

华兴证券多策略 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同变更意见征询通知

上海银行股份有限公司：

由贵行担任资产托管人、我公司担任资产管理人的“华兴证券多策略 FOF1 号集合资产管理计划”（以下简称“本计划”）成立于 2020 年 3 月 13 日。基于监管规则变化及本计划运作需要，我公司拟变更《华兴证券多策略 FOF1 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》”）部分条款。

本次《资产管理合同》修订内容包括：

上海银行股份有限公司

章节	原文	修订
全文	<p>商品及金融衍生品类</p> <p>具有证券相关业务资格的会计师事务所</p>	<p>期货和衍生品类</p> <p>符合《证券法》规定的会计师事务所</p>
第二章 释义	<p>(九) 《管理办法》：指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[第151号]）。</p> <p>(十) 《运作规定》：指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2018]31号）。</p> <p>(十一) 《合同指引》：指《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》。</p> <p>(二十八) 本合同生效日、资产管理计划成立日：指资产管理计划初始募集期结束并完成验资，经资产管理人公告本计划成立之日。</p> <p>(二十九) 工作日、交易日、估值日：均指推广期内各推广机构的工作日，或本集合计划成立后上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所等期货交易所的共同正常交易日。</p> <p>(四十五) 私募资产管理业务托管年度报告：指托管人根据《管理办法》第七十三条规定编制并向中国证监会相关派出机构和基金业协会报送的有关托管人私募资产管理产品整体托管业务情况的年度报告，该报告不向本资产管理计划委托人及管理人提供。</p>	<p>(九) 《管理办法》：指中国证监会于2023年3月1日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[第203号]）。</p> <p>(十) 《运作规定》：指中国证监会于2023年3月1日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2023]2号）。</p> <p>(十一) 《合同指引》：指《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》。</p> <p>(二十八) 本合同生效日、资产管理计划成立日：指资产管理计划初始募集期结束，经资产管理人公告本计划成立之日。</p> <p>(二十九) 工作日、交易日、估值日：均指推广期内各推广机构的工作日，或本集合计划成立后上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、中国金融期货交易所等期货交易所的共同正常交易日。</p> <p>(四十五) 私募资产管理业务托管年度报告：指托管人根据《管理办法》第七十三条规定编制并向中国证监会相关派出机构报送的有关托管人私募资产管理产品整体托管业务情况的年度报告，该报告不向本资产管理计划委托人及管理人提供。</p>
第四部分 当事人及权	<p>一、合同当事人</p> <p>(三) 托管人</p> <p>名称：上海银行股份有限公司</p>	<p>一、合同当事人</p> <p>(三) 托管人</p> <p>名称：上海银行股份有限公司</p>

<p>利义务</p>	<p>住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号 联系人：赵涵宇 通讯地址：上海市浦东新区银城中路168号42楼资产托管部 联系电话：021-68475888</p> <p>六、管理人的义务包括但不限于： （二十一）根据法律法规与本合同约定，编制向委托人披露的本计划季度、年度等定期报告，向协会备案，并抄报证监会相关派出机构；</p> <p>八、托管人的义务包括但不限于： （九）编制私募资产管理业务托管年度报告，并向协会备案，抄报中国证监会相关派出机构； （十四）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，立即通知管理人纠正，管理人拒不纠正的，应及时报告中国证监会相关派出机构和协会；</p>	<p>住所：上海市黄浦区中山南路688号 联系人：赵涵宇 通讯地址：上海市浦东新区银城中路168号37楼资产托管部 联系电话：021-68475888</p> <p>六、管理人的义务包括但不限于： （二十一）根据法律法规与本合同约定，编制向委托人披露的本计划季度、年度等定期报告，报送证监会相关派出机构；</p> <p>八、托管人的义务包括但不限于： （九）编制私募资产管理业务托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构； （十四）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，立即通知管理人纠正，管理人拒不纠正的，应及时报告中国证监会相关派出机构；</p>
<p>第六部分计划的募集</p>	<p>一、本计划的募集对象 （三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构； （五）基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；</p>	<p>一、本计划的募集对象 （三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业保理公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构； （五）基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；</p>

