p>6、资产委托人、委托人、份额持有人：签署本合</p>

	<p>同，履行出资义务取得资产管理计划份额的委托人。</p> <p>7、投资顾问：指根据本资产管理合同及其他相关协议，为本资产管理计划提供涉及投资策略、投资决策、投资指令、交易安排等方面的建议或意见的机构；资产管理人聘请【上海金瀚资产管理有限公司】作为本计划的投资顾问。</p> <p>8、中国证券投资基金业协会（简称“基金业协会”）：基金行业相关机构自愿结成的全国性、行业性、非营利性社会组织。</p> <p>.....</p> <p>13、计划财产、计划资产、委托资产：资产委托人拥有合法处分权、资产管理人管理并由资产托管人托管的作为本合同标的的财产。</p> <p>.....</p> <p>18、资产管理结算账户：资产委托人用于办理委托资产汇入、追加、提取和清退的银行账户，也即委托人认购、参与本计划的划出账户与退出本计划的划入账户。</p> <p>.....</p>	<p>同，履行出资义务取得资产管理计划份额的委托人。</p> <p>7、中国证券投资基金业协会（简称“基金业协会”）：基金行业相关机构自愿结成的全国性、行业性、非营利性社会组织。</p> <p>.....</p> <p>12、计划财产、计划资产、受托资产、受托财产：资产委托人拥有合法处分权、资产管理人管理并由资产托管人托管的作为本合同标的的财产。</p> <p>.....</p> <p>17、资产管理结算账户：资产委托人用于办理受托资产汇入、追加、提取和清退的银行账户，也即委托人认购、参与本计划的划出账户与退出本计划的划入账户。</p> <p>（余项序号顺延）</p> <p>.....</p>
<p>三、声明与承诺</p>	<p>（一）管理人的声明与承诺</p> <p>.....</p> <p>8、管理人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。</p> <p>（二）托管人的声明与承诺</p> <p>.....</p> <p>2、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。</p>	<p>（一）管理人的声明与承诺</p> <p>.....</p> <p>8、管理人承诺按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用受托财产，不保证受托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。</p> <p>（二）托管人的声明与承诺</p> <p>.....</p> <p>2、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管受托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。</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>.....</p> <p>(6) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；</p> <p>(7) 有权获得投资顾问的投资建议服务，并对其提供的投资建议有审议、修改和最终决策权；</p> <p>(8) 法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及资产管理合同约定的其他权利。</p> <p>.....</p> <p>(三) 资产托管人</p> <p>1、资产托管人概况</p> <p>名称：国泰君安证券股份有限公司</p> <p>.....</p> <p>法定代表人：贺青</p> <p>联系人：【丛艳】</p> <p>联系电话：【021-38677336】</p> <p>联系地址：【上海市新闻路 669 号博华广场 19 楼】</p> <p>传真：【021-38677336】</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 02-04 单元、第 12 层</p> <p>.....</p> <p>2、资产管理人的权利</p> <p>.....</p> <p>(6) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；</p> <p>(7) 有权获得投资顾问的投资建议服务，并对其提供的投资建议有审议、修改和最终决策权；</p> <p>(8) 法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及资产管理合同约定的其他权利。</p> <p>.....</p> <p>(三) 资产托管人</p> <p>1、资产托管人概况</p> <p>名称：国泰海通证券股份有限公司</p> <p>.....</p> <p>法定代表人：朱健</p> <p>联系人：【丛艳】</p> <p>联系电话：【021-38917599】</p> <p>联系地址：【上海市新闻路 669 号博华广场 19 楼】</p>
<p>五、资产管理计划基本情况</p>	<p>(五) 投资范围：</p> <p>固定收益类：证券交易所或银行间市场发行及交易的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、债券逆回购、债券型公募基金、银行存</p>	<p>(五) 投资范围：</p> <p>固定收益类：证券交易所或银行间市场发行及交易的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、资产支持票据、债券逆回购、债券型公</p>

