

# 关于广金期货久期量和多头 1 号集合资产管理计划 拟变更产品名称、投资范围、解聘投资顾问等事项的公告

尊敬的投资者：

广州金控期货有限公司（以下简称“我司”）作为【广金期货久期量和多头 1 号集合资产管理计划】（以下简称“本计划”）的管理人，拟变更本计划的名称、开放日设置、投资范围、投资限制、投资策略、业绩报酬计提比例及解聘投资顾问，主要内容概括如下：

资管合同涉及内容	变更前	变更后
产品名称	广金期货久期量和多头 1 号集合资产管理计划	广金期货多头 1 号集合资产管理计划
托管人及外包机构名称	国泰君安证券股份有限公司	国泰海通证券股份有限公司
投资顾问及投资顾问费	上海久期量和投资有限公司 投资顾问费以管理人已收取的业绩报酬为限从管理人的业绩报酬中支出，管理人支付给投资顾问的业绩报酬比例为 80%。	无
开放日	开放式。本资产管理计划开放日（以下简称 T 日或开放日）为本计划成立之后每周三（如遇到非交易日，默认不顺延）。	开放式。本资产管理计划开放日（以下简称 T 日或开放日）为本计划成立之后每周二、周三（如遇到非交易日，默认不顺延）。管理人有权对开放日进行调整，但调整后每周开放不得超过 2 次，如管理人对开放日进行调整，则资产管理人需至少提前 1 个交易日向投资者公告，并至少提前 1 个交易日通知资产托管人和运营服务机构。

<p><b>投资范围</b></p>	<p>(1) 权益类资产：证券交易所发行上市 的股票（包括但不限于新股申购、优先股、上 市公司非公开发行股票）、港股通标的范围 内的股票、融资融券交易。</p> <p>(2) 固定收益类资产：银行存款（包括但 不限于定期存款、活期存款、协议存款、结 结构性存款及其他银行存款）、现金、货币市 场基金、债券逆回购、同业存单。</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产：证券交易所及 期货交易所交易的衍生品（包括但不限于期 货、期权等）。</p> <p>(4) 资产管理产品类资产：公募证券投资 基金。</p>	<p>(1) 权益类资产：证券交易所发行上市 的股票（包括但不限于新股申购、优先股、 上市公司非公开发行股票）、港股通标的 范围内的股票、融资融券交易。</p> <p>(2) 固定收益类资产：银行存款（包括 但不限于定期存款、活期存款、协议存款、 结构性存款及其他银行存款）、现金、货 币市场基金、债券逆回购、同业存单。</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产：证券交易所 及期货交易所交易的衍生品（包括但不限 于期货、期权等）。</p> <p>(4) 资产管理产品类资产：公募基金、 银行理财产品、证券公司（含证券公司子 公司）资产管理计划、期货公司（含期货 子公司）资产管理计划、基金管理公司（含 基金子公司）资产管理计划、于基金业协 会官方网站公示已登记的私募基金管理 人发行的私募基金。</p>
<p><b>投资策略</b></p>	<p>采用量化选股、统计套利等策略从事 A 股 的量化研究与投资，针对选定对应的股票指 数，根据数学、统计学和计算机等量化模 型构建组合，买入一篮子的股票，同时叠加 日内回转交易，在跟踪指数走势的基础之 上，期望可以获得 Alpha 收益的同时获得 指数 Beta 收益。</p>	<p>本计划将根据宏观经济走势，采用各大类 资产进行配置的投资策略，包括固收策 略、股票策略以及期货期权策略等，通过 动态优化调整各策略配置比例，在降低市 场风险的同时追求稳健回报。</p>
<p><b>投资限制</b></p>	<p>1、本计划的计划资产总值占计划资产净 值的比例不得超过【200%】。计算单个资产 管理计划的总资产按照穿透原则合并计算所 投资资产管理产品的总资产；</p>	<p>1、本计划的计划资产总值占计划资产净 值的比例不得超过【200%】。计算单个 资产管理计划的总资产按照穿透原则合 并计算所投资资产管理产品的总资产；</p>

	<p>2、本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>3、管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；</p>	<p>2、本计划投资于同一资产的资金，不得超过计划资产净值的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；</p> <p>3、管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；</p> <p>4、本计划不得投资于结构化金融产品（含资产证券化产品）的次级/劣后级份额。</p>
业绩报酬	采用单个委托人单笔高水位净值法，业绩报酬提取比例为【25%】。	采用单个委托人单笔高水位净值法，业绩报酬提取比例为【20%】。

资产管理合同本次变更可能对资产管理计划投资者的利益造成影响，为确保公平对待全体投资者，现根据《资产管理合同》第十二节及第二十四节有关约定，就本次拟变更产品名称、开放日设置、投资顾问、投资范围、投资限制、投资策略、业绩报酬计提比例及解聘投资顾问，事先征询资产委托人的意见。

**本次公告征询期为 2025 年 10 月 10 日至 2025 年 10 月 14 日。如投资者同意本次变更，后期需配合管理人签署资产管理合同相关补充协议。如投资者不同意本次变更，投资者可在本计划最近一次固定开放日（2025 年 10 月 15 日）14:00 前进行份额退出，逾期未书面向管理人回复不同意且未在最近一次固定开放日（2025 年 10 月 15 日）14:00 前向管理人提出退出申请的，视为投资者同意管理人本次进行合同变更。**

如投资者有任何疑问，请通过以下方式与管理人联系：

联系人：周俪雯 电话：020-32914200 邮箱：zlw@gzjqh.com

通讯地址：广州市天河区体育西路 191 号中石化大厦 B 塔 25 层 2501-2524 单元

广州金控期货有限公司

2025 年 10 月 9 日