

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
合同相关条款以及管理人自有资金退出的公告

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（第二版）》（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
第五章 集合计划 的基本情 况	<p>十、本集合计划的主要费用及费率</p> <p>1、参与费：0%。</p> <p>2、退出费：在一定情况下，本集合计划收取退出费，参见本合同第十二章“集合计划的参与和退出”。</p> <p>3、管理费：由固定管理费和业绩报酬组成，其中固定管理费的费率为2.0%/年，业绩报酬具体参见本合同第二十章“集合计划费用与税收”。</p> <p>4、托管费：0.02%/年。</p>	<p>十、本集合计划的主要费用及费率</p> <p>1、参与费：0%。</p> <p>2、退出费：在一定情况下，本集合计划收取退出费，参见本合同第十二章“集合计划的参与和退出”。</p> <p>3、管理费：由固定管理费和业绩报酬（如有）组成，其中固定管理费的费率为0.5%/年，业绩报酬具体参见本合同第二十章“集合计划费用与税收”。</p> <p>4、托管费：0.02%/年。</p>
第十二章 集合计划 的参与和 退出	<p>二、集合计划的退出</p> <p>.....</p> <p>（四）退出金额的计算方式</p> <p>退出金额=退出份额×T日集合计划每份额净值-业绩报酬</p> <p>退出费用=退出金额×退出费率</p> <p>净退出金额=退出金额-退出费用</p>	<p>二、集合计划的退出</p> <p>.....</p> <p>（四）退出金额的计算方式</p> <p>退出金额=退出份额×T日集合计划每份额净值-业绩报酬（如有）</p> <p>退出费用=退出金额×退出费率</p>



	<p>退出费用的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。</p> <p>退出集合计划的有效金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。</p> <p>.....</p> <p>(六) 退出费用及其用途</p> <p>集合计划退出费主要用于支付开展退出业务必要的手续费，退出费率如下：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>持有限期 (D)</th><th>退出费率</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>D < 365 天</td><td>1. 0%</td></tr> <tr> <td>365 天 ≤ D</td><td>0%</td></tr> <tr> <td>集合计划终止或清算</td><td>0%</td></tr> </tbody> </table> <p>在本集合计划分红权益登记日、委托人退出日或计划终止日，管理人将根据委托人的期间年化收益率 (R)，对期间年化收益率超过 0%以上部分（不含）按照 20%的比例收取管理人业绩报酬。</p> <p>委托人退出时的管理人业绩报酬计算方法依照本合同第二十章“集合计划费用与税收”中与业绩报酬相关的部分。</p>	持有限期 (D)	退出费率	D < 365 天	1. 0%	365 天 ≤ D	0%	集合计划终止或清算	0%	<p>率</p> <p>净退出金额 = 退出金额 - 退出费用</p> <p>退出费用的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。</p> <p>退出集合计划的有效金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。</p> <p>.....</p> <p>(六) 退出费用及其用途</p> <p>集合计划退出费主要用于支付开展退出业务必要的手续费，退出费率如下：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>持有限期 (D)</th><th>退出费率</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td>D < 365 天</td><td>1. 0%</td></tr> <tr> <td>365 天 ≤ D</td><td>0%</td></tr> <tr> <td>集合计划终止或清算</td><td>0%</td></tr> </tbody> </table>	持有限期 (D)	退出费率	D < 365 天	1. 0%	365 天 ≤ D	0%	集合计划终止或清算	0%
持有限期 (D)	退出费率																	
D < 365 天	1. 0%																	
365 天 ≤ D	0%																	
集合计划终止或清算	0%																	
持有限期 (D)	退出费率																	
D < 365 天	1. 0%																	
365 天 ≤ D	0%																	
集合计划终止或清算	0%																	
第二十章 集合计划 费用与税	<p>三、 管理费</p> <p>1、 固定管理费的计算和提取</p> <p>固定管理费按前一日集合计划资产净值的</p>	<p>三、 管理费</p> <p>1、 固定管理费的计算和提取</p> <p>固定管理费按前一日集</p>																

