

关于华菁证券有限公司旗下华菁 CTA 量化 1 号集合资产管理计划拟变更合同
相关条款的公告

尊敬的投资者：

根据相关法律法规规定和华菁证券有限公司（以下简称“我司”）旗下《华菁 CTA 量化 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）的约定，经与集合资产管理计划托管人协商，我司拟对该集合资产管理计划《资产管理合同》的相关条款进行变更。相关条款具体修改如下：

条款位置	变更前	变更后
第四章 当事人及其权利义 务、推广 机构	<p>三、集合计划委托人的义务</p> <p>.....</p> <p>7、在持有的本集合计划份额范围内，承担本集合计划亏损或者终止的有限责任；退还因管理人、托管人、推广机构过错导致委托人获得的不当利得；</p> <p>.....</p> <p>七、托管人的义务</p> <p>.....</p> <p>13、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法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即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>14、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的以及本合同约定的其他义务。</p>	<p>三、集合计划委托人的义务</p> <p>.....</p> <p>7、在持有的本集合计划份额范围内，承担本集合计划亏损或者终止的有 限责任；</p> <p>.....</p> <p>七、托管人的义务</p> <p>在原第 13 项后增加一项作为第 14 项，其后款项序号相应顺延，修订后如下：</p> <p>13、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法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即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>14、投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督</p>



		<p>管理人投资运作等职责,并向投资者充分揭示;</p> <p>15、法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的以及本合同约定的其他义务。</p>
<p>第五章 集合计划 的基本情 况</p>	<p>二、规模、投资范围和投资比例</p> <p>例</p> <p>1、目标规模及人数限制</p> <p>.....</p> <p>在本集合计划人数接近或达到上限时,管理人将自次日起拒绝接受初次参与申请,但继续接受本集合计划份额持有人的追加参与申请,并对当日已提交的初次参与申请,管理人将采取当日参与金额较大者优先的原则处理,并及时向委托人披露。</p> <p>.....</p> <p>五、封闭期、开放期及流动性安排:</p> <p>.....</p> <p>3、流动性安排:集合计划开放退出期内,其资产组合中7个工作日可变现资产的价值不低于集合计划资产净值的10%,且主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过集合计划资产净值的20%。</p>	<p>二、规模、投资范围和投资比例</p> <p>1、目标规模及人数限制</p> <p>.....</p> <p>本集合计划份额持有人达到200人时,管理人将自次日起拒绝接受初次参与申请,但继续接受本集合计划份额持有人的追加参与申请,并对当日已提交的初次参与申请,管理人将采取当日参与金额较大者优先(金额相同的,按照提交申请时间较早者优先)的原则处理,按照排序结果,接受200人(含)以内的申请,对其他申请予以拒绝,并及时向委托人披露。</p> <p>.....</p> <p>五、封闭期、开放期及流动性安排:</p> <p>.....</p> <p>3、流动性安排:本集合计划的资产组合的流动性应与参与、退出安排相匹配,集合计划开放退出期内,其资产组合中7个工作日可变现资产的价值不低于集合计划资产净值的10%,且主动投资于流动性受限资产的市值合计</p>

		不超过集合计划资产净值的 20%。
<p>第十二章 集合计划 的参与和 退出</p>	<p>一、集合计划的参与</p>	<p>一、集合计划的参与</p> <p>在原“(五)参与确认与登记结算、款项支付、参与费用”后增加条款如下：</p> <p>(六)拒绝或暂停参与的情形及处理方式</p> <p>1、在如下情况下，管理人可以拒绝接受投资者的参与申请：</p> <p>(1) 本集合计划份额持有人达到 200 人，管理人将自次日起拒绝接受初次参与申请，但继续接受本集合计划份额持有人的追加参与申请，对当日已提交的初次参与申请，管理人将采取当日参与金额较大者优先（金额相同的，按照提交申请时间较早者优先）的原则处理，按照排序结果，接受 200 人（含）以内的申请，对其他申请予以拒绝，并及时向委托人披露；</p> <p>(2) 根据市场情况，管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对本集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有委托人的利益的情形；</p> <p>(3) 因本集合计划所持某个或某些证券进行权益分派等原因，使管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现</p>