<p>款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金。</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>权益类：证券交易所上市的股票（含网上和网下新股申购）、港股通股票、股票型公募基金。</p> <p>其他：债券正回购。</p> <p>（六）投资比例及限制：</p> <p>.....</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>.....</p> <p>4、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>5、本计划不参与商品期货交割；</p> <p>6、本计划投资于债券或资产支持证券，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）；</p> <p>7、本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债</p>	<p>募基金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金。</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>权益类：证券交易所上市的股票。</p> <p>其他：债券正回购、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、基金公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、除债券型公募基金和货币市场基金以外的公募基金。</p> <p>（六）投资比例及限制：</p> <p>.....</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 160%；</p> <p>.....</p> <p>4、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>5、本计划投资于信用债（除可转换债、可交换债）的发行主体信用评级或债项信用评级或担保人评级应在 AA（含）以上。以上评级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。信用债指除利率债（包括国债、地方政府债、政策性金融债及央行票据）外的其他债券品种，【含】同业存单及资产证券化产品；</p> <p>6、本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债</p>
--	--

<p>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（托管人仅以现有能够获取的资讯数据为准进行监控，如与管理人数据存在不统一，以管理人提供数据及确认信息为准）；</p> <p>8、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>（七）产品风险：本计划属于【R4】级风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【C5、C4】级别风险承受能力的普通合格投资者和专业投资者。通过代销机构购买本计划的客户，以代销机构的风险评级结果为准。参与本计划的普通合格投资者和专业投资者必须为满足本计划所适用的法律法规、监管规定、自律规则等规定的合格投资者。</p> <p>（八）资产管理计划的存续期限：自本计划成立之日起 10 年，如本计划存续期届满最后一日为非工作日，则本计划存续期顺延至下一个工作日。当计划资产全部变现为现金时，管理人可根据市场情况选择提前终止本计划，终止前需告知托管人及委托人。本计划存续期满前，经委托人、管理人及托管人一致同意，</p>	<p>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（托管人仅以现有能够获取的资讯数据为准进行监控，如与管理人数据存在不统一，以管理人提供数据及确认信息为准）；</p> <p>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>8、证券期货经营机构发行的资管产品和私募证券投资基金，需具有监管机构认可的相关机构进行托管或保管。</p> <p>9、股票仅限于通过可转换债券或可交换债券转换所得的股票，且须在换股完成后的首个可交易日起 10 个交易日内全部卖出。</p> <p>10、证券及期货交易所上市的期货和期权品种需以国债为标的。</p> <p>（七）产品风险：本计划属于【R2】级风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【C5、C4、C3、C2】级别风险承受能力的普通合格投资者和专业投资者。通过代销机构购买本计划的客户，以代销机构的风险评级结果为准。参与本计划的普通合格投资者和专业投资者必须为满足本计划所适用的法律法规、监管规定、自律规则等规定的合格投资者。</p> <p>（八）资产管理计划的存续期限：自本计划成立之日起 10 年，如本计划存续期届满最后一日为非工作日，则本计划存续期顺延至下一个工作日。当计划资产全部变现为现金时，管理人可根据市场情况选择提前终止本计划，终止前需告知托管人及委托人。本计划存续期满前，经委托人、管理人及托管人一致同意，</p>
---	---

