

华兴中证 500 指数增强 1 号集合资产管理计划 资产管理合同变更的公告



华兴证券有限公司

二〇二三年九月二十二日



尊敬的资产委托人：

“华兴中证 500 指数增强 1 号集合资产管理计划”(以下简称“本集合计划”) 由我公司担任管理人，中信建投证券股份有限公司担任托管人；本集合计划于 2020 年 12 月 24 日成立。

现基于监管规则变化及本集合计划运作需要，经与托管人协商，我公司拟变更《华兴中证 500 指数增强 1 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》”) 部分条款修订为《华兴中证 500 指数增强 1 号集合资产管理计划资产管理合；变更内容为：

章节	原文	修订
全文	<p>商品及金融衍生品类</p> <p>具有证券相关业务资格的会计师事务所</p> <p>(九)《管理办法》：指中国证监会于 2018 年 10 月 22 日发布并施行的《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 151 号]）。</p> <p>(十)《运作规定》：指中国证监会于 2018 年 10 月 22 日发布并施行的《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[2018]31 号）。</p>	<p>期货和衍生品类</p> <p>符合《证券法》规定的会计师事务所</p> <p>(九)《管理办法》：指中国证监会于 2023 年 3 月 1 日起施行《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]）。</p> <p>(十)《运作规定》：指中国证监会于 2023 年 3 月 1 日起施行的《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）。</p>
<p>第二部</p> <p>分</p> <p>释</p> <p>义</p>	<p>(二十五) 封闭期：本计划的首个封闭期为自本计划成立日起至第一个开放日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放日之间的期间（不含开放日）。</p> <p>(二十九) 工作日、交易日、估值日：均指推广期内各推广机构的工作日，或本集合计划成立后上海证券交易所、深圳证券交易所、中国金融期货交易所等依法设立的期货交易所的共同正常交易日。</p>	<p>(二十五) 封闭期：本计划的首个封闭期为自本计划成立日起至第一个开放日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放日之间的期间（不含开放日）。本计划在封闭期内不办理参与和退出业务。</p> <p>(二十九) 工作日、交易日、估值日：均指推广期内各推广机构的工作日，或本集合计划成立后上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、中国金融期货交易所等依法设立的期货交易所的共同正常交易日。</p>
<p>第四部</p> <p>分</p> <p>人</p> <p>及</p> <p>权</p> <p>利</p> <p>义</p> <p>务</p>	<p>八、托管人的义务包括但不限于： (九) 编制私募资产管理业务托管年度报告，并向协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；</p>	<p>八、托管人的义务包括但不限于： (九) 编制私募资产管理业务托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构；</p>
<p>第八部</p> <p>分</p> <p>本</p> <p>计</p> <p>划</p> <p>的</p> <p>参</p> <p>与</p> <p>、</p> <p>退</p>	<p>五、参与和退出的方式、价格、程序及确认 (五) 参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。</p>	<p>五、参与和退出的方式、价格、程序及确认 (五) 参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。</p>

<p>出与转 让</p>	<p>..... 委托人的申请因不符合法律法规、本合同及《集合计划说明书》的规定被拒绝参与、退出的情形除外。</p>	<p>..... 委托人的申请因不符合法律法规、本合同及计划说明书的规定被拒绝参与、退出的情形除外。</p>
<p>十六、 管理人以自有资金的退出 (四) 自有资金的退出 集合计划存续期间, 管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时, 应当提前 5 个工作日告知委托人和托管人。当出现巨额赎回时, 为流动性风险, 或者中国证监会上, 管理人以自有资金参与集合计划, 不得少于 6 个月, “提前 5 个工作日告知客户和托管人”, “参与集合计划的自有资金不得超过该集合计划总份额的 20%”, 限制, 但需事后及时告知委托人和托管人, 并向住所地中国证监会派出机构及监管机构指定的协会报告。</p>	<p>十六、 管理人以自有资金的退出 (四) 自有资金的退出 集合计划存续期间, 管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时, 应当提前 5 个工作日告知委托人和托管人, 并取得其同意。当出现巨额赎回时, 为流动性风险, 或者中国证监会上, 管理人及其子公司以自有资金参与并遵守本合同约定的前提下, 管理人及托管人, 并向住所地中国证监会派出机构报告。</p>	<p>十六、 管理人以自有资金的退出 (四) 自有资金的退出 集合计划存续期间, 管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于 6 个月。参与、退出时, 应当提前 5 个工作日告知委托人和托管人, 并取得其同意。当出现巨额赎回时, 为流动性风险, 或者中国证监会上, 管理人及其子公司以自有资金参与并遵守本合同约定的前提下, 管理人及托管人, 并向住所地中国证监会派出机构报告。</p>
<p>第十一 部分 资产管理</p>	<p>七、 投资限制和投资禁止 (二) 投资比例限制 新增以下条款:</p>	<p>七、 投资限制和投资禁止 (二) 投资比例限制 新增以下条款:</p>