	<p>二、集合计划的退出</p>	<p>有委托人利益的；</p> <p>(4) 管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他委托人利益的；</p> <p>(5) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>管理人决定拒绝接受某些投资者的参与申请时，参与款项将退回投资者账户。</p> <p>2、在如下情况下，管理人可以暂停接受投资者的参与申请：</p> <p>(1) 因不可抗力导致无法受理委托人的参与申请；</p> <p>(2) 证券、期货交易所交易时间临时停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值和计划份额净值；</p> <p>(3) 发生本合同规定的暂停计划资产估值情况；</p> <p>(4) 法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。</p> <p>管理人决定暂停接受全部或部分参与申请时，应当告知委托人。在暂停参与的情形消除时，管理人应及时恢复参与业务的办理并予以告知委托人。</p> <p>二、集合计划的退出</p>
--	------------------	---

<p>.....</p> <p>(十) 拒绝或暂停退出的情况及处理方式</p> <p>出现下列情形时，管理人可以拒绝接受或暂停集合计划委托人的退出申请：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作； 2、证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算； 3、因市场剧烈波动或其它原因而出现连续两个开放日以上（含两个开放日）巨额退出，导致集合计划的现金支付出现困难； 4、法律法规规定或中国证监会认定的其它情形。 <p>已接受的退出申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付的，可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分由管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。连续出现上述第 3 款的情形（即因市场剧烈波动或其它原因而出现连续两个开放日以上（含两个开放日）巨额退出，导致集合计划的现金支付出现困难）时，对已接受</p>	<p>在原“(十) 拒绝或暂停退出的情况及处理方式”之前增加一项作为第(十)项，同时原第(十)项序号顺延为(十一)，并对原第(十)项进行相应调整，修改后如下：</p> <p>.....</p> <p>(十) 延期支付及延期退出的情形和处理方式</p> <p>发生下列情形时，管理人可延期支付退出款项或延期办理委托人退出申请：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、因不可抗力导致管理人不能支付赎回款项。 2、发生本合同规定的暂停资产估值情况。 3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致管理人无法计算当日计划资产净值。 4、同一开放期内连续两个或两个以上交易日发生巨额退出。 5、发生继续接受退出申请将损害现有份额持有人利益的情形时。 6、当前一估值日计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当延期支付退出款项或
--	--

<p>的退出申请可延期支付退出款项，最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并向委托人披露。委托人在申请退出时可事先选择是否将当日可能未获受理部分予以撤销。</p> <p>暂停集合计划的退出，管理人应及时披露。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理。</p>	<p>延期办理退出申请。</p> <p>7、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>已接受的退出申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付的，可按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分由管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付。连续出现上述第 4 款的情形（即同一开放期内连续两个或两个以上交易日发生巨额退出。）时，对已接受的退出申请可延期支付退出款项，最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并向委托人披露。委托人在申请退出时可事先选择是否将当日可能未获受理部分予以撤销。</p> <p>（十一）拒绝或暂停退出的情况及处理方式</p> <p>出现下列情形时，管理人可以拒绝接受或暂停集合计划委托人的退出申请：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作； 2、证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算； 3、因市场剧烈波动或其它原因而出现
---	--

		<p>连续两个开放日以上（含两个开放日）巨额退出，导致集合计划的现金支付出现困难；</p> <p>4、法律法规规定或中国证监会认定的其它情形。</p> <p>暂停集合计划的退出，管理人应及时披露。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理。</p>
<p>第十三章 管理人自有资金参与集合计划</p>	<p>管理人有权以自有资金参与本集合计划，集合计划其他客户份额享有同等权益，承担同等风险；若自有资金参与本集合计划，则参与本集合计划的自有资金不得超过集合计划总份额的 20%（未来监管机构对自有资金参与有新规定的，本集合计划将按照新规定执行），因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，自有资金应当在符合法律法规及本合同约定的前提下进行调整。</p> <p>.....</p>	<p>一、自有资金参与的条件</p> <p>管理人以自有资金参与本集合计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司董事会、董事会或其他授权程序的批准。</p> <p>二、自有资金参与的方式</p> <p>在推广期和存续期内，管理人有权以自有资金参与本集合计划，与集合计划其他客户份额享有同等权益，承担同等风险。</p> <p>三、自有资金参与的份额比例</p> <p>若自有资金参与本集合计划，则参与本集合计划的自有资金不得超过集合计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本集合计划总份额的 50%。（未来监管机构对自有资金参与有新规定的，本集合计划将按照新规定执行），因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，自有资金应当在符合法律法规及本合同约定的前提下进行调整。</p>