	<p>可以展期，展期时应当符合本计划的成立条件。</p> <p>（九）本计划将聘请【上海金瀚资产管理有限公司】作为投资顾问，对本计划的投资提供投资建议。资产管理人应当负责确保本计划所聘请的投资顾问符合《暂行规定》、《指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》关于投资顾问资质的规定。</p> <p>（十）资产管理计划份额的初始募集面值：人民币 1.0000 元。</p> <p>.....</p> <p>（十四）托管机构：国泰君安证券股份有限公司。</p>	<p>可以展期，展期时应当符合本计划的成立条件。</p> <p>（九）资产管理计划份额的初始募集面值：人民币 1.0000 元。</p> <p>.....</p> <p>（十三）托管机构：国泰海通证券股份有限公司。</p>
<p>八、资产管理计划的参与、退出和转让</p>	<p>（二）参与和退出的开放日和时间</p> <p>本计划锁定期为 180 天（自然日），即自每笔份额认购/参与确认后开始计算起 180 天（含）内，不允许退出，但投资者可在计划开放日根据本合同相关约定参与本计划（每笔参与份额单独计算锁定期）；自每笔份额认购/参与确认之日开始计算起 180 天后，投资者可在本计划开放日根据本合同相关约定参与和/或退出本资产管理计划（每笔认购/参与份额单独计算锁定期），但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定公告暂停参与和/或退出时除外。每笔份额认购/参与确认日期以本计划份额登记机构为准。</p> <p>本计划自成立之日起每周一、周三为固定开放日（如遇非工作日则顺延至下一工作日），投资者可在开放日办理参与和/或退出业务。此外管理人有权设置其他开放日，但每周设置的其他开放日不得超过 1 个工作日，具体开放日及开放方案以管理人公告为准。单笔锁定期未满 180 天的份额，在开放期内不允许办理退出业务。</p>	<p>（二）参与和退出的开放日和时间</p> <p>本计划锁定期为 28 天（自然日），即自每笔份额认购/参与确认后开始计算起 28 天（含）内，不允许退出，但投资者可在计划开放日根据本合同相关约定参与本计划（每笔参与份额单独计算锁定期）；自每笔份额认购/参与确认之日开始计算起 28 天后，投资者可在本计划开放日根据本合同相关约定参与和/或退出本资产管理计划（每笔认购/参与份额单独计算锁定期），但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定公告暂停参与和/或退出时除外。每笔份额认购/参与确认日期以本计划份额登记机构为准。</p> <p>本计划每周一、三开放申购，每月 10 号开放赎回，开放日如遇非工作日则顺延至下一工作日。此外管理人有权设置其他开放日，但每周设置的其他开放日不得超过 1 个工作日，具体开放日及开放方案以管理人公告为准。单笔锁定期未满 28 天的份额，在开放期内不允许办理退出业务。</p> <p>.....</p>

	<p>.....</p> <p>(四) 参与和退出申请的确认</p> <p>.....</p> <p>3、资产委托人退出申请确认后, 资产管理人将在【T+5】日(包括 T+5 日)内支付退出款项。在发生巨额退出时, 款项的支付办法参照本合同有关条款处理。</p> <p>.....</p> <p>(五) 参与和退出的金额限制</p> <p>委托人首次参与金额应不低于 30 万元人民币(法律法规或部门规章对参与金额无最低要求的合格投资者不受此限), 在开放日内追加参与的, 追加金额应不低于 1 万元人民币。</p>	<p>(四) 参与和退出申请的确认</p> <p>.....</p> <p>3、资产委托人退出申请确认后, 资产管理人将在【T+7】日(包括 T+7 日)内支付退出款项。在发生巨额退出时, 款项的支付办法参照本合同有关条款处理。</p> <p>.....</p> <p>(五) 参与和退出的金额限制</p> <p>委托人首次参与金额应不低于 100 万元人民币(法律法规或部门规章对参与金额无最低要求的合格投资者不受此限), 在开放日内追加参与的, 追加金额应不低于 1 万元人民币。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资</p>	<p>(二) 投资范围</p> <p>固定收益类: 证券交易所或银行间市场发行及交易的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、债券逆回购、债券型公募基金、银行存款(包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款)、同业存单、货币市场基金。</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>权益类: 证券交易所上市的股票(含网上和网下新股申购)、港股通股票、股票型公募基金。</p> <p>其他: 债券正回购。</p>	<p>(二) 投资范围</p> <p>固定收益类: 证券交易所或银行间市场发行及交易的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、资产支持票据、债券逆回购、债券型公募基金、银行存款(包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款)、同业存单、货币市场基金。</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>权益类: 证券交易所上市的股票。</p> <p>其他: 债券正回购、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、基金公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、除债券型公募基金和货币市场基金以外的公募基金。</p>

