

# 华安基金-锐进 12 期港股多空对冲策略 资产管理计划投资说明书

资产管理人：华安基金管理有限公司

资产托管人：招商银行股份有限公司

二〇一五年五月

---

## 目 录

|                               |    |
|-------------------------------|----|
| 第一章 重要提示 .....                | 3  |
| 第二章 资产管理计划概况.....             | 4  |
| 一、    资产管理计划基本情况.....         | 4  |
| 二、    资产管理计划的投资.....          | 5  |
| 三、    资产管理计划的初始销售.....        | 6  |
| 四、    资产管理计划的参与、退出和非交易过户..... | 9  |
| 五、    资产管理计划的收益分配.....        | 14 |
| 六、    资产管理业务的费用与税收.....       | 14 |
| 第三章 资产管理合同主要内容.....           | 18 |
| 一、    当事人及权利义务.....           | 18 |
| 二、    报告义务.....               | 22 |
| 三、    资产管理合同的展期.....          | 23 |
| 四、    资产管理合同的变更、终止与财产清算.....  | 24 |
| 五、    违约责任.....               | 27 |
| 六、    法律适用和争议的处理.....         | 30 |
| 七、    资产管理合同的效力.....          | 30 |
| 第四章 资产管理人与资产托管人概况.....        | 32 |
| 一、    资产管理人.....              | 32 |
| 二、    资产托管人.....              | 32 |
| 第五章 风险提示 .....                | 33 |
| 第六章 投资经理的指定与变更.....           | 36 |

---

## 第一章 重要提示

《华安基金-锐进 12 期港股多空对冲策略资产管理计划投资说明书》（以下简称“本投资说明书”）依据《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》（以下简称“《试点办法》”）、《关于基金管理公司开展特定多个客户资产管理业务有关问题的规定》（以下简称“《规定》”）、《基金管理公司特定多个客户资产管理合同内容与格式准则》、《华安基金-锐进 12 期港股多空对冲策略资产管理计划资产管理合同》（以下简称“**本计划资产管理合同**”或“资产管理合同”）及其他有关规定编写。

资产管理人保证本投资说明书的内容真实、准确、完整，不得有任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本投资说明书已报中国证监会备案并获得备案登记，但中国证监会对华安基金-锐进 12 期港股多空对冲策略资产管理计划（以下简称“**本资产管理计划**”或“本计划”）销售的备案，并不表明其对本资产管理计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本资产管理计划没有风险。

本资产管理计划投资于证券市场，计划财产净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的计划份额享受计划收益，同时承担相应的投资风险。本资产管理计划投资中的风险包括：因股票投资、债券投资等因素的影响而形成的市场风险，因受到资产管理人的知识、技能、经验、判断等主观因素影响而形成的管理风险，由于个别证券流动性不足产生的流动性风险，交易对手方发生交易违约或者计划持仓债券的发行人拒绝支付债券本息，导致资产管理计划财产损失产生的信用风险，特定投资方法及资产管理计划所投资的特定投资对象可能引起的特定风险等，操作和技术风险。

客户在投资本资产管理计划之前，请仔细阅读资产管理合同和投资说明书，全面认识本资产管理计划的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

资产管理计划的过往业绩并不预示其未来表现。

资产管理人管理的证券投资基金、其他委托财产的业绩并不构成对本资产管理计划业绩表现的保证。资产管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划财产，但不保证一定盈利，也不保证最低收益。

---

## 第二章 资产管理计划概况

### 一、 资产管理计划基本情况

#### （一）资产管理计划的名称

华安基金-锐进 12 期港股多空对冲策略资产管理计划。

#### （二）资产管理计划的类别

多空对冲型。

#### （三）资产管理计划的开放期

除首个封闭期外，本计划每 3 个月开放一次，每次开放期不超过 5 个连续工作日，其中，前两个开放日仅办理退出业务，其余开放日仅办理参与业务。每个开放期所在月份为上一个月封闭期最后一个工作日所在月份在后续每三个日历月中最后一个日历月，每个开放期的首日为当月恒生国企指数股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。

