

✓

**关于上海东亚期货有限公司-沅利六号集合资产管理计划
资产管理合同变更的托管人征询意见函**

宁波银行股份有限公司：

上海东亚期货有限公司（以下简称“我公司”）在宁波银行股份有限公司托管的上海东亚期货有限公司-沅利六号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）自成立以来，坚持规范运作、稳健运营。为更好地服务投资者，我公司作为管理人拟对《上海东亚期货有限公司-沅利六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》”）中投资比例、关联交易等内容进行变更，变更条款修改对照明细表如下：

1、《资产管理合同》第五章第（五）项第2条“投资比例”

原条款	变更后条款
2、投资比例 (1) 固定收益类资产占本计划总资产的比例不低于 80%； (2) 权益类资产占本计划总资产的比例不超过 20%； (3) 期货和衍生品类资产的持仓合约价值占本计划资产总值的比例低于 20%，或衍生品账户权益占本计划资产总值的比例不超过 20%； (4) 本计划的总资产占净资产的比例不得超过 180%。 相关法律法规另有规定的，管理人将按照新的规定处理，并在指定网站上披露。	2、投资比例 (1) 经穿透合并计算，固定收益类资产占本计划总资产的比例不低于 80%； (2) 经穿透合并计算，权益类资产占本计划总资产的比例不超过 20%； (3) 经穿透合并计算，期货和衍生品类资产的持仓合约价值占本计划资产总值的比例低于 20%，或期货和衍生品账户权益占本计划资产总值的比例不超过 20%； (4) 经穿透合并计算，本计划的总资产占净资产的比例不得超过 180%。 本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的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产金额。 相关法律法规另有规定的，管理人将按照新的规定处理，并在指定网站上披露。

2、《资产管理合同》第十一章第（二）项第2条“投资比例”

原条款	变更后条款
2、投资比例 (1) 固定收益类资产占本计划总资产的比例不低于 80%；	2、投资比例 (1) 经穿透合并计算，固定收益类资产占本计划总资产的比例不低于 80%；

(2) 权益类资产占本计划总资产的比例不超过 20%; (3) 期货和衍生品类资产的持仓合约价值占本计划资产总值的比例低于 20%, 或衍生品账户权益占本计划资产总值的比例不超过 20%; (4) 本计划的总资产占净资产的比例不得超过 180%。 相关法律法规另有规定的, 管理人将按照新的规定处理, 并在指定网站上披露。	(2) 经穿透合并计算, 权益类资产占本计划总资产的比例不超过 20%; (3) 经穿透合并计算, 期货和衍生品类资产的持仓合约价值占本计划资产总值的比例低于 20%, 或期货和衍生品账户权益占本计划资产总值的比例不超过 20%; (4) 经穿透合并计算, 本计划的总资产占净资产的比例不得超过 180%。 本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的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产金额。 相关法律法规另有规定的, 管理人将按照新的规定处理, 并在指定网站上披露。 上述投资比例和投资限制, 如涉及穿透核查或穿透合并计算的, 管理人应当根据所投资资产管理产品披露投资组合的频率, 及时通过邮件方式 (托管人的邮箱地址为 custody@nbcf.cn; custody-audit@nbcf.cn) 向托管人提供本资产管理计划所投资其他资产管理产品的估值表和净值数据等核查信息, 托管人仅根据管理人提供的数据进行复核, 并根据管理人提供的数据及时进行投资监督。管理人应确保对所提供数据材料的真实性、准确性以及完整性负责。由于底层数据材料的提供频率、脱敏处理、可披露程度等原因导致托管人实际监督范围受限的, 由此造成的后果由管理人承担。如本资产管理计划所投资其他资产管理产品披露组合的频率发生变化的, 由托管人及管理人协商一致后进行调整。涉及证券投资基金穿透监控的, 以最近 1 个季度证券投资基金定期披露的报告为准。
---	---

3、《资产管理合同》第十二章第(二)项第1条“关联交易管理机制”

原条款	变更后条款
1、关联交易管理机制: (1) 关联方范围 投资者: 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	1、关联交易管理机制: (1) 关联方范围 投资者: 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。 管理人及托管人：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。 (2) 一般和重大关联交易的认定标准 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、监管机构、自律机构及管理人有关内控的最新要求为准。涉及关联交易的，如管理人内部的认定标准与法律法规不一致时，管理人应及时将其内部的认定标准披露给托管人和投资者。托管人信息接收邮箱：custody-audit@nbc.cn。 (3) 关联交易审批 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等行为。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。	投资者承担责任。 管理人及托管人：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。 (2) 一般和重大关联交易的认定标准 以下为重大关联交易： 1) 投资于我公司、该计划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； 2) 管理人认为按照实质重于形式的原则，属于重大关联交易的； 3) 中国证监会、中国证券投资基金业协会等相关监管部门或自律组织认定的其他符合关联交易的情形。 一般关联交易指重大关联交易以外的其他关联交易。 (3) 关联交易审批 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等行为。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。对于一般关联交易，在确定交易定价公允、未侵害投资者利益的前提下，由投资经理报投资决策委员会审批；重大关联交易，在履行完一般关联交易所建立的内部评估和审批流程的基础上，报董事会审议通过。
--	--

根据《资产管理合同》第二十五章第（一）款的约定，我公司作为本计划管理人就前述变更事项书面征询托管人意见。在与贵行达成书面一致后，我公司将按照《资产管理合同》的约定履行相应程序，及时通过管理人网站向投资人征询意见。投资者不同意变更的，可就持有的计划份额提出退出申请。管理人可设置临时开放日，且在符合法律法规、监管机构及自律组织要求的前提下，不受《资产管理合同》“资产管理计划的参与和退出”中的相关限制；逾期未退出的，视同投资者同意合同变更。自征求意见截止之日起，公告内容即成为本合同组成部分。

分。变更后的合同在征求意见截止日次一工作日生效，以管理人网站公告为准。
管理人需将生效公告以邮件形式通知托管人。

若贵行同意本次合同变更内容,请贵行出具加盖公章或合同专用章的同意变更的回函。

本函一式贰份，贵行与本公司各留存壹份。



东
一
勤

限
专

关于上海东亚期货有限公司-沅利六号集合资产管理计划
资产管理合同变更的托管人征询意见函回函

上海东亚期货有限公司：

我行已收悉贵司发送的《关于上海东亚期货有限公司-沅利六号集合资产管理计划资产管理合同变更的托管人征询意见函》。

我行对于以上托管人征询意见函中的变更内容无异议。

