

## 《国联期货智多星 1 号集合资产管理计划资产管理合同》变更告知函

致委托人：

“国联期货智多星 1 号集合资产管理计划”（以下简称“本计划”）成立于 2022 年 12 月 6 日。现根据运作情况，国联期货股份有限公司（以下简称“我司”、“管理人”）拟对本计划合同进行修改。本次合同变更已与托管人国泰君安证券股份有限公司达成一致，我司现根据《国联期货智多星 1 号集合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基金合同条款进行变更，具体内容如下：

国联期货智多星 1 号集合资产管理计划资产管理合同条款具体修改如下

（一）修订第八节“资产管理计划份额的参与和退出与转让”第（十三）条“管理人自有资金参与”

### 1、原表述：

“管理人可以自有资金参与本计划，自有资金参与份额根据其持有比例，与其他份额持有人共同平等承担风险，共同平等享受计划资产收益分配。管理人自有资金并不承担补偿其他投资亏损或收益的情况。”

管理人自有资金参与资产管理计划的持有期限不得少于【6】个月。参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知投资者和托管人。

管理人以自有资金参与本资产管理计划的份额不得超过本计划总份额的【20%】。管理人及其附属机构以自有资金参与本资产管理计划的份额合计不得超过本计划总份额的【50%】。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，管理人应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时调整达标。本合同当事人一致同意，该条款由资产管理人自行监控。

为应对本资产管理计划巨额退出以解决流动性风险，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合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后



续退出本资产管理计划可不受本条上述规定的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。”

#### **修改为：**

“管理人可以自有资金参与本计划，自有资金参与份额根据其持有比例，与其他份额持有人共同平等承担风险，共同平等享受计划资产收益分配。管理人自有资金并不承担补偿其他投资亏损或收益的情况。

管理人自有资金参与资产管理计划的持有期限不得少于【6】个月。参与、退出时，应当提前5个工作日通过管理人网站公告征求全体委托人意见，并书面征求托管人意见。委托人如未在载明的回复截止日按指定的形式回复意见或回复意见不明确的，视为同意本次自有资金参与或退出。管理人应当于征求意见期满后安排临时开放日，供不同意的委托人退出本计划（该退出不受本合同第八节“资产管理计划份额的参与和退出与转让”中关于本计划赎回的期限限制）。

管理人及其子公司以自有资金参与本资产管理计划的份额合计不得超过本计划总份额的【50%】。中国证监会对管理人自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，管理人应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时调整达标。本合同当事人一致同意，该条款由资产管理人自行监控。

为应对本资产管理计划巨额退出以解决流动性风险，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合同约定的前提下，管理人及其子公司以自有资金参与及其后续退出本资产管理计划可不受本条上述第2款、第3款约定的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向监管机构报备（如需）。”

## **（二）修订第十三节“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（具体以监管机构的最新要求为准）。”

### 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

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。

管理人应当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。管理人应采取切实有效措施，公平对待参与财产，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，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或公告确认等方式取得投资者同意，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，同时向监管机构报备（如需）。

一般关联交易与重大关联交易的认定标准以法律法规规定及监管机构的最新要求为准。”

## （三）修订第二十节“资产管理计划的费用与税收”第（一）条“与资产管理计划有关的费用”

### 1、原表述：

“1、管理费。

- 2、托管费。
- 3、运营服务费。
- 4、业绩报酬。
- 5、资产管理计划成立后的银行汇划费用。
- 6、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。

管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。”

**修改为：**

“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，或针对本计划所投资项目而发起的诉讼、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。

管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。”

**（四）修订第二十章“资产管理计划的费用与税收”第（二）条“费用计提方法、计提标准和支付方式”第1款“管理费”、第4款“业绩报酬”、第5款**

**1、原表述：**

“1、管理费

管理费率为年费率【1.5】%。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。

资产管理人指定收取管理费的银行账户为：

户名：【国联期货股份有限公司】

开户行：【交通银行股份有限公司无锡分行】

账号：【322000600018150000255】”

#### “4、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；

$R = \text{【20\%】}$ ，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。

业绩报酬收取账户为本合同约定的资产管理人管理费收取账户。”

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【1.5】%。在通常情况下，固定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：

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

H 为每日应计提的固定管理费

E 为前一自然日的计划资产净值

本计划成立之日起，固定管理费每日计提，按【自然季度】支付。自下一【自然季度】开始，由托管人根据与管理人核对一致的计划资产估值数据，从计划财产中一次性支付至管理人账户，管理人无需再出具划款指令。管理人在与托管人协商一致后，可将付费模式变更为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) 业绩报酬

(a) 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】。

(b) 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。

### (c) 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。

资产管理人指定收取管理费的银行账户为：

户名：【国联期货股份有限公司】

开户行：【交通银行股份有限公司无锡分行】

账号：【322000600018150000255】”

## 2、原表述：

“5、上述第（一）款中第【5】-【6】项费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期计划资产运作费用，由资产托管人按照资产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。”

## 修改为：

“4、上述第（一）款中第【4】-【5】项费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期计划资产运作费用，由资产托管人按照资产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。”

## （五）修订“资产管理计划风险揭示书”中的“三、投资者声明”

### 新增表述：

重要提示：本风险揭示书为本资产管理计划资产管理合同的附件，与资产管理合同具有同等法律效力。”

管理人：【国联期货股份有限公司】



（盖章）

【2023】年 3 月 10 日】