本计划的首个封闭期为自资产管理合同生效日至后续第 6 个日历月中恒生国企指数股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日（不含该日）。之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本计划在封闭期内不办理参与与退出业务。

若中国证监会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，资产管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知资产委托人。**资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。**

#### （四）资产管理计划的投资目标

在严格控制风险的前提下，追求资产的稳健增值。

#### （五）资产管理计划的存续期限

合同生效起三年。

#### （六）资产管理计划的初始资产规模要求

本资产管理合同生效时的初始资产净值不得低于 3000 万元人民币。

#### （七）资产管理计划份额的初始销售面值

本计划份额的初始销售面值为 1.00 元/份。

#### （八）其他

本资产管理计划设定为均等份额。每份计划份额具有同等的合法权益。

---

## 二、 资产管理计划的投资

### （一）投资目标

在严格控制风险的前提下，追求资产的稳健增值。

### （二）投资范围

本资产管理计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括香港地区和中国大陆地区依法发行上市的股票、债券、证券投资基金、央行票据、短期融资券、资产支持证券、股指期货、及其他金融衍生品，以及法律法规或中国证监会允许资产管理计划投资的其他金融工具。

其中：股票等权益类品种投资比例占计划财产净值的比例为 0-100%；香港地区和中国大陆地区依法发行上市的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券和债券回购以及其它固定收益类金融工具占计划财产净值的比例为 0%-100%；本计划持有的卖出期货合约价值占计划持有的股票等权益类品种总市值的 0%-140%；做多和做空轧差后的净空头敞口不超过计划财产净值的 30%，净多头敞口不超过计划财产净值的 100%。

如法律法规或监管机构以后允许计划投资其他品种，资产管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

### （三）投资策略

#### 1、港股多空策略

通过基本面研究，本计划将选择香港市场上以下几类标的进行重点投资：

- 1) 相对 A 股市场类似板块存在折价的市场板块；
- 2) 行业地位领先，增长确定性强，同时估值水平相比 A 股类似上市公司存在估值折价的个股；
- 3) 在香港市场存在，而 A 股市场稀缺的个股；
- 4) 在一定市场环境下，存在明显上涨机会的板块和个股。

同时，本计划也将做空香港市场上相对 A 股溢价或存在较大下跌风险的板块或个股。一方面，追求在未来港股市场估值结构重构的过程中追求结构性收益；另一方面，也可以一定程度上对冲整个市场波动带来的风险，降低组合收益率波动性。

#### 2、固定收益投资策略

在以上投资策略的基础上，本计划也将部分资产在两地固定收益类资产之间进行灵活

---

配置，以期可以提高资金利用效率，实现资产的长期稳健增值。

#### （四）投资限制

1、本计划持有一家上市公司的股票，其市值不得超过该计划财产净值的 20%。

2、本计划持有单只基金的投资比例不得超过该计划财产净值的 20%。

3、股票等权益类品种投资比例占计划财产净值的比例为 0-100%；香港地区和中国大陆地区依法发行上市的国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、资产支持证券和债券回购以及其它固定收益类金融工具占计划财产净值的比例为 0%-100%；本计划持有的卖出期货合约价值占计划持有的股票等权益类品种总市值的 0%-140%；做多和做空轧差后的净空头敞口不超过计划财产净值的 30%，净多头敞口不超过计划财产净值的 100%。

4、本计划参与股票发行申购时，单个计划所申报的金额不得超过该计划的总资产，单个计划所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

5、法律法规以及中国证监会规定的其他限制。

因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素致使资产管理计划投资不符合上述规定的比例，资产管理人应当在 15 个工作日内调整完毕。法律法规另有规定的从其规定。