收	<p>2. 0%年费率计提。计算方法为：</p> $H = E \times 2.0\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日集合计划应计提的固定管理费； E 为前一日集合计划资产净值。</p> <p>管理人的固定管理费每日计算，逐日累计，每季度支付一次，当季固定管理费的支付，由管理人于次季度首日起七个工作日内向托管人发送固定管理费划款指令，托管人复核后按照指令从集合计划资产中一次性支付给管理人。</p> <p>管理人有权根据市场情况调低固定管理费率和支付频率，并及时向投资者披露。</p> <p>2、业绩报酬的计算和提取</p> <p>1、业绩报酬的计提原则</p> <p>(1) 按委托人每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p>(2) 在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红权益登记日、委托人退出日或计划终止日计提业绩报酬。</p> <p>(3) 集合计划分红权益登记日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金。在委托人退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。</p> <p>(4) 在委托人退出或计划终止时，业绩报酬按委托人退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余部分不受影响。</p>	<p>合计计划资产净值的 0.5%年费率计提。计算方法为：</p> $H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日集合计划应计提的固定管理费； E 为前一日集合计划资产净值。</p> <p>管理人的固定管理费每日计算，逐日累计，每季度支付一次，当季固定管理费的支付，由管理人于次季度首日起七个工作日内向托管人发送固定管理费划款指令，托管人复核后按照指令从集合计划资产中一次性支付给管理人。</p> <p>管理人有权根据市场情况调低固定管理费率和支付频率，并及时向投资者披露。</p> <p>2、业绩报酬的计算和提取</p> <p>本集合计划不提取业绩报酬。</p> <p>管理人收取固定管理费和业绩报酬（如有）的账户为：</p> <p>账户名称（接收管理费）：华菁证券有限公司</p>
---	--	--

	<p>(5) 业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，但因投资者退出资产管理计划，按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。</p> <p>2、业绩报酬计提方法</p> <p>业绩报酬计提日为本集合计划分红权益登记日、委托人退出日或计划终止日。业绩报酬的计提，以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（以下简称“上一个业绩报酬计提日”，如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提，推广期参与的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内参与的，以参与当日为上一个业绩报酬计提日，下同）至本次业绩报酬计提日的期间为准。委托人退出时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔参与份额应收的管理人业绩报酬。</p> <p>(1) 期间年化收益率计算</p> <p>期间年化收益率 $R = [(P_1 - P_0) / P_{0x}] \times (365 \div T)$</p> <p>P₁=委托人本次业绩报酬计提日的份额累计净值</p> <p>P₀=委托人上一个业绩报酬计提日的份额累计净值</p> <p>P_{0x}=委托人上一个业绩报酬计提日的份额净值</p> <p>T=委托人上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数</p> <p>(2) 管理人以超额比例的方式提取业绩报</p>	<p>账 号：121922106810206</p> <p>开户银行：招商银行上海分行</p> <p>营业部</p>
--	---	--

酬

管理人根据期间年化收益率对收益率超过 0% 以上部分（不含）按照 20% 的比例收取管理人业绩报酬。具体计算方式如下：

期间年化收益	收取比例	管理人业绩报酬计算公式
$R \leq 0\%$	0	$E = 0$
$0\% < R$	20%	$E = N \times P_0 \times R \times 20\% \times (T \div 365)$

E =该笔参与对应的管理人业绩报酬

N = 委托人该笔参与在上一个业绩报酬计提日的份额数

(3) 将所有参与笔数的管理人业绩报酬加总，得到总的管理人业绩报酬 (ΣE)。

$$\Sigma E = E_1 + E_2 + E_3 + \dots + E_n$$

其中的 n 为所对应的参与笔数。

(4) 管理人业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不承担复核业绩报酬的责任。

管理人收取固定管理费和业绩报酬的账户为：

账户名称（接收管理费）：华菁证券有限公司

账号：121922106810206

开户银行：招商银行上海分行营业部

.....