<p>资产管理计划改变投向和投资比例的，应当事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。</p> <p>特别提示：本计划可能投资于债券回购。</p> <p>（三）风险收益特征</p> <p>本计划为【R4】风险等级的产品，适合风险识别、评估、承受能力【C5、C4】级别风险承受能力的普通合格投资者和专业投资者。通过代销机构购买本计划的客户，以代销机构的风险评级结果为准。参与本计划的普通合格投资者和专业投资者必须为满足本计划所适用的法律法规、监管规定、自律规则等规定的合格投资者。</p> <p>.....</p> <p>（五）投资策略</p> <p>本计划主要投资于证券交易所或银行间市场发行及交易的债券，并利用债券正回购在计划资产上叠加一定杠杆，投资于期货及期权等金融衍生品工具。</p> <p>1、个券配置策略</p> <p>.....</p> <p>2、债券回购策略</p> <p>本计划主要开展银行间市场及证券交易所的债券回购（包括正回购和逆回购）。管理人通过债券回购融入和滚动短期资金作为杠杆，投资于收益率高于融资成本的其它获利机会，从而获得杠杆放大收益。本计划的融入资金主要投资于期货及期权等金融衍生品工具。同时，管理人在对资金面进行综合分析的基础上，密切关注市场资金需求，亦可通过逆回购的方式融出资金以获取收益。管理人在严格控制风险的前提下优选质押券标的及交易对手方，在保证投资组合的高流动性和低风险的同时尽可能提高投资组合的收益率。</p> <p>3、期货及期权等金融衍生品策略</p>	<p>资产管理计划改变投向和投资比例的，应当事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。</p> <p>特别提示：本计划可能投资于债券回购。</p> <p>（三）风险收益特征</p> <p>本计划为【R2】风险等级的产品，适合风险识别、评估、承受能力【C5、C4、C3、C2】级别风险承受能力的普通合格投资者和专业投资者。通过代销机构购买本计划的客户，以代销机构的风险评级结果为准。参与本计划的普通合格投资者和专业投资者必须为满足本计划所适用的法律法规、监管规定、自律规则等规定的合格投资者。</p> <p>.....</p> <p>（五）投资策略</p> <p>1、个券配置策略</p> <p>.....</p> <p>2、债券回购策略</p> <p>本计划主要开展银行间市场及证券交易所的债券回购（包括正回购和逆回购）。管理人通过债券回购融入和滚动短期资金作为杠杆，投资于收益率高于融资成本的其它获利机会，从而获得杠杆放大收益。同时，管理人在对资金面进行综合分析的基础上，密切关注市场资金需求，亦可通过逆回购的方式融出资金以获取收益。管理人在严格控制风险的前提下优选质押券标的及交易对手方，在保证投资组合的高流动性和低风险的同时尽可能提高投资组合的收益率。</p>
---	--

<p>以波动率策略为主，套利策略为辅。波动率策略是一种“障碍期权”卖出结构，是指挂钩一个标的指数的涨跌情况进行收益判断；优势在于为投资增加了一层缓冲空间，适应于温和上涨行情及震荡行情；投资者可以通过标的的“波动生息”；通过虚拟卖出期权获得权利金的收益，利用线性工具动态对冲拟合复制相关收益特征，投资标的为场内标准化工具。</p> <p>4、其他金融产品投资策略</p> <p>根据市场情况灵活采取不同策略，精选公募基金进行配置增强收益。</p> <p>请投资人知晓，本节仅为管理人对投资策略进行说明，并不构成任何对本计划资金安全性或者收益的承诺。</p> <p>(六) 投资比例及限制</p> <p>.....</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>.....</p> <p>4、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>5、本计划不参与商品期货交割；</p> <p>6、本计划投资于债券或资产支持证券，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）；</p> <p>7、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</p>	<p>3、其他投资策略</p> <p>根据市场情况灵活采取不同策略，参与本计划投资范围内约定的其他品种交易，增强投资组合收益。</p> <p>请投资人知晓，本节仅为管理人对投资策略进行说明，并不构成任何对本计划资金安全性或者收益的承诺。</p> <p>(六) 投资比例及限制</p> <p>.....</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 160%；</p> <p>.....</p> <p>4、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>5、本计划投资于信用债（除可转换债、可交换债）的发行主体信用评级或债项信用评级或担保人评级应在 AA（含）以上。以上评级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。信用债指除利率债（包括国债、地方政府债、政策性金融债及央行票据）外的其他债券品种，【含】同业存单及资产证券化产品。</p> <p>6、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</p>
--	---