<p>计划的 投资</p>	<p>“（8）除投资于国债、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外，发生投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过本计划净资产 50% 的情况期间，本计划的总资产不得超过净资产的 120%。”</p>	<p>一、本计划存在或可能存在利益冲突情形包括但不限于： 1、本计划运作过程中从事关联交易； 2、其他可能存在利益冲突的情形。 二、本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率 出现上述利益冲突情形的，管理人应当遵循委托人利益优先原则处理利益冲突，并在符合法律法规和监管政策的前提下，根据具体情况选择在定期报告中披露或进行临时信息披露。 三、本计划从事关联交易情形 （一）关联交易的决策与定价机制 本计划进行关联交易前应当履行必要审批决策程序。 本计划的关联交易应当首先以市场价格作为基准，遵循独立交易原则，选用合理的且被行业广泛应用的合理定价方法。 （二）关联交易的范围 本计划的关联交易包括但不限于： 1、买卖本计划关联方发行的证券或承销期内承销的证券； 2、投资本计划关联方担任管理人的资产管理产品； 3、以本计划的关联方为交易对手进行的交易，以及质押券涉及本计划关联方的，包括但不限于银行间市场交易、大宗交易等； 4、法律法规、监管机构及行业自律机构规定的其他关联交易情形。 （三）本计划关联方的范围 本计划的关联方包括： 1、管理人及其管理的其他资产管理产品； 2、管理人的控股股东、实际控制人，及其各自的控股子公司和实</p>
<p>第十二 部分 利益冲突 及关联 交易</p>	<p>（一）本计划存在或可能存在利益冲突情形：在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定并严格遵守管理人内部有关投资决策管理及关联交易制度的前提下，管理人可能将本计划投资于管理人、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（包括但不限于股票、债券、资产支持证券以及管理人管理的资产管理计划，本章下同）或者承销期内承销的证券（以下统称“关联交易”）。</p> <p>（二）本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率 1、管理人将本计划投资于管理人、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的，管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循委托人利益优先原则，事后向委托人和托管人披露，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护委托人合法权益。 管理人以本计划资产从事重大关联交易的，应事先取得委托人同意，并有充分证据证明未损害委托人利益。 2、委托人授权并同意管理人从事前文所述之关联交易（含重大关联交易），委托人签署本合同即表明其已经充分理解并对前述关联交易（含重大关联交易）作出事先同意及授权，在发生具体关联交易时，管理人无需另行取得委托人的事先授权，委托人不得因本单一计划投资收益劣于管理人或托管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，但该等关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待本计划财产，防止利益冲突，不得损害委托人利</p>	<p>一、本计划存在或可能存在利益冲突情形包括但不限于： 1、本计划运作过程中从事关联交易； 2、其他可能存在利益冲突的情形。 二、本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率 出现上述利益冲突情形的，管理人应当遵循委托人利益优先原则处理利益冲突，并在符合法律法规和监管政策的前提下，根据具体情况选择在定期报告中披露或进行临时信息披露。 三、本计划从事关联交易情形 （一）关联交易的决策与定价机制 本计划进行关联交易前应当履行必要审批决策程序。 本计划的关联交易应当首先以市场价格作为基准，遵循独立交易原则，选用合理的且被行业广泛应用的合理定价方法。 （二）关联交易的范围 本计划的关联交易包括但不限于： 1、买卖本计划关联方发行的证券或承销期内承销的证券； 2、投资本计划关联方担任管理人的资产管理产品； 3、以本计划的关联方为交易对手进行的交易，以及质押券涉及本计划关联方的，包括但不限于银行间市场交易、大宗交易等； 4、法律法规、监管机构及行业自律机构规定的其他关联交易情形。 （三）本计划关联方的范围 本计划的关联方包括： 1、管理人及其管理的其他资产管理产品； 2、管理人的控股股东、实际控制人，及其各自的控股子公司和实</p>

