

## 《民生银华睿合绝对收益1号单一资产管理计划资产管理合同》变更告知函

致国泰君安证券股份有限公司：

我司拟根据《民生银华睿合绝对收益1号单一资产管理计划资产管理合同》的相关约定通过公告形式对该资管合同条款进行变更，特向贵司告知相关变更事宜。

### 一、民生银华睿合绝对收益1号单一资产管理计划资产管理合同条款具体修改如下

#### （一）修订第四节“当事人的权利与义务”第（二）条“资产管理人的权利与义务”

##### 1、原表述：

“名称：民生期货有限公司  
住所：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A-19层  
联系人：马兵  
通讯地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A-19层  
联系电话：010-85295185”

##### 修改为：

“名称：【民生期货有限公司】  
住所：【北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座19层】  
联系人：【徐翌轩】  
通讯地址【北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座19层】  
联系电话：【010-85295185】”

#### （二）修订第十节“利益冲突及关联交易”

##### 1、原表述：

“（一）资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形

在本计划存续期内，管理人可能运用委托资产投资于管理人、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、其他金融产品或者承销期内承销的证券。



投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事该等关联交易，管理人无需就该等具体关联交易分别取得投资者的个别授权，但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与，管理人应采取切实有效措施，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。投资者不得因本计划投资收益劣于管理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。

投资者应事前将其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知管理人。若投资者未能事前将其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知管理人致使资产管理计划财产发生违规投资行为的，由投资者承担责任。

## （二）资产管理计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率

投资者在此对上述列举的存在的或可能存在的利益冲突情形表示知悉，确认并同意豁免上述情形，其中，涉及关联交易的，按以下约定进行处理：

管理人运用受托资产从事关联交易的，应遵循客户利益优先的原则，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。

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。”

### 修改为：

“（一）资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形。

1、本资产管理计划可能投资于管理人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者在承销期内承销的证券；

2、本资产管理计划可能投资于资产管理人及资产管理人关联方发行的其他金融产品；

3、本资产管理计划可能投资于托管人或投资顾问（如有）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等关联方发行的证券或承销期内承销的证券、直接或间接管理的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品、或者从事其他重大关联交易的；

4、管理人确认其已建立防范利益输送和利益冲突的机制，确认该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行为，但该等交易仍构成关联交易，存在利益冲突风险；

5、其他依据法律法规、监管规定可能存在利益冲突的情形。

（二）资管计划的关联方范围包括但不限于以下主体：

1、《企业会计准则第36号-关联方披露》规定的以下管理人的关联方，包括：管理人的主要股东（即持有期货公司5%以上股权的股东）；管理人的受益所有人；管理人的子公司及子公司的全资子公司；管理人的董事、监事、高级管理人员及其配偶。

2、视为关联方进行管理的自然人、法人及公司资产管理计划，包括：资管计划管理人；管理人的从业人员及其配偶；资管计划托管人及其关联方（以托管人向公司披露的关联方名单为准）；管理人管理的其他资管计划；管理人以自有资金投资的其他资产管理计划；

3、根据实质重于形式的原则认定的其他与管理人有特殊关系，可能造成管理人对其利益倾斜或导致利益转移的自然人、法人或其他组织。

4、其他依据《企业会计准则》或者相关法律法规认定为关联方的情形。

（三）资产管理计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率。

投资者在此对上述列举的存在的或可能存在的利益冲突情形、关联方等内容表示知悉，其中，涉及关联交易的，按以下约定进行处理：

投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事一般关联交易，管理人无需就具体的一般关联交易分别取得投资者的个别授权，但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与。管理人运用受托资产从事一般关联交易的，应遵循客户利益优先的原则，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。

管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先采取逐笔征求意见取得投资者同意，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传真/短信/电子邮件/通讯地址等一种或多种联系方式，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，同时向监管机构报备（如需）。

其中一般关联交易与重大关联交易的认定标准如下：

1、管理人的资管计划受托管理关联方的资产，包括但不限于：

（1）管理人董事、监事、从业人员（含高级管理人员）及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与管理人设立的资产管理计划；