第七部分本计划的成立与备案	<p>二、本计划的募集金额缴足之日起10个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告本计划成立。管理人应在本计划成立之日起5个工作日内报协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。本计划成立日前，任何机构和任何个人不得动用投资者参与资金。</p>	<p>二、本计划的募集金额缴足之日起10个工作日内，管理人通过管理人网站公告本计划成立。管理人应在本计划成立日起5个工作日内报协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。本计划成立日前，任何机构和任何个人不得动用投资者参与资金。</p>
第八部分本计划的参与、退出与转让	<p>十六、管理人以自有资金参与本计划 (三) 自有资金参与的份额比例 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有新规定的，本集合计划应在符合法律法规及本合同约定的前提下进行调整。 (四) 自有资金的退出 集合计划存续期间，管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于6个月。参与、退出时，应当提前5个工作日告知委托人和托管人，并取得其同意。管理人决定在存续期参与、退出的可以通过管理人网站、电子邮件、信函等一种或多种方式向投资者征求意见，若投资者不同意管理人参与、退出的，投资者应当在退出开放日办理退出手续。若投资者未按照规定申请退出，则视为同意管理人参与、退出本集合计划。当出现巨额退出时，为解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，管理人及其子公司可以自有资金参与或退出计划可不受前述比例、持有期限及取得委托人和托管人同意的限制，但需及时告知委托人和托管人，并向住所地中国证监会派出机构报告。 委托人同意，集合计划存续期内当法律法规或有关针对自有资金投资集合计划的政策发生变化时，管理人经与托管人协商，</p>	<p>十六、管理人以自有资金参与本计划 (三) 自有资金参与的份额比例 管理人及其子公司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40%(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有新规定的，本集合计划应在符合法律法规及本合同约定的前提下进行调整。 (四) 自有资金的退出 集合计划存续期间，管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于6个月。参与、退出时，应当提前5个工作日告知委托人和托管人，并取得其同意。管理人决定在存续期参与、退出的可以通过管理人网站、电子邮件、信函等一种或多种方式向投资者征求意见，若投资者不同意管理人参与、退出的，投资者应当在退出开放日办理退出手续。若投资者未按照规定申请退出，则视为同意管理人参与、退出本集合计划。当出现巨额退出时，为解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，管理人及其子公司可以自有资金参与或退出计划可不受前述比例、持有期限及取得委托人和托管人同意的限制，但需及时告知委托人和托管人，并向住所地中国证监会派出机构。 委托人同意，集合计划存续期内当法律法规或有关针对自有</p>

	<p>可以对本合同及《集合计划说明书》与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，管理人应将更新或修改内容报中国证监会批准或基金业协会备案。更新或修改的内容在管理人网站信息披露满5个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效后按照本合同的规定申请退出集合计划，委托人未退出的，视为同意更新或修改。</p>	<p>投资集合计划的政策发生变化时，管理人经与托管人协商，可以对本合同及《集合计划说明书》与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，管理人应将更新或修改内容报中国证监会批准或基金业协会备案。更新或修改的内容在管理人网站信息披露满5个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效后按照本合同的规定申请退出集合计划，委托人未退出的，视为同意更新或修改。</p>
	<p>二、本资产管理计划的投资范围及比例 投资比例（占集合计划资产总值）： 新增以下条款： 本集合计划属于期货和衍生品类资产管理计划，在存续期间，投资于对应类别资产的比例可以低于计划总资产的80%，但不得持续6个月低于计划总资产的80%。</p>	<p>为规避流动性风险、信用风险和利率风险，经全体投资者同意</p>
<p>第十一部分 资产管理计划的投资</p>	<p>三、投资比例超限的处理方式及流程 本集合计划的建仓期自本计划成立日起不超过6个月，管理人将在集合计划成立日起6个月内，使集合计划的投资组合比例符合上述约定。因证券市场波动、投资对象合并、集合计划规模变动等外部因素，致使本集合计划的投资比例不符合上述约定的，管理人将在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的15个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向所在地中国证监会派出机构及基金业协会报告。</p>	<p>三、投资比例超限的处理方式及流程 本集合计划的建仓期自本计划成立日起不超过6个月，管理人将在集合计划成立日起6个月内，使集合计划的投资组合比例符合上述约定。因证券市场波动、投资对象合并、集合计划规模变动等外部因素，致使本集合计划的投资比例不符合上述约定的，管理人将在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的20个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向所在地中国证监会派出机构报告。</p>
	<p>七、本资产管理计划的投资策略 (二) 决策程序 5、全程监控投资风险 资管内控小组依据相关法律法规、集合计划的合同与说明书</p>	<p>七、本资产管理计划的投资策略 (二) 决策程序 5、全程监控投资风险 资管内控小组依据相关法律法规、集合计划的合同与说明书</p>