<p>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（托管人仅以现有能够获取的资讯数据为准进行监控，如与管理人数据存在不统一，以管理人提供数据及确认信息为准）；</p> <p>8、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>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。</p> <p>.....</p> <p>（十）资产管理计划的预警与止损</p> <p>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0.7500元设置为止损线。</p> <p>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/份，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</p>	<p>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（托管人仅以现有能够获取的资讯数据为准进行监控，如与管理人数据存在不统一，以管理人提供数据及确认信息为准）；</p> <p>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>8、证券期货经营机构发行的资管产品和私募证券投资基金，需具有监管机构认可的相关机构进行托管或保管。</p> <p>9、股票仅限于通过可转换债券或可交换债券转换所得的股票，且须在换股完成后的首个可交易日起10个交易日内全部卖出。</p> <p>10、证券及期货交易所上市的期货和期权品种需以国债为标的。</p> <p>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。</p> <p>.....</p> <p>（十）资产管理计划的预警与止损</p> <p>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）0.9500元设置为预警线，将管理人估算的计划份额净值0.9200元设置为止损线。</p> <p>当管理人估算的计划份额净值低于或等于预警线0.9500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0.9500元/份，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</p>
--	---

	<p>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。</p> <p>当管理人估算的计划份额净值低于或等于止损线0.7500元时，无论T+1日及之后的本计划份额净值是否高于0.7500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。</p> <p>.....</p> <p>资产管理人特别提示：本计划设置0.7500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0.7500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0.7500元。</p>	<p>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。</p> <p>当管理人估算的计划份额净值低于或等于止损线0.9200元时，无论T+1日及之后的本计划份额净值是否高于0.9200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。</p> <p>.....</p> <p>资产管理人特别提示：本计划设置0.9200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0.9200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0.9200元。</p>
<p>十二、投资顾问</p>	<p>(一) 投资顾问的指定</p> <p>因本计划投资运作需求，委托人同意管理人聘请【上海金澹资产管理有限公司】为本计划的投资顾问，负责为本计划期货及期权等金融衍生品策略出具投资建议。投资顾问应当恪尽职守，遵循诚实、信用、审慎、公平的原则，凭借自身的专业能力为本计划提供投资顾问服务。管理人应切实履行主动管理职责，依法应当承担的责任不因聘请投资顾问而免除。</p> <p>.....</p> <p>投资顾问收取投资顾问费的银行账户信息如下（账户信息如有变更，投资顾问须及时通知管理人）： 户名：上海金澹资产管理有限公司</p>	<p>本资产管理计划无投资顾问。</p>

	<p>账号：中国银行上海市张江支行</p> <p>开户行：433873634692</p>	
十四、利益冲突及关联交易	<p>管理人运用委托资产从事重大关联交易的，应事先取得委托人同意，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。</p>	<p>管理人运用受托资产从事重大关联交易的，应事先取得委托人同意，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。</p>
十七、投资指令的发送、确认与执行	<p>（三）划款指令的发送、确认和执行的时间和程序</p> <p>……</p> <p>本计划托管账户发生的银行结算等费用（包括手续费，邮电费，账户开户费等），由托管账户开户银行或资产托管人直接从委托财产专用银行账户中扣划，无须资产管理人出具划款指令。</p> <p>……</p> <p>（四）托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序</p> <p>资产托管人发现资产管理人发送的投资指令违反本合同《投资监督事项表》的约定时，不予执行，并应及时通知管理人纠正。</p>	<p>（三）划款指令的发送、确认和执行的时间和程序</p> <p>……</p> <p>本计划托管账户发生的银行结算等费用（包括手续费，邮电费，账户开户费等），由托管账户开户银行或资产托管人直接从受托财产专用银行账户中扣划，无须资产管理人出具划款指令。</p> <p>……</p> <p>（四）托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序</p> <p>资产托管人发现资产管理人发送的投资指令违反本合同《投资监督事项表》的约定时，不予执行，并应及时通知管理人纠正。</p>
十九、越权交易	<p>（三）托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>托管人按照法律法规规定及本章节约定对管理人的投资行为行使监督权，监督范围以本合同之附件一《投资监督事项表》为限确定。托管人对计划财产的监督和检查自本计划委托财产运作起始日起开始。</p>	<p>（三）托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>托管人按照法律法规规定及本章节约定对管理人的投资行为行使监督权，监督范围以本合同之附件一《投资监督事项表》为限确定。托管人对计划财产的监督和检查自本计划受托财产运作起始日起开始。</p>
二十一、资产管理计划的费用与税收	<p>（二）费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、管理费</p> <p>本计划的年管理费率为1%。计算方法如下：</p> $H=E \times 1\% \div N$ <p>H：每日应计提的管理费</p>	<p>（二）费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、管理费</p> <p>本计划的年管理费率为0.4%。计算方法如下：</p> $H=E \times 0.4\% \div N$ <p>H：每日应计提的管理费</p>