（2）管理人以自有资金参与管理人设立的单一资产管理计划。

2、管理人的资管计划投资于关联方发行的证券或者承销期内承销的证券或资产管理计划。

3、根据实质重于形式原则认定的其他应当属于关联交易的情形。

以上情形中，与关联方开展的单笔交易金额超过人民币 1500 万元且占该资产管理计划资产净值 15%以上（不含本数）的第 2、3 类交易属于重大关联交易；其他交易属于一般关联交易。

上述标准如因法律法规或监管机构要求发生变化或与法律法规、监管要求不一致的，以法律法规规定及监管机构的最新要求为准。

（四）资管计划的关联交易审批与内控机制：

以资管计划的资产从事关联交易的，由管理人资管业务专业委员会（以下简称“委员会”）根据管理人《资产管理业务关联交易管理办法》（或后续更新的类似管理办法或内部制度）进行评审。从事重大关联交易的，管理人委员会按照以下程序对重大关联交易进行评审：

1、管理人资产管理部就重大关联交易提交专项报告，报告内容包括但不限于：关联方基本情况、交易类型、交易金额及标的、交易价格及定价方式、交易收益与损失、关联方在交易中所占权益的性质及比重、委托人对关联交易的初步意向等。

2、委员会在评审关联交易事项时，应当对关联交易的必要性、公平性、真实意图、是否存在对其他委托人的不利影响等进行审查和判断，特别关注交易的定价政策及定价依据，包括估值的公允性、交易标的成交价格与账面值或评估值之间的关系等。

3、关联交易须经委员会全体成员表决通过。

(五) 托管人的关联方名单以公开年报信息为准。管理人有关联交易的“管理人关联方名单”在管理人网站上披露，并以电子邮件或双方约定的其他方式提供给托管人，并在关联方名单发生变更时在管理人网站上及时更新并通知托管人。托管人仅就管理人提供的“管理人关联方名单”和托管人提供的关联方名单对关联方发行的证券进行监督。

特别提示：投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意上述关联交易的相关内容、同意本资产管理计划可进行上述一般关联交易。

资产委托人知晓并同意本计划的投资对象可能包括资产管理人管理的货币市场基金或者与资产管理人、资产托管人、资产委托人或其关联方进行交易。本计划销售机构可能包含资产管理人的关联方，本计划可能聘请资产管理人、资产托管人或其关联方为本计划经纪机构，虽然管理人积极遵循委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的关联交易风险，进而可能影响委托人的利益。”

### (三) 修订第十六节“资产管理计划的费用与税收”第(一)条“本计划的费用”

#### 1、原表述：

“1、本计划财产应承担的费用的种类

(1) 管理人的管理费。

(2) 托管人的托管费。

- (3) 运营服务机构的运营服务费。
- (4) 管理人的业绩报酬。
- (5) 投资顾问费。
- (6) 资产管理计划资产的银行汇划费用。
- (7) 资产管理计划资产的审计费用。
- (8) 按照国家有关规定和本合同约定，可以在资产管理计划资产中列支的其他费用。

”

**修改为：**

**“1、本计划财产应承担的费用的种类**

- (1) 管理费（含业绩报酬）。
- (2) 托管费。
- (3) 运营服务费。

(4) 资产管理计划成立后的银行汇划费用、审计费用、针对本计划，或针对本计划所投项目而发起的诉讼、仲裁或其他司法或行政程序的费用，与该等诉讼、仲裁或程序相关的律师费、案件受理费、诉讼费、仲裁费、财产保全费等。

(5) 按照国家有关规定和本合同约定，可以在资产管理计划资产中列支的其他费用。”

**（四）修订第十六节“资产管理计划的费用与税收”第2条中“本计划费用计提方法、计提标准和支付方式”中的第（1）款“管理费”、第（4）款“业绩报酬”、第（5）款“投资顾问费”**

**1、原表述：**

(1) “管理费

管理费率为年费率 0.05%在通常情况下，管理费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一自然日的计划资产净值

管理费自计划成立日起，每日计提，按自然季度支付。自下一自然季度开始，托管人根据管理人提交的划款指令进行付费。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。”

“（4）业绩报酬

管理人不收取业绩报酬。”

**修改为：**

“1、管理费

资产管理人的管理费包括资产管理人的固定管理费和业绩报酬。

（1）固定管理费

固定管理费率为年费率 1.05%在通常情况下，管理费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H=E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一自然日的计划资产净值