<p>第十三部分 利益冲突及关联交易</p>	<p>等制定集合计划的《风险控制指引书》，并经公司风险管理部、投资经理、交易员确认后四方签字确认，作为风险控制的重要文件。</p> <p>在投资决策过程中，风险管理部负责配合资产管理事业部对集合计划的投资限制、市场风险、流动性风险及信用风险等投资风险进行事前评估、事中监控以及事后跟踪分析，并在整个投资流程完成后，对投资风险及绩效做出评估，提供给投资主办人等相关人员，并对投资组合的调整进行监督。</p> <p>八、投资限制和投资禁止</p> <p>(一) 投资限制</p> <p>新增以下条款：</p> <p>4、除投资于国债、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外，发生投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过本计划净资产 50% 的情况期间，本计划的总资产不得超过超过净资产的 120%。</p> <p>5、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，本计划申报的金额不得超过本计划的总资产，且申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p>	<p>等制定集合计划的《风险控制指引书》，作为风险控制的重要文件。</p> <p>在投资决策过程中，资产管理部负责将资产管理业务纳入全面风险管理体系，负责对资管业务风险情况进行二级评估、监控。</p>
	<p>一、关联交易及利益冲突情形</p> <p>(一) 在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定并严格遵守管理人内部有关投资决策管理及关联交易管理等制度的前提下，本产品可能投资于管理人、托管人及其关联方所发行的管理、保管、托管、销售或存在其他法律关系或利益联系的金融产品，或者与该等金融产品以公平合理的价格进行交易。</p> <p>委托人在此同意并授权可以将集合计划资产部分投资于由管理人关联方（及其母公司的关联方）发行或代销或管理的金融产品（包括但不限于资产管理产品），以及由管理人提供专业服务（包括但不限于作为管理人、投资顾问等）的金融产品（包括但不限于资产管理产品）。但需要遵循委托人利益优先的原则、防范利益冲突，保护委托人合法权益。特别地，本集合计划为 FOF 产品，</p>	<p>一、本计划存在或可能存在利益冲突情形包括但不限于：</p> <p>1、本计划运作过程中从事关联交易；</p> <p>2、其他可能存在利益冲突的情形。</p> <p>二、本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率</p> <p>出现上述利益冲突情形的，管理人应当遵循委托人利益优先原则处理利益冲突，并在符合法律法规和监管政策的前提下，根据具体情况选择在定期报告中披露或进行临时信息披露。</p> <p>三、本计划从事关联交易情形</p> <p>(一) 关联交易的决策与定价机制</p> <p>本计划进行关联交易前应当履行必要审批决策程序。</p> <p>本计划的关联交易应当优先以市场价格作为基准，遵循独立</p>

<p>于设立之时，暂未确定金融产品方面的具体投资标的。本集合计划于成立之后、并完成金融产品投资后，如涉及关联交易，将披露关联交易相关情况。</p> <p>二、本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式和披露内容和披露频率</p>	<p>交易原则，选用合理的且被行业广泛应用的合理定价方法。</p> <p>(二) 关联交易的范围</p> <p>本计划的关联交易包括但不限于：</p> <p>1、投资于管理人、托管人及其各自的关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>2、投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理计划；</p> <p>3、以本计划的关联方为交易对手进行的交易，以及质押券涉及及本计划关联方的，包括但不限于银行间市场交易、大宗交易等；</p> <p>4、法律法规、监管机构及行业自律机构规定的其他关联交易情形。</p> <p>(三) 本计划关联方的范围</p> <p>本计划的关联方包括：</p> <p>1、管理人及其管理的其他资产管理计划；</p> <p>2、管理人及其关联方，其关联方范围及认定依据《华兴证券有限公司关联交易管理办法》的规定执行；</p> <p>3、托管人及其关联方（具体名单以托管人提供给管理人的名单为准）；</p> <p>(四) 重大关联交易</p> <p>本计划从事重大关联交易的情形包括：</p> <p>1、本计划投资于管理人、托管人及其各自的关联方发行或承销期内承销的证券的余额超过计划净资产规模20%（含），且金额超过人民币500万元（不含）；</p> <p>2、本计划投资于管理人及其关联方管理的单只资产管理计划金额超过该单个资产管理计划净资产规模20%（含），且金额超过人民币500万元（不含）；</p> <p>3、以本计划关联方作为交易对手进行的其他交易，单笔交易</p>
<p>于设立之时，暂未确定金融产品方面的具体投资标的。本集合计划于成立之后、并完成金融产品投资后，如涉及关联交易，将披露关联交易相关情况。</p> <p>二、本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式和披露内容和披露频率</p>	<p>(一) 管理人将本计划资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券的，管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循委托人利益优先原则，事后告知委托人和托管人，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护委托人合法权益。在集中交易市场交易的，由管理人参考最近成交价格确定公允价格，在非集中交易市场交易的，由管理人与交易方在不违反公平交易、不进行利益输送等合法合规原则下，协商确定交易价格。如有第三方权威机构定价的，可参考第三方权威机构的定价。</p> <p>管理人以本计划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。</p> <p>本计划从事重大关联交易的，管理人应依法向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应应当向证券期货交易所报告。</p> <p>(二) 委托人授权并同意管理人从事前文已经明确列明的关联交易（含重大关联交易），委托人签署本合同即表明其已经充分理解并对前述关联交易（含重大关联交易）作出事先同意及授权，在发生具体关联交易时，管理人无需就另行取得委托人的事先授权，委托人不得因本集合计划投资收益劣于管理人或托管人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求，但该等关联交易投资应按照市</p>