		<p>四、自有资金的退出</p> <p>.....</p>
<p>第十七章 集合计划 的账户及 资产</p>	<p>管理人和托管人对集合计划资产单独设置账户，集合计划使用集合计划名称由托管人在具有基金托管资格的商业银行开立托管账户，以管理人、托管人和集合计划联名的方式开立证券账户，并以集合计划的名义开立银行间债券托管账户，以上账户的具体账户名以实际开立的名称为准。托管人根据管理人提交的开户申请开立上述账户，管理人应配合托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。管理人和托管人对集合计划资产独立核算、分账管理，保证集合计划资产与其自有资产、集合计划资产与其他客户资产、不同集合计划的资产相互独立。</p> <p>管理人、托管人依据相关法律法规及本合同的约定对本集合计划的各类账户进行管理。</p>	<p>增加标题“一、资产管理计划财产相关账户的开立和管理”</p> <p>一、资产管理计划财产相关账户的开立和管理</p> <p>管理人和托管人对集合计划资产单独设置账户，集合计划使用集合计划名称由托管人在具有基金托管资格的商业银行开立托管账户，以管理人、托管人和集合计划联名的方式开立证券账户，并以集合计划的名义开立银行间债券托管账户，以上账户的具体账户名以实际开立的名称为准。托管人根据管理人提交的开户申请开立上述账户，管理人应配合托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。管理人和托管人对集合计划资产独立核算、分账管理，保证集合计划资产与其自有资产、集合计划资产与其他客户资产、不同集合计划的资产相互独立。</p> <p>管理人、托管人依据相关法律法规及本合同的约定对本集合计划的各类账户进行管理。</p> <p>(一)集合计划银行托管账户的开立和管理</p> <p>托管人在具有托管资格的商业银行为本集合计划开立银行托管账户，账户名称应为“华菁 CTA 量化 1 号集合</p>

资产管理计划”，具体账户名以实际开立的账户为准。预留印鉴为托管人印章；托管账户可出款日期以开户行执行中国人民银行《人民币银行结算账户管理办法》的具体要求为准。该账户用于办理本集合计划参与及退出资金、收益分配等资金往来相关业务。托管账户与管理人、托管人和推广机构自有资金账户以及其他集合计划资金账户相互独立。本集合计划资产的一切货币收支活动均通过本集合计划托管账户进行。管理人应配合托管人办理账户开立事宜并提供相关资料,并保证所提供账户开户材料的真实性和有效性,且在相关资料变更后及时将变更的资料提供给托管人。

1、集合计划银行托管账户的开立和使用,限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户;亦不得使用本集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。

2、本集合计划银行托管账户的开立和管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》《现金管理暂行条例》《支付结算办法》以及中国人民银行、中国银监会的其他规定。

(二) 集合计划证券账户和资金账户的开立和管理

		<p>1、托管人根据管理人委托按中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中登公司”)相关规定在中登公司为本集合计划分别开立证券账户,管理人应配合托管人办理账户开立事宜并提供相关资料。</p> <p>2、集合计划证券账户的开立和使用,限于满足开展本集合计划业务的需要。托管人和管理人不得出借和转让本集合计划的任何证券账户,亦不得使用本集合计划的任何账户进行本集合计划业务以外的活动。</p> <p>本集合计划账户、专用交易单元应由管理人报证券交易所、证券登记结算机构以及管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会备案。</p> <p>本集合计划证券账户卡的保管由托管人负责,管理和运用由管理人负责。</p> <p>(三) 债券账户的开设和管理</p> <p>本合同生效后,托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司(以下简称“中债登”)和银行间市场清算所股份有限公司(以下简称“上清所”)的有关规定,在中债登和上清所开立债券账户和债券资金结算账户,并代表集合计划进行银行间市场债券交易的结算。</p> <p>(四) 期货账户的开立和管理</p>
--	--	--

管理人选择的期货公司根据《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引》《人民币银行结算账户管理办法》《期货交易管理条例》《关于规范期货保证金存取业务有关问题的通知》《中国金融期货交易所交易细则》等股指期货法律法规,为本集合计划开设期货投资相关账户及交易编码。

管理人应以书面形式将期货公司提供的本委托资产期货保证金账户信息及初始资金密码,中国期货市场监控中心的登录用户名及密码,期货公司开立的保证金账户信息,期货交易所交易编码告知资产托管人。资金密码重置由管理人进行,重置后务必及时通知托管人。