<p>E: 前一自然日的计划资产净值</p> <p>N: 当年天数</p> <p>.....</p> <p>2、托管费</p> <p>本计划的年托管费率为 0.02%。计算方法如下:</p> <p>.....</p> <p>托管费收入银行账户信息如下(账户信息如有变更,管理人须及时通知相关各方):</p> <p> 账户名称(接收托管费): 国泰君安证券股份有限公司</p> <p> 账号: 【415900000010916】</p> <p> 开户银行: 【招商银行股份有限公司上海张江支行】</p> <p>3、业绩报酬</p> <p>本计划业绩报酬由资产管理人收取。</p> <p>(1) 业绩报酬提取的时点与方式</p> <p>.....</p> <p>2) 本计划的业绩报酬计提日为委托人退出日、收益分配日、计划终止日,如遇非工作日顺延至下一工作日。当计划份额持有人每笔所持份额或退出份额在持有期的年化收益率大于 4%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 4%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,因投资者退出或终止,不受前述提取频率的限制。</p> <p>.....</p> <p>(2) 业绩报酬提取的方法</p> <p>业绩报酬(R)的计提方法:</p> <p>如果 $r \leq 4\%$, 则 $R = 0$</p> <p>如果 $4\% < r$, 则 $R = F \times C \times (r - 4\%) \times 30\% \times T / 365$</p>	<p>E: 前一自然日的计划资产净值</p> <p>N: 当年天数</p> <p>.....</p> <p>2、托管费</p> <p>本计划的年托管费率为 0.02%。计算方法如下:</p> <p>.....</p> <p>托管费收入银行账户信息如下(账户信息如有变更,管理人须及时通知相关各方):</p> <p> 账户名称(接收托管费): 国泰海通证券股份有限公司</p> <p> 账号: 【415900000010916】</p> <p> 开户银行: 【招商银行股份有限公司上海张江支行】</p> <p>3、业绩报酬</p> <p>本计划业绩报酬由资产管理人收取。</p> <p>(1) 业绩报酬提取的时点与方式</p> <p>.....</p> <p>2) 本计划的业绩报酬计提日为委托人退出日、收益分配日、计划终止日,如遇非工作日顺延至下一工作日。当计划份额持有人每笔所持份额或退出份额在持有期的年化收益率大于 2.6%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 2.6%的持有期差额收益按 60%比例进行计提。计提频率不得超过每 6 个月一次,因投资者退出或终止,不受前述提取频率的限制。</p> <p>.....</p> <p>(2) 业绩报酬提取的方法</p> <p>业绩报酬(R)的计提方法:</p> <p>如果 $r \leq 2.6\%$, 则 $R = 0$</p> <p>如果 $2.6\% < r$, 则 $R = F \times C \times (r - 2.6\%) \times 60\% \times T / 365$</p>
--	--

