

关于兴业期货-兴合1号集合资产管理计划关联交易相关事项的公告

尊敬的托管人、委托人：

《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令【第203号】）《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2023]2号）（以下简称新《管理办法》、新《运作管理规定》）已于2023年3月1日起施行。根据新《管理办法》及新《运作管理规定》对于资管计划关联交易的相关规定，按照《兴业期货-兴合1号集合资产管理计划资产管理合同》（编号：XY-2021JH001-NEW02，下称“原合同”）关于变更条款的有关约定，现经管理人与托管人协商一致，拟对本合同关联交易有关内容进行变更，下述变更经份额持有人三分之二以上同意后生效，生效日为【2023】年【4】月【27】日，我公司按照本合同约定在合同变更生效日当日设置本计划开放日（如该日为非固定开放日，则设置为临时开放日），如委托人对本次合同变更内容有异议的，可在该开放日内申请退出全部所持份额本计划。具体内容如下：

将原合同“第三十六条”关联交易相关条款变更为：

第三十六条 关联交易

1.本计划存续期间，管理人将本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、其他金融产品或者承销期内承销的证券，或监管规定的其他关联交易情形。

2.关联方界定

根据《企业会计准则第36号-关联方披露》的规定，关联方包括：

- (1) 公司的母公司；
- (2) 公司的子公司；
- (3) 与公司受同一母公司控制的其他企业；
- (4) 对公司实施共同控制的投资方；
- (5) 对公司施加重大影响的投资方；
- (6) 公司的合营企业；
- (7) 公司的联营企业；
- (8) 公司的主要投资者个人及与其关系密切的家庭成员。主要投资者个人，是指能够控制、共同控制一个企业或者对一个企业施加重大影响的个人投资者；
- (9) 公司或其母公司的关键管理人员及与其关系密切的家庭成员。关键管理人员，是指有权力并负责计划、指挥和控制企业活动的人员。与主要投资者个人或关键管理人员关系密切的家庭成员，是指在处理与企业的交易时可能影响该个人或受该个人影响的家庭成员；
- (10) 公司主要投资者个人、关键管理人员或与其关系密切的家庭成员控制、共同控制或施加重大影响的其他企业。

关联方名单详见附件九。如相关法律法规、监管规定、自律规则或管理人公司制度对关联方名单进行调整的，按照调整后的关联方范围执行。关联方名单发生变更的，管理人与托管人将按本合同的约定向投资者披露。

3.一般关联交易和重大关联交易的认定标准

(1) 重大关联交易：

①将本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者承销期内承销的证券；

②资产管理人使用本计划受托财产进行单笔关联交易的金额占本计划净资产比例大于20%的关联交易；

③相关法律法规、监管规定、管理人公司制度规定为重大关联交易的其他情形。

(2) 一般关联交易：除重大关联交易外的关联交易。



法律法规、监管规定、自律规则对一般关联交易及重大关联交易认定标准另有规定的，从其规定。一般关联交易和重大关联交易认定标准发生变化的，管理人将按本合同的约定向投资者披露。

4. 管理人对关联交易的内部管控机制

管理人对关联交易的内部管控遵循公平公正、诚实守信原则，审慎尽责，坚持公平交易，避免利益冲突，禁止利益输送，保护投资者合法权益。管理人已建立关联交易管理制度，对关联交易认定标准、关联交易定价、关联交易审批程序、关联交易的执行、关联交易的监督、报告和信息披露等进行规范。

5. 关联交易禁止条款

(1) 本计划不得向资产管理人、资产托管人出资；

(2) 不得利用本计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资，符合中国证监会规定的例外情形的除外；

(3) 本计划委托资产禁止直接投资兴业银行股票（股票代码：SH.601166）

(4) 法律法规、本合同及中国证监会禁止发生的其它关联交易活动。

6. 关联交易的特别风险提示

管理人运用本计划受托管理资产从事一般关联交易的，投资者签署本合同即表明已经充分理解并同意本计划从事一般关联交易，管理人无需在从事一般关联交易前逐笔取得投资者同意，可能存在投资者在一般关联交易完成前未充分知晓具体交易情况的风险。管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，管理人事先向投资者征求意见，投资者未以指定方式、在指定时间内反馈的，则视为同意管理人以本资产管理计划财产从事重大关联交易。该种方式需要投资人及时关注本合同约定的信息披露途径，如未及时查看或者回复可能造成投资者无法及时干预本计划从事重大关联交易。

管理人根据资产管理合同约定，通过本计划实际开展关联交易活动的，虽然管理人按照监管规定进行关联交易的投资运作管理，积极遵循投资者利益优先原则，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。但仍可能存在监管部门认为管理人内部操作对于关联交易认定标准不清晰、交易定价方法不科学、交易审批程序有瑕疵的风险，以及由于底层证券投资基金的管理人可能存在的信息披露不完整、不准确、不及时导致的管理人信息披露不完整、不准确、不及时的风险。此外，管理人无法确保选择进行关联交易的实际结果比进行类似的非关联交易的实际结果更优，进而可能影响投资者的利益。

7. 关联交易信息披露要求

投资者签署本合同即视为同意管理人以本计划从事一般关联交易，管理人无需就具体的一般关联交易逐笔取得投资者的同意。管理人应当在每季度结束后披露上一季度一般关联交易情况，并通过管理人官网公告、邮件、定期报告、临时报告等方式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、监管规定、自律规则另有规定的，从其规定。

管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，管理人应以管理人网站公告、邮件等方式至少提前5个工作日逐笔向全体投资者征求意见，投资者应按照公告或邮件指定方式告知管理人是否同意。投资者未以指定方式反馈的，则视为同意管理人以本计划财产从事该笔重大关联交易。管理人应在该笔重大关联交易完成后及时通过管理人网站公告、邮件、定期报告、临时报告等方式及时、全面、客观地告知投资者及托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。法律法规、监管规定、自律规则另有规定的，从其规定。

此外，本合同第六十六条第（二）款中“13.关联交易风险”、附件第二条第（二）款中“13.关联交易风险”的内容作相应调整，调整后的内容与第三十六条“6.关联交易的特别风险提示”内容保持一致。

变更后的资产管理合同将由管理人通过电子邮件方式告知。

本公告公示后，委托人未在管理人设置的开放日申请全部赎回的，视为符合本公告及变更后的合同中的“投资者签署即同意”。

如果中国证监会、中国证券投资基金业协会等相关监管部门或自律组织对资产管理产品关联交易等其他内容另有新增规定或要求的，本公司将另行公告，并遵照执行。

特此公告！

兴业期货有限公司（公章）

2023年4月27日