场通行的方式和条件参与，公平对待本计划财产，防止利益冲突，不得损害委托人利益。

(三) 本计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，管理人应当坚持委托人利益优先原则，从充分维护委托人利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，管理人应当视具体利益冲突情形选择在向委托人提供的定期报告或临时报告中进行披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对资产委托人利益的影响等。

四、管理人运用计划资产从事关联交易的，应事后及时、全面、客观的向委托人和托管人进行披露。

五、托管人应根据管理人要求提供托管人关联方信息，并确保提供或提供的信息真实、准确、完整。如果因托管人未及时向管理人提供投资是否构成关联交易的，管理人不承担相关责任，托管人应依法承担责任。

金额超过本计划净资产规模 20% (含)，且金额超过人民币 500 万元 (不含)。

4、本计划参与逆回购交易，质押券中公司、托管人及其各自的关联方发行的证券的质押券金额余额超过单个资产管理计划净资产规模 20%且金额超过人民币 500 万元 (不含)。

资产管理计划从事重大关联交易的，管理人应事先就该笔重大关联交易取得委托人同意。管理人应当通过本合同约定的信息披露方式向全体委托人征求意见，若委托人不同意该笔重大关联交易，应当按照信息披露文件中指定的时间和方式向管理人反馈不同意的意见；如委托人未在限定时间内或未通过指定方式反馈不同意见的，视为该委托人同意该笔重大关联交易。

(五) 一般关联交易

除重大关联交易以外的关联交易，均为一般关联交易。

委托人授权并同意管理人从事前文所述之一般关联交易，委托人签署本合同即表明其已经充分理解并对前述一般关联交易作出事先同意及授权，在发生具体一般关联交易时，管理人无需另于管理人或托管人及其他关联方管理的其他类似投资产品，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求，但该等一般关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待本计划财产，防止利益冲突，不得损害委托人利益。

(六) 本计划在投资运作过程中存在关联交易的，管理人应当依照法律法规、监管规定、自律组织规则及交易所等有权机构报告或备案，并依法通过定期报告或临时报告等形式进行相关披露。