#### （五）投资禁止行为

为维护资产委托人的合法权益，本计划不得用于下列投资或者活动：

1、承销证券。

2、向他人贷款或者提供担保。

3、从事承担无限责任的投资。

4、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动。

5、向资产管理人、资产托管人出资。

6、依照法律、行政法规、资产管理合同及国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

#### （六）风险收益特征

本计划具有中高收益和中高风险特征。

### 三、 资产管理计划的初始销售

---

（一）资产管理计划份额的初始销售期间、销售方式、销售对象

1、初始销售期间

本计划初始销售期间自计划份额发售之日起不超过 1 个月。本计划自 2015 年 05 月 27 日至 2015 年 06 月 10 日通过销售机构进行发售。

如果在此期间提前满足《试点办法》第十三条规定的条件的，资产管理人可与销售机构协商决定提前终止初始销售。

资产管理人与销售机构协商决定提前终止初始销售，并在资产管理人网站及时公告，即视为履行完毕提前终止初始销售的程序。资产管理人发布公告提前结束初始销售的，本资产管理计划自公告之时起不再接受认购申请。

2、销售方式

本资产管理计划通过华安基金管理有限公司、招商银行股份有限公司等销售机构进行销售。资产管理人可根据情况变更或增减销售机构，并予以公告。

联系方式如下：

（1）华安基金管理有限公司

联系地址：上海浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层

法定代表人：朱学华

联系人：唐硕

联系电话:021-38969999

联系传真:021-58406138

网址：[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)

（2）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：0755-83077301

传真：0755-83195201

3、销售对象

符合《试点办法》要求，委托投资单个资产管理计划初始金额不低于 100 万元人民币（不含认购费用），且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他特定客户。

---

## （二）资产管理计划份额的认购和持有限额

认购资金应以现金形式交付。投资者初始认购金额不低于 100 万元人民币（不含认购费用）并可追加认购，追加认购金额应为 1 元人民币的整数倍。

## （三）资产管理计划份额的认购费用

### 1、认购费率

本计划的认购费率为 1%。认购费由份额认购人承担，不列入基金财产。

### 2、认购费用和认购金额的计算

本计划的认购金额包括认购费用和净认购金额，认购份额的计算方法如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购利息) / 计划份额初始面值

认购金额的有效份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者在认购期计划投资 100 万元认购本计划份额，假设销售机构收取 1% 的认购费，认购金额在认购期间产生的利息为 500 元。

由于本计划要求资产委托人首次认购金额不低于 100 万元人民币（不含认购费用），则该投资者的净认购金额应为 100 万元。

净认购金额 = 1,000,000

认购金额 =  $1,000,000 \times (1 + 1\%) = 1,010,000$

认购费用 =  $1,010,000 - 1,000,000 = 10,000$

认购份额 =  $(1,000,000 + 500) / 1.00 = 1,000,500$

即投资者需投资 101 万元认购本计划份额方可满足最低 100 万元的净认购要求，认购金额在认购期间产品的利息为 500 元，可得到 100.05 万份本计划份额。

## （四）初始销售期间的认购程序

1、资产管理人委托销售机构进行销售的，由销售机构代为完成对投资者的尽职调查工作，并将相关资料提供给资产管理人。

2、认购程序。资产委托人办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守资产管理合同规定的前提下，以销售机构的具体规定为准。

3、认购申请的确认。认购申请受理完成后，投资者不得撤销。销售网点（或自助渠道）受理认购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（或自助渠道）确实收

---

到了认购申请。认购申请采取时间优先原则进行确认。申请是否有效应以注册登记机构的确认并且资产管理合同生效为准。投资者应在资产管理合同生效后到各销售网点(或自助渠道)查询最终确认情况和有效认购份额。

#### (五) 初始销售期间特定客户资金的管理

资产管理人应当将资产管理计划初始销售期间特定客户的委托资金存入专门账户,在资产管理计划初始销售行为结束前,任何机构和个人不得动用。

### 四、 资产管理计划的参与、退出和非交易过户

#### (一) 参与和退出场所

本资产管理计划通过华安基金管理有限公司、招商银行股份有限公司等销售机构办理参与和退出。资产管理人可根据情况变更或增减销售机构,并予以公告。

联系方式如下:

##### (1) 华安基金管理有限公司

联系地址:上海浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层

法定代表人:朱学华

联系人:唐硕

联系电话:021-38969999

联系传真:021-58406138

网址: [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)