(五) 基金账户的开立和管理

基金账户由管理人根据投资需要按照相关规定开立,完成账户开立后,管理人应以书面形式将基金账户信息告知托管人。

(六) 其他账户的开立和管理

因业务发展而需要开立的其他账户,可以根据法律法规和本合同的规定,经管理人与托管人进行协商后办理。新账户按照有关规则使用并管理。

法律、法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的,从其规定办

		理。
第十八章 集合计划 资产的托 管	<p>三、投资指令的发送、确认和执行</p> <p>(一) 管理人对发送指令人员的书面授权</p>	<p>三、投资指令的发送、确认和执行</p> <p>(一) 交易清算授权</p>
第二十五 章 集合计划 的信息披 露	<p>三、重大事项披露和披露方式。</p> <p>.....</p> <p>....., 管理人应当及时在管理人网站上向委托人披露,</p>	<p>三、重大事项披露和披露方式。</p> <p>.....</p> <p>....., 管理人应当在事项发生之日起五个工作日内通过管理人网站向委托人披露,</p>
第二十六 章 集合计划 份额的转 让、转 换、非交 易过户和 冻结	<p>一、集合计划份额的转让</p> <p>集合计划份额的转让指集合计划存续期间, 管理人申请并开通份额转让事宜之后, 客户通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。受让方首次参与集合计划, 应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。</p> <p>.....</p> <p>三、集合计划份额的非交易过户</p> <p>非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式, 将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委</p>	<p>一、集合计划份额的转让</p> <p>集合计划份额的转让指集合计划存续期间, 管理人申请并开通份额转让事宜之后, 客户通过证券交易所等中国证监会认可的方式, 向合格投资者转让其持有的本集合计划份额, 份额转让应遵守交易场所相关规定及要求, 并按规定办理份额变更登记手续。受让方首次参与集合计划, 应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。</p> <p>.....</p> <p>三、集合计划份额的非交易过户</p> <p>非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式, 将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法强制执行以及</p>

	<p>托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定办理。</p>	<p>其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定办理。</p>
<p>第二十九章 违约责任与争议处理</p>	<p>四、在发生违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。</p> <p>合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。</p> <p>...</p>	<p>四、在发生违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。</p> <p>合同当事人违反本合同，给其他当事人造成经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。</p> <p>...</p>
<p>第三十三章 风险揭示</p>		<p>增加条款：</p> <p>1、本金损失风险</p> <p>管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划财产，但不保证计划财产中的认购/参与资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。</p> <p>本集合计划属于【R3（中风险）】风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力【C3（平衡型）】及以上的合格投资者。</p> <p>2、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>本《资产管理合同》是基于证券投资基金业协会发布的《集合资产管理计</p>

划资产管理合同内容与格式指引（试行）》而制定的，管理人根据自身实际情况，对《合同指引》相关内容做出了相应调整，可能导致本合同被证券投资基金业协会认定为与《合同指引》不完全一致，从而要求管理人重新修订完善的风险。管理人将及时根据证券投资基金业协会的要求提交说明材料，如涉及合同变更或与投资者权利义务的，管理人将即时在指定网站进行相关披露。

7、募集失败风险

本集合计划的成立需符合相关法律法规的规定，本集合计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。在发生募集失败时，管理人的责任承担方式如下：

（1）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（2）在本集合计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

21、本集合计划运营事项所涉风险

本集合计划份额登记、估值核算等运营服务由华菁证券有限公司办理，因服务机构经营风险、技术系统故障、操作失误等，可能使得服务事项发生差错，给本集合计划运营带来风险。

22、产品备案风险

本资产管理计划存在因监管政策等原因导致备案不成功的风险。如集合

		计划备案不成功，管理人可在收到备案不成功信息后三十日内，将已认购资金及投资收益（如有）返还委托人。 其他原条款序号相应调整。
--	--	---

本集合计划说明书及风险揭示书中对应内容一并调整，本次变更内容已经过集合资产管理计划托管人确认。

根据《资产管理合同》关于合同变更的相关约定，本次合同变更征询期间为自本公告日起至2019年7月31日，该集合资产管理计划在2019年7月31日为赎回开放日，委托人不同意合同变更的，需在2019年7月31日交易时间内提出赎回申请；委托人未退出的视为同意合同变更，无须另行签署新合同。

在符合《资产管理合同》约定的变更生效条件后，变更后的《资产管理合同》将于2019年8月1日起生效，届时不再另行公告，本公告即成为《资产管理合同》的组成部分。

特此公告。