	<p>.....</p> <p>本计划的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>.....</p> <p>本计划的业绩报酬计提基准仅用于计算本计划业绩报酬，并不构成对受托财产可能收益的承诺或暗示。</p>
二十四、风险揭示	<p>资产管理计划投资可能面临下列各项风险，包括但不限于：</p> <p>（一）特殊风险揭示</p> <p>1、资产管理合同与证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险</p> <p>.....</p> <p>二、一般风险揭示</p> <p>.....</p> <p>12、其他风险</p> <p>.....</p> <p>（11）您必须了解按照我国金融监管法律规定，证券、期货公司须获得中国证监会核准的证券、期货经营资格方可从事证券、期货业务。虽证券、期货经纪商相信其本身将按照相关法律的规定进行营运及管理，但无法保证其本身可以永久维持符合监管部门的金融监管法律。如在计划存续期间证券、期货经纪商无法继续从事证券、期货业务，则可能会对计划产生不利影响。</p> <p>特别提示：即使资产管理人已对可能存在的风险进行了揭示，但本计划仍可能存在未能揭示的风险，本计划财产存在部分亏损甚至全部亏损的可能。同时本计划项下资产管理人等相关机构和人员的过往业绩不代表本计划未来运作的实际效果，本计划存在较大投资风险，仅适合具有较强风险识别能力和风险承受能力的资产委托人认购，资产委托人应充分认识加入本计划的投资风险，资产管理人不保证最低收益或本计划财产不受损失。</p>	<p>本集合资产管理计划详细的风险揭示内容见《海通期货-金滄远洋固收增强 1 号集合资产管理计划资产管理业务风险揭示书》。</p> <p>特别提示：即使资产管理人已对可能存在的风险进行了揭示，但本计划仍可能存在未能揭示的风险，本计划财产存在部分亏损甚至全部亏损的可能。同时本计划项下资产管理人等相关机构和人员的过往业绩不代表本计划未来运作的实际效果，本计划存在较大投资风险，仅适合具有较强风险识别能力和风险承受能力的资产委托人认购，资产委托人应充分认识加入本计划的投资风险，资产管理人不保证最低收益或本计划财产不受损失。</p>

<p>二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算</p>	<p>(二) 非因法律、法规及有关政策发生变化的原因而导致合同变更时, 可采用以下四种方式中的一种进行合同变更。</p> <p>.....</p> <p>2、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。</p> <p>3、当出现下列情形时, 资产管理人有权单独变更合同内容的情形:</p> <p>(1) 调低认购、参与退出费率(如有)、管理费率、业绩报酬计提比例;</p> <p>(2) 资产管理人的银行收款账号的变更;</p> <p>(3) 投顾费用分成比例;</p> <p>(4) 投资经理的变更;</p>	<p>(二) 非因法律、法规及有关政策发生变化的原因而导致合同变更时, 可采用以下四种方式中的一种进行合同变更。</p> <p>.....</p> <p>2、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。征得资产托管人同意后, 资产管理人应当就变更事项向资产委托人发送合同变更征询意见函(或通知)。直销客户由管理人通过管理人网站、官方 APP 或委托人在管理人处预留的电子邮箱或电话号码短信通知(管理人通过以上方式之一向委托人发送征询意见函(或通知)的, 视为管理人已履行通知义务); 通过代销机构购买本计划的委托人, 管理人将合同变更征询意见函(或通知)发送给代销机构, 由代销机构负责向委托人披露。委托人不同意合同变更事项的, 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合同变更。征询意见函(或通知)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。</p> <p>3、当出现下列情形时, 资产管理人有权单独变更合同内容的情形:</p> <p>(1) 调低认购、参与退出费率(如有)、管理费率、业绩报酬计提比例;</p> <p>(2) 资产管理人的银行收款账号的变更;</p> <p>(3) 投资经理的变更;</p>
------------------------------	--	--