五、其他事项。

	<p>银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费，在发生时一次计入集合计划费用。</p> <p>与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，不影响集合计划份额净值的，或者无法对应到相应会计期间，可以一次计入集合计划费用；如果金额较大，影响集合计划份额净值的，并且可以对应到相应会计期间，应该在该会计期间内按直线法摊销。</p> <p>.....</p>	
	<p>.....</p> <p>五、其他事项。</p> <p>银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费，在发生时一次计入集合计划费用。</p> <p>与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，不影响集合计划份额净值的，或者无法对应到相应会计期间，可以一次计入集合计划费用；如果金额较大，影响集合计划份额净值的，并且可以对应到相应会计期间，可以在该会计期间内按直线法摊销。</p> <p>.....</p>	
第二十七

章 集合 计划展期	<p>五、展期的安排</p> <p>(一) 同意本集合计划展期的委托人的人数不少于 2 人；在原存续期届满日后第 1 个工作日，本集合计划参与资金总额不低于 1 千万元人民币，则本集合计划展期将于原存续期届满后第 1 个自然日成立。</p> <p>经会计师事务所对本集合计划进行验资，并出具验资报告，管理人在存续期届满后 1 个自然日之内公告本集合计划展期成立。</p>	<p>五、展期的安排</p> <p>(一) 同意本集合计划展期的委托人的人数不少于 2 人，且不超过 200 人；在原存续期届满日后第 1 个工作日，本集合计划参与资金总额不低于 1 千万元人民币，则本集合计划展期。</p>
第二十八 章 集合 计划终止 和清算	<p>一、各方一致同意，出现下列情形之一时，本集合计划应当终止：</p> <p>.....</p> <p>【委托人同意，如本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可（但因上述第 4 项原因终止除外），并应予以披露。】</p> <p>管理人应当自本集合计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金管理业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第 7 项约定的情形除外。</p> <p>二、在本集合计划在发生终止情形之日起 5 个工作日内开始组织清算集合计划资产以及财产清算的有关事项。</p> <p>1、管理人负责成立清算小组组织清算工</p>	<p>一、各方一致同意，出现下列情形之一时，本集合计划应当终止：</p> <p>.....</p> <p>【委托人同意，如本集合计划在终止之日有未变现的证券，管理人可针对该部分未变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可（但因上述第 4 项原因终止除外），并应予以披露。】</p> <p>管理人应当自本集合计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金管理业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第 7 项约定的情形除外。</p> <p>二、在本集合计划在发生终止</p>

	<p>作。清算小组由管理人和托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员。</p> <p>2、本集合计划清算小组负责集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法进行必要的民事活动。</p> <p>3、清算结束后 7 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除本集合计划清算费用、管理费、业绩报酬（如有）、托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式分配给委托人。托管人应及时注销本集合计划的证券账户，管理人应配合托管人办理账户注销相关事宜。</p> <p>4、本集合计划财产清算应按以下程序进行：</p> <ul style="list-style-type: none"> (1) 当本集合计划终止后，对集合计划资产进行清理和确认； (2) 对集合计划资产进行评估和变现； (3) 聘请具有证券从业资格的会计师事务所进行审计； (4) 将清算结果报证券投资基金管理业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构； (5) 将清算结果通告委托人； (6) 对集合计划资产进行分配。 <p>5、如本集合计划在终止之日起有未能流通变现的证券，管理人应根据本合同本章第一条所述的二次清算方案的规定确定二次清算方案，对该等未能流通变现的证券在可流通变</p>	<p>情形之日起 5 个工作日内开始组织清算集合计划资产以及财产清算的有关事项。</p> <p>1、管理人负责成立清算小组组织清算工作。清算小组由管理人和托管人组成，清算小组可以聘用必要的工作人员。</p> <p>2、本集合计划清算小组负责集合计划资产的保管、清理、估价和分配。清算小组可以依法进行必要的民事活动。</p> <p>3、清算结束后 7 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除本集合计划清算费用、管理费、业绩报酬(如有)、托管费、税费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式分配给委托人。</p> <p>4、本集合计划财产清算应按以下程序进行：</p> <ul style="list-style-type: none"> (1)当本集合计划终止后，对集合计划资产进行清理和确认； (2)对集合计划资产进行评估； (3)对集合计划资产进行分配。 (4)聘请具有证券相关从业
--	---	--