	<p>益。</p> <p>3、本计划在投资运作过程中存在关联交易的，管理人应当依照法律法规、监管规定、自律组织规则及交易所规则等要求就上述关联交易向监管机构、基金业协会或交易所等有权机构报告或备案，并依法通过定期报告或临时报告等形式进行相关披露。</p> <p>(三) 管理人运用计划资产从事关联交易的，应事后及时、全面、客观的向委托人和托管人进行披露。</p> <p>(四) 托管人应根据管理人要求提供托管人关联方信息，如果因托管人未及时向管理人提供或提供的信息不准确导致管理人无法审查相关投资是否构成关联交易的，管理人不承担相关责任。</p>	<p>实际控制的其他公司；</p> <p>3、管理人的控股、参股或者控制的子公司；</p> <p>4、托管人及其控股股东、实际控制人及其他关联方（具体名单以托管人提供给管理人的名单为准）；</p> <p>5、法律法规、监管机构及行业自律机构规定的其他关联方。</p> <p>(四) 重大关联交易</p> <p>本计划从事重大关联交易的情形包括：</p> <p>1、本计划买卖本计划的关联方发行的证券或承销期内承销的证券；</p> <p>2、本计划投资管理及其控股股东、实际控制人或者与管理人存在重大利害关系的公司担任管理人的资产管理产品；</p> <p>3、法律法规、监管机构及行业自律机构规定的其他重大关联交易。资产管理计划从事重大关联交易的，管理人应事先就该笔重大关联交易向全体委托人征求意见，若委托人不同意该笔重大关联交易，应当按照信息披露文件中指定的时间和方式向管理人反馈不同意的意见；如委托人未在限定时间内或未通过指定方式反馈不同意的意见的，视为该委托人同意该笔重大关联交易。</p> <p>(五) 一般关联交易</p> <p>除重大关联交易以外的关联交易，均为一般关联交易。委托人授权并同意管理人从事前文所述之一般关联交易，委托人签署本合同即表明其已经充分理解并对前述一般关联交易作出事先同意及授权，在发生具体一般关联交易时，管理人无需另行取得委托人的事先授权，委托人不得因本计划投资收益劣于管理人或托管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，但该等一般关联交易投</p>
--	---	--

		<p>资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待本计划财产，防止利益冲突，不得损害委托人利益。</p> <p>(六) 本计划在投资运作过程中存在关联交易的，管理人应当依照法律法规、监管规定、自律组织规则及交易所规则等要求就上述关联交易向监管机构、基金业协会或交易所等有权机构报告或备案，并依法通过定期报告或临时报告等形式进行相关披露。</p> <p>(七) 若管理人对关联交易内部控制制度进行修订，修订后的制度中关联方范围、关联交易范围、重大关联交易与一般关联交易的标准与合同约定不一致的，取二者孰严执行。</p> <p>(八) 如法律法规、监管机构或行业自律协会对资产管理计划关联方、关联交易的范围以及重大关联交易与一般关联交易的标准与本合同或管理人内部控制制度约定不一致的，按照法律法规、监管机构或行业自律协会发布的最新规定或要求执行。</p> <p>(九) 管理人运用计划资产从事关联交易的，应事后及时、全面、客观的向委托人和托管人进行披露。管理人运用计划资产从事重大关联交易的，应当按照法律法规、监管机构或行业自律协会发布的要求或规定单独进行信息披露和报告。</p> <p>(十) 托管人应根据管理人要求提供托管人关联方信息，如果因托管人未及时向管理人提供或提供的信息不准确导致管理人无法审查相关投资是否构成关联交易的，管理人不承担相关责任。</p>
<p>第十四部分 投资经理的指定及变更</p>	<p>二、本计划的投资经理的资料如下： 张岩先生，上海交通大学高级金融学院 (SAIF) 金融 MBA，武汉大学金融学学士，现任华兴证券资产管理有限公司执行董事、天风证券研究所资产配置中心总经理等职务，并曾经担任中国期货业协会资产管理业务委员会委员。张岩先生管理的集合资</p>	<p>二、本计划的投资经理的资料如下： 范亭亭，ACCA，管理学硕士。2021 年加入华兴证券资产管理事业部任权益投资经理，具有 8 年权益投资研究相关经验。历任天风证券资产配置中心权益研究员，深圳天风天成资产管理有限责任公司权益研究员、权益投资部负责人。</p>