管理费自计划成立日起，每日计提，按自然季度支付。自下一自然季度开始，托管人根据管理人提交的划款指令进行付费。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

资产管理人将从本计划中收取固定管理费的 $\frac{1}{1.05}$ 由资产管理人账户支付给投资顾问。

（2）业绩报酬

1) 业绩报酬的计提基准日：【委托人退出日、分红权益登记日、计划清算日】。

2) 业绩报酬的计算：采用单个委托人单笔高水位净值法，即在业绩报酬计提基准日，计划份额持有人的每笔计划份额或退出的计划份额累计净值大于上次成功计提基准日（首次计提时，则为参与日份额累计净值）时，分别计算每笔份额在上一成功计提基准日至本次计提基准日持有期间的计划份额累计净值增长差额，对超过上次成功计提基准日计划份额累计净值部分按【20%】比例进行计提。

业绩报酬的具体计算及支付如下：

①【退出或计划清算】时提取业绩报酬

$$E = \begin{cases} \text{当 } NAV_n \leq NAV_h \text{ 时, } 0 \\ \text{当 } NAV_n > NAV_h \text{ 时, } (NAV_n - NAV_h) \times S \times R, \end{cases}$$

其中：E 为应计提的业绩报酬；

$NAV_n$  为当前基准日未扣除当期应计提业绩报酬前的计划份额累计净值；

$NAV_h$  为上次成功计提基准日计划份额累计净值（历史未计提，则为参与日份额累计净值）；

S 为当前基准日单个资产委托人退出或持有的单笔份额；

R=【20%】，为业绩报酬提取比例；

【②】分红提取业绩报酬

当发生分红时，管理人在分红权益登记日先按“【退出或计划清算】时提取业绩报酬”的方法计算每个资产委托人的应计提业绩报酬金额，然后在派发分红时从分红金额中扣除业绩报酬；当分红金额不足以扣除业绩报酬时，以分红金额为限进行扣除。

业绩报酬采用按账户计提的方式，多次参与退出的计划份额在确定份额参与日或上次成功计提基准日时采用“先进先出”法。

业绩报酬的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入计划资产。

3) 业绩报酬的支付



业绩报酬由【管理人或运营服务机构】负责计算及复核，并由管理人在委托人【分红或退出或清算】款项（以下简称“退出金额”）中分别予以相应扣除，即退出金额支付日，托管人根据管理人的指令将退出金额（含业绩报酬）划拨到募集账户，管理人扣除归其所有的应计提业绩报酬后，将剩余的退出金额支付给委托人。

业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，委托人赎回日、计划清算日以及合同约定的其他业绩报酬计提基准日遇非交易日顺延的情况除外。”

资产管理人将从本计划中收取业绩报酬由资产管理人账户支付给投资顾问。

## 2、删除表述：

“（5）投资顾问费

### 1) 固定投资顾问费

固定投资顾问费率为年费率【1】%。在通常情况下，固定投资顾问费按前一自然日计划资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年固定投资顾问费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的固定投资顾问费

E 为前一自然日的计划资产净值

固定投资顾问费自计划成立日起，每【日】计提，按【自然季度】支付。自下一【自然季度】开始，托管人根据管理人提交的划款指令进行付费。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

### 2) 浮动投资顾问费

①浮动投资顾问费的计提基准日：【固定提取日、委托人退出日、计划清算日。其中固定提取日为【每年6月和12月的最后一个交易日】（封闭期及/或锁定期（如有）内的固定提取日除外）。

②浮动投资顾问费的计算：采用单个委托人单笔高水位净值法，即当浮动投资顾问费计提基准日的计划份额累计净值大于上次成功计提基准日（首次计提时，则为参与日计划

份额累计净值)时,分别计算每笔份额在上一成功计提基准日至本次计提基准日持有期间的计划份额累计净值增长差额,对超过上次成功计提基准日计划份额累计净值部分按【20%】比例进行计提。

对于单个委托人单笔投资计划份额的浮动投资顾问费具体计算方法如下:

固定提取日计提时

$$E = \begin{cases} \text{当 } NAV_n \leq NAV_{h,i,j} \text{ 时, } 0 \\ \text{当 } NAV_n > NAV_{h,i,j} \text{ 时, } (NAV_n - NAV_{h,i,j}) \times S_{i,j} \times R, \end{cases}$$

【退出或计划清算】时提取浮动投资顾问费

$$E = \begin{cases} \text{当 } NAV_n \leq NAV_{h,i,j} \text{ 时, } 0 \\ \text{当 } NAV_n > NAV_{h,i,j} \text{ 时, } (NAV_n - NAV_{h,i,j}) \times S_i \times R, \end{cases}$$

其中: E 为应计提的浮动投资顾问费;

$NAV_n$  为当前基准日未扣除当期应计提浮动投资顾问费前的计划份额累计净值;

$NAV_{h,i,j}$  为第 i 个委托人的第 j 笔资金上次成功计提基准日计划份额累计净值(若历史未计提,  $NAV_{h,i,j}$  则为参与日的计划份额累计净值);

$S_{i,j}$  为当前基准日第 i 个委托人第 j 笔投资金额的持有份额;

$S_i$  为当前开放日第 i 个委托人的申请退出的份额或计划清算日第 i 个委托人持有的份额;

$R = \text{【20%】}$ , 为浮动投资顾问费提取比例。

浮动投资顾问费的计算保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位四舍五入, 由此带来的收益和损失归入计划资产。

浮动投资顾问费采用按账户计提的方式, 多次参与退出的计划份额在确定份额参与日或上次成功计提基准日时采用“先进先出”法。

浮动投资顾问费的计算保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位四舍五入, 由此带来的收益和损失归入计划资产。

### ③浮动投资顾问费的支付

浮动投资顾问费由【管理人或运营服务机构】负责计算及复核，并由管理人在委托人【分红或退出或清算】款项（以下简称“退出金额”）中分别予以相应扣除，即退出金额支付日，托管人根据管理人的指令将退出金额（含业绩报酬）划拨到募集账户，管理人扣除归投资顾问所有的应计提浮动投资顾问费后，将剩余的退出金额支付给委托人。

固定提取日所计提浮动投资顾问费通过扣减委托人持有份额的方式提取应计提的浮动投资顾问费。浮动投资顾问费由【管理人或运营服务机构】负责计算及复核，浮动投资顾问费从计划财产中划拨到募集账户，管理人划付给投资顾问。

此种方式会减少委托人的持有份额，但不会影响计划份额净值的变化。具体计算公式为：

委托人应扣减的计划份额=委托人应计提的浮动投资顾问费÷浮动投资顾问费固定提取日的计划份额净值。

浮动投资顾问费提取后委托人持有份额=浮动投资顾问费计提基准日委托人持有份额-委托人应扣减的计划份额。”

### 3、原表述：

“6、上述第1款中【6】-【8】项费用根据有关法律法规及相应协议规定，由托管人在费用发生时，列入当期费用，由托管人按照管理人的划款指令从计划资产中支付。本计划各项费用的付费频率/时点及付费模式，如管理人和托管人经协商一致另有约定的，从其约定。

除业绩报酬、浮动投资顾问费外，上述条款提及的税费应在计算计划资产净值时予以扣除，交易所或第三方金融机构调整税费征收种类或相关费率时，以上税费也随之调整，具体调整时间以管理人通知为准。”

### 修改为：

“6、上述第1款中【4】-【5】项费用根据有关法律法规及相应协议规定，由托管人在费用发生时，列入当期费用，由托管人按照管理人的划款指令从计划资产中支付。本计

划各项费用的付费频率/时点及付费模式，如管理人和托管人经协商一致另有约定的，从其约定。

除业绩报酬外，上述条款提及的税费应在计算计划资产净值时予以扣除，交易所或第三方金融机构调整税费征收种类或相关费率时，以上税费也随之调整，具体调整时间以管理人通知为准。

”

(五) 资产管理合同中其他涉及“浮动投资顾问费”相关的条款，均予以删除

## 二、合同条款变更生效事宜

1、如贵司未提出书面反对意见的，相关合同条款变更将自2023年【4】月【27】日起正式生效，我司将以公告等形式向投资者披露本函变更的具体内容。

管理人：【民生期货有限公司】

(盖章)

2023年【4】月【27】日