(七) 若管理人对关联交易内部控制制度进行修订，修订后

		<p>的制度中关联方范围、关联交易范围、重大关联交易与一般关联交易的标准与合同约定不一致的，取二者孰严执行。</p> <p>(八) 如法律法规、监管机构或行业自律协会对资产管理计划关联方、关联交易的范围以及重大关联交易与一般关联交易的标准与本合同或管理人内部控制制度约定不一致的，按照法律法规、监管机构或行业自律协会的最新发布或要求执行。</p> <p>(九) 管理人运用计划资产从事关联交易的，应事后及时、全面、客观的向委托人和托管人进行披露。管理人运用计划资产从事重大关联交易的，应当按照法律法规、监管机构或行业自律协会发布的要求或规定单独进行信息披露和报告。</p> <p>(十) 托管人应根据管理人要求提供托管人关联方信息，如果因托管人未及时向管理人提供或提供的信息不准确导致管理人无法审查相关投资是否构成关联交易的，管理人不承担相关责任。</p>
<p>第十四部分 投资经理的指定及变更</p>	<p>二、本计划的投资经理的资料如下： 于洋，同济大学经济学学士，上海外国语大学国际贸易学硕士。华兴证券资产管理事业部投资经理，加入华兴证券前，曾就职于申港证券固定收益部。具有基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p>	<p>二、本计划的投资经理的资料如下： 黄铸哲，华兴证券资产管理事业部投资经理，对外经济贸易大学经济学学士，北京大学金融硕士。加入华兴证券前，曾就职于农银理财有限责任公司。投资经理已取得基金从业资格，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p>
<p>第十五部分 资产管理计划的财产</p>	<p>(六) 非现金类财产的保管 2. 投资于《管理办法》第三十七条第(五)项规定资产(如有)及其他非现金类财产的保管 本计划投资于《管理办法》第三十七条第(一)至(三)项规定以外的非标准化债权类资产、股权类资产、商品及金融衍生品类资产等其他非现金类资产时，管理人应于完成投资后及时办理计划资产的确权事宜，负责保管相关权利凭证(如有)及行权依据，并及时将相关权利凭证及行权依据的复印件或扫描件交付托管人。</p>	<p>(六) 非现金类财产的保管 2. 投资于《管理办法》第三十八条第(五)项规定资产(如有)及其他非现金类财产的保管 本计划投资于《管理办法》第三十八条第(一)至(三)项规定以外的非标准化债权类资产、股权类资产、期货和衍生品类资产等其他非现金类资产时，管理人应于完成投资后及时办理计划资产的确权事宜，负责保管相关权利凭证(如有)及行权依据，并及时将相关权利凭证及行权依据的复印件或扫描件交付托管人。</p>

<p>第十七部分 越权交易的界定</p>	<p>托管人。</p> <p>二、越权交易的处理程序</p> <p>(一) 对于托管人承诺监督的越权交易，托管人发现管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并应当依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构或基金业协会。</p> <p>(二) 对于托管人承诺监督的越权交易，托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知管理人，并应依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构或基金业协会。因托管人执行该指令（托管人有过错的除外）造成的直接损失由管理人依法承担责任。</p> <p>(三) 管理人应向托管人主动报告越权交易。托管人应当督促管理人在限期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构或基金业协会。</p>	<p>二、越权交易的处理程序</p> <p>(一) 对于托管人承诺监督的越权交易，托管人发现管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并应当依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构。</p> <p>(二) 对于托管人承诺监督的越权交易，托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知管理人，并应依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构。因托管人执行该指令（托管人有过错的除外）造成的直接损失由管理人依法承担责任。</p> <p>(三) 管理人应向托管人主动报告越权交易。托管人应当督促管理人在限期内改正并在该期限内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构。</p>
	<p>三、托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>(一) 托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人的投资行为进行监督：</p> <p>1. 对本合同约定的投资范围进行监督；</p> <p>本集合计划属于商品及金融衍生品类 FOF 产品。投资范围包括：</p> <p>(1) 公开募集证券投资基金、其他受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品（包括经中国证监会核准的证券投资基金、证券投资基金管理人的私募基金管理人发行的私募证券投资基金、基金及基金子公司发行的资产管理计划、证券公司资产管理计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、集合信托计划、商业银行理财产品等）。</p>	<p>三、托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>(一) 托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人的投资行为进行监督：</p> <p>1. 对本合同约定的投资范围进行监督；</p> <p>本集合计划属于期货和衍生品类 FOF 产品。投资范围包括：</p> <p>(1) 公开募集证券投资基金、其他受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品（包括经中国证监会核准的证券投资基金、基金及基金子公司发行的资产管理计划、证券公司资产管理计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、集合信托计划、商业银行理财产品等）。</p>