	<p>产管理计划曾连续 3 年获得 Wind 五星评级、曾获“2016 年度金牛券商集合资产管理计划”。</p>	
<p>第十八部分 越权交易的界定</p>	<p>三、托管人对管理人投资运作的监督 (一) 托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督： 2. 对本计划以下投资限制进行监督： 新增以下条款： “(13) 除投资于国债、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外，发生投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过本计划净资产 50% 的情况期间，本计划的总资产不得超过净资产的 120%。”</p>	
<p>第二十部分 资产管理计划的费用与税收</p>	<p>五、其他事项 与集合计划运营有关的其他费用包括：银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、本计划成立日后与计划相关的资产评估费、律师费、诉讼费、信息披露费用、UKIY 费用、仲裁费、诉讼费、公告费、送达费、保全费、公证费、执行费、拍卖费用、本计划终止清算费用及其他费用。</p>	<p>五、其他事项 与集合计划运营有关的其他费用包括：银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、本计划成立日后与计划相关的资产评估费、律师费、诉讼费、信息披露费用、UKIY 费用、仲裁费、诉讼费、公告费、送达费、保全费、公证费、执行费、拍卖费用、本计划终止清算费用及其他费用。</p>
<p>第二十二部分 信息披露与报告</p>	<p>六、管理人、托管人向监管机构的报告 管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募基金资产管理业务年度报告和私募基金资产管理业务托管年度报告，并报中国证监会派出机构和基金业协会备案。</p>	<p>六、管理人、托管人向监管机构的报告 管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募基金资产管理业务年度报告和私募基金资产管理业务托管年度报告，并报中国证监会派出机构。</p>
<p>第二十三部分 风险揭示</p>	<p>(八) 关联交易风险 根据本合同的约定，管理人可以将本集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人的控股股东、实际控制人或者其他有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，可能存在因管理人未遵循公平原则开展交易，由此损害委托人利益的风险。</p>	<p>(八) 一般关联交易风险 根据本合同的约定，本集合计划可以在取得委托人同意后从事一般关联交易；尽管管理人通过内部控制机制对关联交易进行规范，并将遵循投资者利益优先的原则进行操作，但仍然被金融监管部门认定存在利益输送、内幕交易的风险，从而可能影响资产管理计划的利益。</p>

		<p>(九) 重大关联交易风险</p> <p>根据本合同的约定, 本集合计划可以在取得委托人同意后从事重大关联交易; 尽管管理人通过内部控制机制对关联交易进行规范, 并将遵循投资者利益优先的原则进行操作, 但仍然被金融监管部门认定存在利益输送、内幕交易的风险, 从而可能影响资产管理计划的利益。此外, 在管理人就重大关联交易征求投资者意见时, 如无法取得全体投资者同意, 则该重大关联交易将无法执行, 从而可能造成本计划不能实施既定投资策略的风险, 进而可能影响资产管理计划的投资收益。</p> <p>二、本合同发生变更的, 管理人应按照基金业协会要求及时向基金业协会备案。</p>
<p>第十四部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p>	<p>二、本合同发生变更的, 管理人应按照基金业协会要求及时向基金业协会备案, 并抄报中国证监会派出机构。</p> <p>五、资产管理计划终止的情形, 包括但不限于下列事项: 管理人应当自本计划终止之日起五个工作日内报基金业协会备案, 并抄报中国证监会派出机构, 前述第(六)项约定的情形除外。</p> <p>六、资产管理计划的清算</p> <p>(五) 资产管理计划延期清算的处理方式</p> <p>本集合计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的, 管理人应当及时向中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p> <p>(六) 资产管理计划财产清算报告的告知安排</p> <p>管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算结果报基金业协会备案, 并抄报中国证监会派出机构。</p>	<p>五、资产管理计划终止的情形, 包括但不限于下列事项: 管理人应当自本计划终止之日起五个工作日内报基金业协会, 前述第(六)项约定的情形除外。</p> <p>六、资产管理计划的清算</p> <p>(五) 资产管理计划延期清算的处理方式</p> <p>本集合计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的, 管理人应当及时向中国证监会派出机构报告。</p> <p>(六) 资产管理计划财产清算报告的告知安排</p> <p>管理人应当在计划清算结束后五个工作日内将清算结果报基金业协会。</p>

本集合计划说明书及风险揭示书中对应内容一并调整，本次资产管理合同变更内容已经过托管人中信建投证券股份有限公司确认。

根据《资产管理合同》关于合同变更的相关约定，本次合同变更征询期间为自本公告发布之日起至 2023 年 9 月 28 日。本集合计划在 2023 年 9 月 25 日至 2023 年 9 月 28 日设置特殊退出开放日，委托人不同意合同变更的，应当在特殊退出开放日提出退出申请；委托人未在特殊退出开放日申请退出本集合计划的，视为同意合同变更，无需另行签署新合同。

在符合《资产管理合同》约定的变更生效条件后，变更后的《资产管理合同》将于 2023 年 9 月 29 日起生效，届时不再另行公告，本公告即成为《资产管理合同》的组成部分。2023 年 9 月 29 日后首次申请参与本集合计划的投资者签署的《资产管理合同》版本以本公告附件《华兴中证 500 指数增强 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（2023 年 9 月修订）或届时有效的《资产管理合同》为准。

特此公告。

附件：《华兴中证 500 指数增强 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（2023 年 9 月修订）

华兴证券有限公司

2023 年 9 月 22 日