	<p>(5) 资产管理计划认购、参与、退出、非交易过户的原则、时间、业务规则等变更；</p> <p>.....</p> <p>4、特别地，资产管理计划改变投向和比例的，资产管理人应当事先取得投资者同意。</p>	<p>(4) 资产管理计划认购、参与、退出、非交易过户的原则、时间、业务规则等变更；</p> <p>(余项序号顺延)</p> <p>.....</p> <p>4、特别地，资产管理计划改变投向和比例的，资产管理人应当事先取得投资者同意。</p> <p>请委托人务必及时查阅管理人网站或代销机构信息披露渠道，以及及时更新在管理人或代销机构留存的通讯信息，否则可能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合同变更的风险。</p>
二十六、违约责任	<p>(一) 当事人违反本合同，应当承担违约责任，给合同其他当事人造成损失的，应当承担赔偿责任；如属本合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人应当免责：</p> <p>.....</p> <p>6、委托财产实际运行中，虽然约定了委托财产的止损比例，但是由于持仓品种价格可能持续向不利方向变动、持仓品种因为市场剧烈波动导致不能平仓等原因，最终导致委托财产亏损超出止损比例造成的损失。</p> <p>7、资产托管人由于按照资产管理人符合本合同约定的有效指令执行而造成的损失等。</p> <p>8、法律法规规定及本合同约定的其他情况。</p>	<p>(一) 当事人违反本合同，应当承担违约责任，给合同其他当事人造成损失的，应当承担赔偿责任；如属本合同当事人双方或多方当事人的违约，根据实际情况，由违约方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况，当事人应当免责：</p> <p>.....</p> <p>6、受托财产实际运行中，虽然约定了受托财产的止损比例，但是由于持仓品种价格可能持续向不利方向变动、持仓品种因为市场剧烈波动导致不能平仓等原因，最终导致受托财产亏损超出止损比例造成的损失。</p> <p>7、资产托管人由于按照资产管理人符合本合同约定的有效指令执行而造成的损失等。</p> <p>8、法律法规规定及本合同约定的其他情况。</p>
附件一：投资监督事项表	<p>资产托管人根据经核对本计划估值数据以本表为限对计划资产的投资进行监督。</p> <p>资产托管人据此表对委托财产的投资进行监督，但资产托管人无投资责任。</p> <p>一、投资范围</p> <p>固定收益类：证券交易所或银行间市场发行及交易的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期</p>	<p>资产托管人根据经核对本计划估值数据以本表为限对计划资产的投资进行监督。</p> <p>资产托管人据此表对受托财产的投资进行监督，但资产托管人无投资责任。</p> <p>一、投资范围</p> <p>固定收益类：证券交易所或银行间市场发行及交易的国债、地方政府债、中央银行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、超短期</p>

<p>融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、债券逆回购、债券型公募基金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金。</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>权益类：证券交易所上市的股票（含网上和网下新股申购）、港股通股票、股票型公募基金。</p> <p>其他：债券正回购；</p> <p>二、投资比例</p> <p>1、投资于固定收益类资产按市值计算不低于本计划总资产的 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、本计划投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 25%（同一资产的认定及计算方式：股票、债券、资产支持证券、资产支持票据、同业存单、各类资产管理产品、债券逆回购按【单只证券或产品市值】进行计算、期货期权按照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；</p> <p>4、本计划投资于债券或资产支持证券，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）；</p>	<p>融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、资产支持票据、债券逆回购、债券型公募基金、银行存款（包括银行活期存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金。</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>权益类：证券交易所上市的股票。</p> <p>其他：债券正回购、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、基金公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、除债券型公募基金和货币市场基金以外的公募基金。</p> <p>二、投资比例</p> <p>1、投资于固定收益类资产按市值计算不低于本计划总资产的 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 160%；</p> <p>3、本计划投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 25%（同一资产的认定及计算方式：股票、债券、资产支持证券、资产支持票据、同业存单、各类资产管理产品、债券逆回购按【单只证券或产品市值】进行计算、期货期权按照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；</p> <p>5、本计划投资于信用债（除可转换债、可交换债）的发行主体信用评级或债项信用评级或担保人评级应在 AA（含）以上。以上评级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。信用债指除利率债（包括国债、地方政府债、政策性金融债及央行票据）外的其他债券品种，【含】同业存单及资产证券化产品。</p>
---	---

<p>5、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（托管人仅以现有能够获取的资讯数据为准进行监控，如与管理人数据存在不统一，以管理人提供数据及确认信息为准）。</p>	<p>6、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（托管人仅以现有能够获取的资讯数据为准进行监控，如与管理人数据存在不统一，以管理人提供数据及确认信息为准）。</p>
---	---