	<p>现后进行变现和二次清算，并将变现后的资产按照委托人持有本集合计划份额的比例或按本合同约定，以货币形式全部分配给委托人。二次清算期间不计提管理费和托管费。</p> <p>本集合计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当于五个工作日内向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p> <p>6、清算费用是指管理人在进行资产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由管理人优先从集合计划清算资产中支付。</p> <p>7、管理人应当在清算结束后五个工作日内，将清算结果告知委托人、报证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p> <p>8、集合计划清算账册及有关文件由集合计划管理人、托管人、推广机构按相关法律、法规规定年限妥善保存，保存期不少于 20 年。</p>	<p>资格的会计师事务所进行审计。</p> <p>5、如本集合计划在终止之日有未变现的证券，管理人应根据本合同本章第一条所述的二次清算方案的规定确定二次清算方案，对该等未变现的证券在变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人持有本集合计划份额的比例或按本合同约定，以货币形式全部分配给委托人。二次清算期间不计提管理费和托管费。本集合计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当于五个工作日内向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p> <p>6、清算费用是指管理人在进行资产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由管理人优先从集合计划清算资产中支付。</p> <p>7、管理人应当在清算结束后五个工作日内，将清算结果告知委托人、报证券投资基金业协会备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。</p> <p>管理人或销售机构在本计划</p>
--	---	--

		<p>清算结束后 5 个工作日内，将清算结果按照委托人提供的联系方式或由管理人通过管理人网站告知委托人。</p> <p>8、计划财产清算完毕后，托管人、管理人应按照相关规定注销本计划托管账户、证券账户及其他本计划投资所需账户，并互相给予必要的配合。</p> <p>9、集合计划清算账册及有关文件由集合计划管理人、托管人、推广机构按相关法律、法规规定年限妥善保存，保存期不少于 20 年。</p>
第三十三 章 风险 揭示	<p>.....</p> <p>17、特殊风险</p> <p>本集合计划存在规模和人数限制，当集合计划规模或人数接近或达到上限时，存在委托人参与失败的风险。</p> <p>初次参与本集合计划的最低金额为人民币 100 万元（不含参与费），对本集合计划份额的持有人，其新增参与资金的最低金额为【10】万元人民币，可能导致委托人参与失败的风险。</p> <p>委托人可以选择全部退出，也可以选择部分退出，但在退出后持有的资产净值不得低于监管要求的本集合计划最低申购金额限制。即当份额持有人申请部分退出集合计划份额将致使其在部分退出申请确认后持有的</p>	<p>.....</p> <p>17、特殊风险</p> <p>本集合计划存在规模和人数限制，当集合计划规模或人数接近或达到上限时，存在委托人参与失败的风险。</p> <p>初次参与本集合计划的最低金额为人民币 100 万元（不含参与费），对本集合计划份额的持有人，其新增参与资金的最低金额为【10】万元人民币，可能导致委托人参与失败的风险。</p> <p>委托人可以选择全部退出，也可以选择部分退出，但</p>

	<p>以开放日计划份额净值计价的集合计划资产净值低于监管要求的本集合计划最低参与金额，则管理人自动将该委托人在该推广机构的集合计划全部份额退出给委托人，可能导致委托人退出失败或被强制退出的风险。</p> <p>因本集合计划收取管理人业绩报酬，存在委托人对实际得到的分红金额或退出金额有疑问的风险。在极端情况下，因某笔参与的分红资金小于或等于管理人业绩报酬时，委托人该笔参与实际得到的分红金额可能为零。</p> <p>因本集合计划委托人人数少、参与金额高，存在个别委托人退出导致集合计划巨额退出或提前终止的风险。</p>	<p>在退出后持有的资产净值不得低于监管要求的本集合计划最低申购金额限制。即当份额持有人申请部分退出集合计划份额将致使其在部分退出申请确认后持有的以开放日计划份额净值计价的集合计划资产净值低于监管要求的本集合计划最低参与金额，则管理人自动将该委托人在该推广机构的集合计划全部份额退出给委托人，可能导致委托人退出失败或被强制退出的风险。</p> <p>因本集合计划委托人人数少、参与金额高，存在个别委托人退出导致集合计划巨额退出或提前终止的风险。</p>
--	---	--

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 2020 年 8 月 3 日，该集合资产管理计划在 2020 年 8 月 3 日为赎回开放日，委托人不同意合同变更的，需在 2020 年 8 月 3 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 2020 年 8 月 4 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。

另，管理人自有资金参与集合计划持有期限已超过 6 个月，若届时因客户赎回导致管理人自有资金参与集合计划被动超限，管理人将同步于该开放日退出部分自有资金份额。

特此公告。



(2)