

关于民生期货-创新9号单一资产管理计划 资产管理因法律规则修订而进行合同变更的公告

尊敬投资人：

资产委托人、资产管理人和资产托管人已签订《民生期货-创新9号单一资产管理计划资产管理合同》（以下统一简称“《资产管理合同》”）。

2023年1月13日，中国证监会发布了最新修订的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《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》（以下简称《运作规定》），对资产管理合同的内容与格式要求进行了调整。根据《资产管理合同》第二十章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”第（一）条的约定，我司与托管人就本合同拟变更事项已达成一致，拟对资产管理合同做如下变更。

一、本次合同变更方案内容如下：

涉及条款	变更前	变更后
全文涉及相关章节	/	全文所涉“商品及金融衍生品类资产”的表述统一变更为“期货和衍生品类资产”；
资产合法性及投资者适当性承诺书	<p>本人/本机构符合期货公司资产管理业务合格投资者相关标准，符合《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》规定的合格投资者的相关标准。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理计划不低于一定金额且符合下列相关标准的自然人、法人或者其他组织：</p> <p>（一）具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元；</p> <p>（二）最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；</p> <p>（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；</p> <p>（四）接受国务院金融监督管理机构监管</p>	<p>本人/本机构符合期货公司资产管理业务合格投资者相关标准，符合《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》规定的合格投资者的相关标准。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理计划不低于一定金额且符合下列相关标准的自然人、法人或者其他组织：</p> <p>（一）具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融净资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元；</p> <p>（二）最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位；</p> <p>（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、商业银行理财子公司、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；</p> <p>（四）接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；</p>

	<p>的机构发行的资产管理产品；</p> <p>(五) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，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>(六) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p>	<p>(五) 基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金，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>(六) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p>
第一节 前言	<p>(一) 订立本资产管理合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《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》、《期货公司监督管理办法》（以下简称“《管理办法》”）、《单一资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》和其他有关法律法规。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时就本合同做出相应的变更和调整。</p>	<p>(一) 订立本资产管理合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国期货和衍生品法》（以下简称“《期货和衍生品法》”）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称“《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》（以下简称“《运作规定》”）、《期货公司监督管理办法》、《单一资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》和其他有关法律法规。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时就本合同做出相应的变更和调整。</p>
第二节 释义	<p>21、销售机构：指管理人和/或取得基金销售业务资格并与管理人签订了销售服务协议办理本计划销售业务的机构。包括资产管理人及资产管理人指定的其他销售代理机构（如有）。</p>	<p>21、销售机构：指管理人和/或取得公募基金销售业务资格并与管理人签订了销售服务协议办理本计划销售业务的机构。包括资产管理人及资产管理人指定的其他销售代理机构（如有）。</p>
第四节 当事人及其权利义务	<p>(三) 资产管理人的权利与义务</p> <p>2、资产管理人的义务</p> <p>(26) 在兑付受托资金及收益时，资产管理人应当保证受托资金及收益返回委托人的原账户、同名账户或者合同约定的受益人账户。</p>	<p>(三) 资产管理人的权利与义务</p> <p>2、资产管理人的义务</p> <p>(26) 在兑付受托资金及收益时，资产管理人应当保证受托资金及收益返回委托人参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户。</p>
第四节 当事人及其权利义务	<p>(四) 资产托管人的权利与义务</p> <p>2、资产托管人的义务</p> <p>(13) 投资于《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》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、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示。</p>	<p>(四) 资产托管人的权利与义务</p> <p>2、资产托管人的义务</p> <p>(13) 投资于《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（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、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示。</p>