<p>(2) 固定收益类资产：银行存款，同业存单，国债，央行票据，地方政府债，金融债（含次级债，混合资本债），公司债（含非公开发行），企业债（含非公开发行），中期票据，短期融资券（含超短期融资券），非公开发行向债务融资工具，沪深交易所挂牌交易的资产支持证券（ABS）优先级（穿透至底层资产不得为产品），资产支持票据（ABN），可转换，分离交易可转债，可交换债，债券正回购，债券逆回购。</p> <p>(3) 中国证监会认可的其他投资品种。</p> <p>投资比例（占集合计划资产总值）：</p> <p>本集合计划投资于国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品的比例不低于集合计划资产总值的 80%；管理人将根据具体投资资产的投资限制，合理分配各资产占资产管理计划总值的比例，以保证所投向的最终资产满足上述投资比例要求。对于“沪深交易所挂牌交易的资产支持证券（ABS）优先级（穿透至底层资产不得为产品）”由管理人自行监督。</p> <p>2. 对本计划以下投资限制进行监督：</p> <p>(1) 集合计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%，中国证监会另有规定的除外。</p>	<p>(2) 固定收益类资产：银行存款，同业存单，国债，央行票据，地方政府债，金融债（含次级债，混合资本债），公司债（含非公开发行），企业债（含非公开发行），中期票据，短期融资券（含超短期融资券），非公开发行向债务融资工具，沪深交易所挂牌交易的资产支持证券（ABS）优先级（穿透至底层资产不得为产品），资产支持票据（ABN），可转换，分离交易可转债，可交换债，债券正回购，债券逆回购。</p> <p>(3) 中国证监会认可的其他投资品种。</p> <p>投资比例（占集合计划资产总值）：</p> <p>(1) 本集合计划投资于国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品的比例不低于集合计划资产总值的 80%；</p> <p>(2) 固定收益类资产占资产管理计划总资产的比例低于 80%；</p> <p>(3) 权益类资产占资产管理计划总资产的比例低于 80%；</p> <p>(4) 投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产 80%，且衍生品账户权益超过资产管理计划总资产的 20%。</p> <p>2. 对本计划以下投资限制进行监督：</p> <p>(1) 本集合计划投资于其他资产管理产品的，所投资的资产管理产品不再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。</p> <p>(2) 集合计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(3) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资产净值，不得超过该资产的 25%（本 FOF 产品中为本产品持有其全部份额而定制专门于基金的情形，可以豁免同一管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资管产品（即于基金）不得超过该</p>
---	---

资管计划资产的 25%的组合投资要求)。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。

(4) 除投资于国债、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外, 发生投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过本计划净资产 50% 的情况期间, 本计划的总资产不得超过净资产的 120%。

(5) 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, 本计划申报的金额不得超过本计划的总资产, 且申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

本集合计划投资于其他资产管理产品的, 计算本集合计划的总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。

本集合计划投资于其他私募资产管理产品的, 按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的余额。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制, 履行合同变更程序后, 本集合计划可相应调整投资组合限制的规定, 则本集合计划不受上述限制。

本集合计划的建仓期自产品成立之日起不超过 6 个月, 管理人将在集合计划成立之日起 6 个月内, 使集合计划的投资组合比例符合上述约定。因证券市场波动、投资对象合并、集合计划规模变动等外部因素, 致使本集合计划的组合投资比例不符合上述约定的, 管理人将在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易后的 20 个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的, 管理人应当及时向所在地中国证监会派出机构报告。

本集合计划属于期货和衍生品类资产管理计划, 在存续期间,

	<p>为规避流动性风险、信用风险和利率风险，经全体投资者同意后，投资于对应类别资产的比例可以低于计划总资产80%，但不得持续6个月低于计划总资产80%。出现上述情形时，管理人应向托管人提供有关证明材料，托管人根据管理人出具的通知进行监督</p> <p>3. 法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。若法律法规或监管部门取消上述限制，本计划投资可不受上述规定限制。</p> <p>4. 托管人对管理人进行本计划越权交易的监督和检查自本合同生效之日起开始。</p> <p>5. 投资范围或投资限制变更，管理人应以书面形式通知托管人，并应与托管人重新协商调整投资监督事项。</p> <p>6. 托管人越权交易的真实性、准确性、及时性和完整性受限于管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他中介机构提供的数据和信息，合规投资的责任在管理人。</p> <p>7. 托管人进行越权交易监督时，基于本资产管理计划的日持仓和估值结果进行监督。</p>
<p>第二部分披露与报告</p>	<p>六、管理人、托管人向监管机构的报告</p> <p>管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募资产管理业务年度报告和私募资产管理业务托管年度报告，并报中国证监会相关派出机构和基金业协会备案。</p>
<p>第二部分风险揭示</p>	<p>(八) 关联交易风险</p> <p>根据本合同的约定，管理人可以将本集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人或托管人的控股股东、实际控制人或者其他有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，可能存在因管理人未遵循公平原则开展交易，由此损害委托人利益</p> <p>(八) 一般关联交易风险</p> <p>根据本合同的约定，本集合计划可以在取得委托人同意后从事一般关联交易；尽管管理人通过内部控制机制对关联交易进行规范，并将遵循投资者利益优先的原则进行操作，但仍然存在被金融监管部门认定存在利益输送、内幕交易的风险，从而可能影</p>

