

## 关于金信金鑫 CTA1 号集合资产管理计划 资产管理合同变更（202301）的协商函

招商证券股份有限公司：

金信期货有限公司（以下简称“我司”）在贵司托管的金信金鑫 CTA1 号集合资产管理计划（以下简称“该资产管理计划”）自成立以来，一直坚持规范运作，稳健运营。为更好地为该资产管理计划投资者提供投资服务，我司拟根据《金信金鑫 CTA1 号集合资产管理计划资产管理合同》的约定对该资产管理计划相关条款进行变更。

我司特向贵司征询关于金信金鑫 CTA1 号集合资产管理计划资产管理合同相关条款变更的意见。

《金信金鑫 CTA1 号集合资产管理计划资产管理合同》条款具体修改如下：

### 一、金信金鑫 CTA1 号集合资产管理计划资产管理合同修改对照明细表

#### 序号 1

#### 八、资产管理计划的参与、退出与转让

原条款：	现条款：
<p style="text-align: center;">（十五）管理人及其子公司自有资金参与集合计划</p> <p style="text-align: center;">1、认购/参与计划的金额和比例</p> <p>管理人及其子公司以自有资金认购/参与本计划的份额合计不得超过该计划总份额的 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限的，不视为管理人违反此项约定，但在客观条件允许的情况下，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。</p> <p style="text-align: center;"><b>管理人及其子公司以自有资金认购/参与本计划应控制并满足上述相关比例要求。</b></p> <p style="text-align: center;">2、自有资金参与期限与退出条件</p>	<p style="text-align: center;">（十五）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划</p> <p style="text-align: center;">1、认购/参与计划的金额和比例</p> <p>证券期货经营机构及其子公司以自有资金认购/参与本计划的份额合计不得超过该计划总份额的 50%；中国证监会对证券期货经营机构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限的，不视为管理人违反此项约定，但在客观条件允许的情况下，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。</p> <p style="text-align: center;"><b>证券期货经营机构及其子公司以自有资金认购/参与本计划应控制并满足上述相</b></p>



<p>管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。认购/参与、退出时，管理人应当提前 5 个工作日告知所有投资者和托管人，并取得其同意；如因未及时通知并取得上述当事人同意的全部责任及后果由管理人自行承担。</p> <p>为应对本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集合资产管理计划可不受上述关于持有比例和持有时间的限制，但应当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。</p> <p>3、管理人持有份额的收益及风险特征</p> <p>管理人及其子公司自有资金所持的本计划份额与投资者所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。</p>	<p><b>关比例要求。</b></p> <p>2、自有资金参与期限与退出条件</p> <p>证券期货经营机构自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。认购/参与、退出时，管理人应当提前 5 个工作日告知所有投资者和托管人，并取得其同意；如因未及时通知并取得上述当事人同意的全部责任及后果由管理人自行承担。</p> <p>为应对本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，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受上述关于持有比例和持有时间的限制，但应当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。</p> <p>3、管理人持有份额的收益及风险特征</p> <p>证券期货经营机构及其子公司自有资金所持的本计划份额与投资者所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。</p>
---	--

**序号 2**

**十二、利益冲突及关联交易**

原条款：	现条款：
<p>（一）本资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形</p> <p>1、本资产管理计划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</p>	<p>（一）本计划存在或可能存在的利益冲突情形</p> <p>1、管理人可能运用计划财产进行关联交易，包括但不限于：</p>

<p>利害关系的公司发行或者在承销期内承销的证券；</p> <p>2、本资产管理计划投资于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或者在承销期内承销的证券；</p> <p>3、本资产管理计划投资于管理人、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合同投资范围规定的投资产品；</p> <p>4、从事其他关联交易。</p> <p>（二）本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</p> <p>1、处理方式</p> <p>当本资产管理计划存在或可能存在利益冲突情形时，管理人需要建立健全内部审批机制和评估机制，并遵循投资者利益优先的原则，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。</p> <p>2、披露方式、披露内容以及披露频率</p> <p>当本资产管理计划发生上述存在利益冲突的情形，应采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。管理人应当事先取得投资者的同意，事后告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p>	<p>（1）运用计划财产投资于管理人、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承销期内承销的证券或发行的金融产品。</p> <p>（2）运用计划财产与管理人及子公司、管理人及子公司设立或担任投资顾问的金融产品进行对手方交易。</p> <p>（3）运用计划财产投资于管理人及其子公司设立的或担任投资顾问的金融产品。</p> <p>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。</p> <p>2、全体份额持有人充分知悉并理解，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能仍会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先</p>
--	---

### （三）关联交易

以资产管理计划资产从事关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，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。运用受托管理资产从事关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。

管理人可运用计划财产投资于管理人、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合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突，保护计划份额持有人合法权益。

**投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意本资产管理计划可进行上述关联交易。**

**本资产管理计划份额持有人不得因本资产管理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。**

后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。全体份额持有人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。全体份额持有人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

（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：

管理人以本计划资产从事关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，事先取得投资者同意，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。

管理人运用受托资产从事一般关联交易的，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，遵循客户利益优先的原则，事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露。管理人应通过管理人网

	<p>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投资者和托管人，同时向中国证监会相关派出机构报告。</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投资者利益，事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露。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投资者和托管人，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）。</p> <p>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。</p> <p>投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意本资产管理计划可进行上述关联交易。</p> <p>本资产管理计划份额持有人不得因本资产管理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。</p>
--	---

序号 3  
其他

原条款：	现条款：
<p>10、关联交易风险（如有）</p> <p>在本计划存续期内，管理人可</p>	<p>10、关联交易的风险</p> <p>1) 投资者知悉并同意，本计</p>

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，这构成本计划的关联交易，存在关联交易风险。

划可投资于资产托管人管理的金融产品、资产管理人、资产托管人及其股东等关联方发行或承销的证券，租用资产管理人关联方提供的证券交易单元等，存在关联交易的风险。资产管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行，投资者认可此等关联交易情形的存在并自愿承担相关投资风险。

2) 投资者知悉，尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理出资财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：资产管理人、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；资产管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行

为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。投资者认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

此外，资产管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用固有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。投资者认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

上述变更自【2023】年【4】月【20】日起开始生效。

## 二、变更流程

我司通过本函向贵司征询意见，在与贵司书面达成一致意见并收到贵司的

《复函》后，我司将按照资产管理合同的约定向基金份额持有人披露资产管理合同变更事宜合同变更生效后按监管规定及时向监管机构报备。

若由于管理人未及时书面告知托管人而导致托管人无法确定变更生效时间，由此造成的任何形式的纠纷与托管人无关，由管理人承担由此造成的法律后果。在无充分文件证明变更生效时间前，托管人将严格按照原协议履行其托管职责。以上事宜，请贵司确认。

我司承诺本次合同变更生效后，在合同变更生效日之后进行参与的投资者所签署合同为根据变更内容调整后的最新有效的资产管理合同。因新投资人签署合同版本与实际不符而导致的损失，由管理人承担相应的责任，托管人不承担任何责任。

本函正本一式两份，贵司留存一份，我司执一份。



金信期货有限公司  
2023年4月20日







## 复 函

金信期货有限公司：

贵司发来的《关于金信金鑫 CTA1 号集合资产管理计划资产管理合同变更（202301）的协商函》收悉，经研究，对贵司在来函中所述的合同条款变更内容不持异议。

本复函一式两份，双方各执一份。

招商证券股份有限公司托管部（盖章）



签署日：2023年4月20日