<p>第六节 资产管理计划的成立和备案</p>	<p>(三) 资产管理计划的备案 资产管理计划完成备案前不得开展投资活动,但以现金管理为目的,投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、债券逆回购、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种除外。管理人应在备案完成后五个工作日内函件或邮件通知托管人。如果资产管理计划备案失败,托管人有权终止为该资产管理计划提供托管服务。</p>	<p>(三) 资产管理计划的备案 管理人应在备案完成后五个工作日内函件或邮件通知托管人。如果资产管理计划备案失败,托管人有权终止为该资产管理计划提供托管服务。</p>
<p>第七节 资产管理计划的财产</p>	<p>(一) 资产管理计划财产的保管与处分 1、资产管理计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任,计划委托人以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。</p>	<p>(一) 资产管理计划财产的保管与处分 1、资产管理计划财产为信托财产,其债务由资产管理计划财产本身承担责任,计划委托人以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。</p>
<p>第八节 资产管理计划的投资</p>	<p>(三) 投资比例超限的处理方式 1、非因本资产管理人主观因素导致突破前述比例限制的,管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整至符合要求。 2、如上述约定与届时有效的法律法规、监管规范存在不一致的情形,则资产管理人有权根据届时有效的法律法规及监管规范的要求进行调整,并按照本合同“资产管理合同的变更、终止与财产清算”约定的变更流程处理。届时本计划可能面临因法律法规、监管政策调整所引起的本计划投资策略和计划类别调整的风险。 3、在本计划到期日前 15 个交易日内,因计划财产变现需要,本计划财产的投资比例限制可以不符合上述计划配置比例规定。 4、存续期内,本计划的实际投向不得违反计划合同约定,如有改变,除本计划超出比例范围投资债券逆回购和货币市场基金外,应当先行取得计划投资者书面同意,并履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。委托人签署本计划合同即表明一致同意前述超比例投资低风险资产不视为管理人改变本计划的计划类别。</p>	<p>(三) 投资比例超限的处理方式 1、非因本资产管理人主观因素导致突破前述比例限制的,管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整至符合要求。 2、如上述约定与届时有效的法律法规、监管规范存在不一致的情形,则资产管理人有权根据届时有效的法律法规及监管规范的要求进行调整,并按照本合同“资产管理合同的变更、终止与财产清算”约定的变更流程处理。届时本计划可能面临因法律法规、监管政策调整所引起的本计划投资策略和计划类别调整的风险。 3、存续期内,本计划的实际投向不得违反计划合同约定,如有改变,除本计划超出比例范围投资债券逆回购和货币市场基金外,应当先行取得计划投资者书面同意,并履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。委托人签署本计划合同即表明一致同意前述超比例投资低风险资产不视为管理人改变本计划的计划类别。</p>
<p>第八节 资产管理计划的投资</p>	<p>(八) 投资限制 2、本计划总资产占净资产的比例不超过 200%; 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、计划规模变动等非资产管理人主观因素导致突破上述投资限制的,资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或恢复交易的 15 个交易日内调整至符合要求。法律法规另有规定的,从其规定。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的,资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业</p>	<p>(八) 投资限制 2、本计划总资产不得超过净资产的 200%;如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本计划净资产 50%的,则本计划的总资产不得超过其净资产的 120%。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该比例限制。 如管理人同时投资于债券发行人及其关联方发行的不同债券,则管理人需向托管人主动发送所投资的债券发行人的关联方清单,如有更新,管理人需主动发送更新后的债券发行人关联方清单。托管人根据管理人提供的关联方清单进</p>

	<p>协会报告。</p>	<p>行监督。托管人资料接收邮箱： compliance_zctg@gf.com.cn。 因证券、期货市场波动、证券发行人合并、计划规模变动等资产管理人之外的因素导致资产管理计划突破上述投资限制的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或恢复交易的20个交易日内调整至符合要求。法律法规另有规定的，从其规定。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。</p>
<p>第十节 利益冲突及关联交易</p>	<p>(一)可能存在利益冲突或关联交易的情形</p> <p>资产管理人可运用计划财产买卖资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；或资产管理人、资产托管人及其关联方的股权（如有），或资产托管人担任主办券商的公司股权（如有）；或上述主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本资产管理合同投资范围规定的投资产品。资产管理人亦可与资产管理人、资产托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体进行融资融券（如有）、收益互换（如有）、场外期权（如有）等交易。</p> <p>(二)关联交易的处理方式及信息披露方式</p> <p>资产管理人进行该等关联交易的，应遵守相关法律法规规定以及本资产管理合同约定，遵循计划委托人利益优先的原则、防范利益冲突，就关联交易履行内部必要的审批、监督程序，保证不存在利益输送、不公平交易等情形，并按监管要求适时披露相关信息。资产管理人进行重大关联交易的，应有充分证据证明未损害投资者利益，且事先取得投资者的同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。</p> <p>管理人运用委托资产从事关联交易的，事后及时、全面、客观的向投资者和托管人以临时报告的方式进行披露，披露内容包括但不限于关联交易的交易对手、标的、资金额度、交易时间等；披露频率以关联交易实际发生频率为准。托管人根据管理人的重大关联交易报告</p>	<p>(一)可能存在利益冲突或关联交易的情形</p> <p>在不违反法律法规规定、合同约定并严格遵守管理人内部交易管理制度的前提下，本计划可以公平的价格进行关联交易。该等关联交易事项可能包括但不限于：对于委托人、管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券、承销期内承销的证券、管理或托管或代理销售的资产管理产品，管理人运用计划财产向其投资或与其交易，或者运用计划财产从事其他关联交易。但委托人或托管人各自就其自身或其关联方另有限制并书面通知管理人的除外。</p> <p>除前款规定外，管理人不得将其管理的本资产管理计划财产，直接或者通过投资其他资产管理产品等间接形式，为管理人、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提供或者变相提供融资。</p> <p>(二)关联交易的处理方式及信息披露方式</p> <p>管理人运用计划财产从事关联交易的，应当遵循委托人利益优先的原则、防范利益冲突，建立健全关联交易管理制度，对关联交易认定标准、交易定价方法、交易审批程序进行规范，不得以资产管理计划的资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场等行为，并按监管要求适时披露相关信息。管理人运用计划财产从事关联交易的，应当遵守法律法规的规定和合同约定，有充分证据证明未损害投资者利益，事先取得投资者的同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。法律法规、自律规则另有规定的，从其规定。</p> <p>管理人运用委托资产从事关联交易的，事后及时、全面、客观的向投资者和托管人以公告、定期报告、临时报告的方式进行披露，披露方式见本合同《信息披露与报告》章节的约定。托管人根据管理人的关联交易报告进行监督。</p>

