

关于广州期货旗下资产管理计划期权持仓合约价值计算的 说明函

尊敬的资产委托人：

我司作为资产管理人，依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《证券期货经营机构私募资产管理计划备案办法》等相关法律法规及资产管理计划合同的相关约定成立资产管理计划，关于资产管理计划投资的期权持仓合约价值的计算，我司采用期权合约市值（多空绝对值加总）作为计算标准。若后续监管部门针对交易所期权合约价值计算方式有明确规定的，将从其规定。

特此说明。