	<p>响资产管理计划的利益。</p> <p>(九) 重大关联交易风险</p> <p>根据本合同的约定, 本集合计划可以在取得委托人同意后从事重大关联交易; 尽管管理人通过内部控制机制对关联交易进行规范, 并将遵循投资者利益优先的原则进行操作, 但仍然存在被金融监管部门认定存在利益输送、内幕交易的风险, 从而可能影响资产管理计划的利益。此外, 在管理人就重大关联交易征求投资者意见时, 如无法取得全体投资者同意, 则该重大关联交易将无法执行, 从而可能造成本计划不能实施既定投资策略的风险, 进而可能影响资产管理计划的投资收益。</p>
	<p>二、本合同发生变更的, 管理人应按照基金业协会要求及时向基金业协会备案。</p>
<p>第二十三部分 资产管理合同的变更、终止与清算</p>	<p>五、资产管理计划终止的情形, 包括但不限于下列事项:</p> <p>.....</p> <p>管理人应当自本计划终止之日起五个工作日内报告基金业协会: 前述第(六)项约定的情形除外。</p>
	<p>六、资产管理计划的清算</p> <p>(四) 资产管理计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>本集合计划终止后 15 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。</p> <p>(五) 资产管理计划延期清算的处理方式</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</p>

<p>人应当及时向中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p> <p>(六) 资产管理计划财产清算报告的告知安排</p> <p>管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算结果报告基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。</p>	<p>人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>(六) 资产管理计划财产清算报告的告知安排</p> <p>管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算结果报告基金业协会备案。</p>
<p>一、本合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。委托人为法人的，本合同自委托人、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立；委托人为自然人的，合同自委托人本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立（如采用电子方式签署合同的，应该满足相关电子合同签约成立的条件）。</p> <p>本合同自管理人完成本次合同变更程序后生效，具体生效时间以管理人网站披露的合同变更生效公告载明的生效日为准。对截至本次合同变更生效日继续存续的投资者（以下简称“存续投资者”）而言，自本次合同变更生效日起，各方的权利义务关系均以本合同约定为准，原资产管理合同不再执行。</p> <p>对本次合同变更生效后（含生效当日）参与的新投资者（即存续投资者之外的投资者）而言，本合同的生效条件为：</p> <p>(1) 该投资者、管理人、托管人三方纸质签署或以电子签名方式签订本合同并成立；</p> <p>(2) 该投资者参与申请本计划经注册登记机构确认成功。</p>	<p>一、本合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。委托人为法人的，本合同自委托人、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立；委托人为自然人的，合同自委托人本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立（如采用电子方式签署合同的，应该满足相关电子合同签约成立的条件）。</p> <p>本合同自管理人完成本次合同变更程序后生效，具体生效时间以管理人网站披露的合同变更生效公告载明的生效日为准。对截至本次合同变更生效日继续存续的投资者（以下简称“存续投资者”）而言，自本次合同变更生效日起，各方的权利义务关系均以本合同约定为准，原资产管理合同不再执行。</p> <p>对本次合同变更生效后（含生效当日）参与的新投资者（即存续投资者之外的投资者）而言，本合同的生效条件为：</p> <p>(1) 该投资者、管理人、托管人三方纸质签署或以电子签名方式签订本合同并成立；</p> <p>(2) 该投资者参与申请本计划经注册登记机构确认成功。</p>
<p>三、本合同的有效期限为 10 年。</p>	<p>三、本合同的有效期限为自本计划成立之日起 10 年。</p>

第十部分
资产管理合同的效力

如贵行同意上述修订意见，我公司将依照《资产管理合同》的约定在管理人网站上向全体委托人披露拟变更内容，同时约定合同变更征询期及变更事项的生效日；此外，我公司将设置特殊退出开放日，为不同意合同变更的委托人办理退出事宜。

特此通知，请贵行函复。

本通知正本一式两份，贵公司留存一份，我公司执一份。

附件：《华兴证券多策略 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》（2025 年 1 月修订）



回 执

华兴证券有限公司：

我公司同意贵公司“《华兴证券多策略 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同变更意见征询通知》（2025 年 1 月修订）”中的协商事宜。

资产托管人：上海银行股份有限公司（盖章）