	<p>进行监督。</p> <p>管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害委托人利益，事后及时、全面、客观的向委托人和托管人进行披露。管理人应通过管理人网站或者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，并按照资产管理合同的约定在资产管理计划年度报告和季度报告中予以披露，同时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告（具体以监管机构的最新要求为准）。</p> <p>计划委托人签署本资产管理合同即表明其已经知晓本计划可能进行上述关联交易。</p> <p>计划委托人不得因本计划进行上述关联交易或投资收益劣于资产管理人、资产托管人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向资产管理人或资产托管人提出任何损失或损害补偿的要求。</p>	<p>资产委托人不得因本计划进行上述关联交易或投资收益劣于资产管理人、资产托管人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向资产管理人或资产托管人提出任何损失或损害补偿的要求。</p>
<p>第十八节 信息披露与报告</p>	<p>（二）资产管理人向资产委托人提供的报告种类、内容和提供时间</p> <p>4、临时报告</p> <p>资产管理人在资产管理计划发生以下情形，对资产管理计划持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响时，应当于5个工作日内内向证券投资基金业协会报告：</p> <p>（1）以资产管理计划资产从事重大关联交易的；</p>	<p>（二）资产管理人向资产委托人提供的报告种类、内容和提供时间</p> <p>4、临时报告</p> <p>资产管理人在资产管理计划发生以下情形，对资产管理计划持续运行、投资者利益、资产净值产生重大影响时，应当于5个工作日内内向中国证监会相关派出机构报告：</p> <p>（1）以资产管理计划资产从事关联交易的；</p>
<p>第十八节 信息披露与报告</p>	<p>（二）资产管理人向资产委托人提供的报告种类、内容和提供时间</p> <p>5、清算报告</p> <p>计划终止，管理人应于计划终止后20个工作日内做出处理资产管理计划事务的清算报告，并在20个工作日内送达计划委托人，在资产管理计划清算结束后5个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。</p>	<p>（二）资产管理人向资产委托人提供的报告种类、内容和提供时间</p> <p>5、清算报告</p> <p>计划终止，管理人应当在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算资产管理计划财产，并于本计划清算结束后5个工作日内将清算报告报证券投资基金业协会。</p>
<p>第十八节 信息披露与报告</p>	<p>（四）向监管机构提供的报告</p> <p>资产管理人向投资者提供下列信息披露文件，应当及时报送中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会：</p> <p>1、资产管理合同、计划说明书和风险揭示书；</p> <p>2、资产管理计划净值，资产管理计划参与、退出价格；</p>	<p>（四）向监管机构提供的报告</p> <p>资产管理人向投资者提供下列信息披露文件，应当及时报送中国证监会相关派出机构：</p> <p>1、重大事项的临时报告；</p> <p>2、中国证监会规定的其他事项。</p>

	<p>3、资产管理计划定期报告，至少包括季度报告和年度报告；</p> <p>4、重大事项的临时报告；</p> <p>5、资产管理计划清算报告；</p> <p>6、中国证监会规定的其他事项。</p>	
--	----------------------------------------------------------------------------------------------------	--

原附件一《投资监督事项表》统一变更为：

<p>托管人对资产管理人投资运作的监督说明</p>	<p>资产托管人依据经核对的估值数据以本表为限对资产管理人的直接投资进行监督。</p>
<p>监督事项</p>	<p>监督内容</p>
<p>投资范围</p>	<p>详见本合同“资产管理计划的投资”之“投资范围”约定。</p>
<p>投资比例</p>	<p>详见本合同“资产管理计划的投资”之“投资比例”约定。</p>
<p>投资限制</p>	<p>详见本合同“资产管理计划的投资”之“投资限制”约定。</p>
<p>关联交易</p>	<p>本计划允许关联交易。托管人根据管理人的关联交易报告进行监督。</p>
<p>穿透计算</p>	<p>涉及穿透计算的，资产管理人应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算该资产管理计划所投资资产的金额或比例，并至少按季度向托管人主动发送管理人计算的穿透后各类资产比例以及相关核查文件。托管人根据管理人提供的数据及频率进行监督。托管人资料接收邮箱： compliance_zctg@gf.com.cn</p>
<p>管理人维度的投资比例及投资限制</p>	<p>涉及管理人维度的投资比例及投资限制，托管人仅对管理人发行且托管在广发证券股份有限公司处的所有资管产品的投资比例及投资限制进行监督。</p>

二、管理人、托管人向证监会、基金业协会及其他监管机构报送的事项以《管理办法》和《运作规定》规定为准，变更前的资产管理合同与此不一致的，以此为准。

三、份额持有人不同意变更的，则应当在 2023 年 3 月 22 日提出全部份额赎回申请。逾期未提出全部份额赎回申请的，则视为份额持有人已以其行为表明同意上述全部变更事项。变更后的合同内容将于 2023 年 3 月 23 日生效。

四、《资产管理合同》其他相关内容与本次变更后条款规定不一致的，以本次变更后条款为准。本公告生效后管理人将按照证监会、证券投资基金业协会相关规定进行报备。

特此函告。