##### (2) 招商银行股份有限公司

注册地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人:李建红

电话: 0755-83077301

传真: 0755-83195201

#### (二) 参与和退出的开放日和时间

除首个封闭期外,本计划每 3 个月开放一次,每次开放期不超过 5 个连续工作日,其中,前两个开放日仅办理退出业务,其余开放日仅办理参与业务。每个开放期所在月份为上一个封闭期最后一个工作日所在月份在后续每三个日历月中最后一个日历月,每个开放期的

---

首日为当月恒生国企指数股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日。

本计划的首个封闭期为自资产管理合同生效日至后续第 6 个日历月中恒生国企指数股指期货交割日前五个工作日的第一个工作日（不含该日）。之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。本计划在封闭期内不办理参与与退出业务。

若中国证监会会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，资产管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知资产委托人。**资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。**

### （三）参与和退出的方式、价格及程序等

1、“未知价”原则，即资产管理计划的参与和退出价格以最后一个参与开放日当日收市后计算的资产管理计划份额净值为基准进行计算。

2、资产管理计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

3、先进先出原则：即按照资产委托人认购及参与的先后次序，处理其退出申请，进行顺序退出。

4、当日的参与和退出申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

5、参与和退出申请的确认。销售网点（或自助渠道）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（或自助渠道）确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先原则进行确认，退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在法律法规规定的时限内对资产委托人参与、退出申请的有效性进行确认。资产委托人应在一个开放周期结束后至各销售网点（或自助渠道）查询最终确认情况。

6、参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，则为无效申请，已交付的款项将退回资产委托人指定资金账户。资产委托人退出申请成交后，资产管理人应按规定向资产委托人支付退出款项，退出款项自确认之日起 5 个工作日内划往资产委托人银行账户。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按资产管理合同和有关法律法规规定处理。

7、资产委托人办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守资产管理合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。资产管理人在不损害资产委托人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日告知资

---

产委托人。**资产管理人提前3个工作日在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。**

#### （四）参与和退出的金额限制

投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，单笔购买金额应不低于 100 万元人民币（不含参与费用）；资产委托人追加购买资产管理计划份额的，追加金额应为 1 元的整数倍。

当投资者持有的计划资产净值高于 100 万元人民币时，投资者可以选择全部或部分退出资产管理计划；选择部分退出资产管理计划的，投资者在退出后持有的计划资产净值不得低于 100 万元人民币。当资产管理人发现投资者申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于 100 万元人民币的，资产管理人有权适当减少该投资者的退出金额，以保证部分退出申请确认后投资者持有的计划资产净值不低于 100 万元人民币。当投资者持有的计划资产净值低于 100 万元人民币（含 100 万元人民币）时，需要退出计划的，投资者必须选择一次性全部退出资产管理计划。

在符合上述规定的前提下，资产管理人可根据市场情况，合理调整对参与金额和退出份额的数量限制。

#### （五）参与和退出的费用

##### 1、参与费用

本资产管理计划的参与费率为 1%。本计划参与费由参与人承担，不列入基金财产。

##### 2、参与费用与参与金额的计算

本计划的参与金额包括参与费用和净参与金额，参与份额的计算方法如下：

净参与金额 = 参与金额 / (1 + 参与费率)

参与费用 = 参与金额 - 净参与金额

参与份额 = 净参与金额 / 受理申请当日收市后计算的资产管理计划份额净值

参与金额的有效份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例：某投资者在参与期计划投资 100 万元参与本计划份额，假设销售机构收取 1% 的参与费，受理申请当日收市后计算的资产管理计划 A 类份额净值为 1.05 元。

由于本计划要求资产委托人购买金额应不低于 100 万元人民币（不含参与费用），则该投资者的净参与金额应为 100 万元。

净参与金额 = 1,000,000

参与金额 = 1,000,000 × (1 + 1%) = 1,010,000

---

参与费用=1,010,000-1,000,000=10,000

参与份额=1 000,000/1.05=952,380.95

即投资者需投资 101 万元参与本计划份额方可满足最低 100 万元的净参与要求,受理申请当日收市后计算的资产管理计划 A 类份额净值为 1.05 元,可得到 952,380.95 份本计划份额。

### 3、退出费用

本资产管理计划不收取退出费。

#### (六) 巨额退出的认定及处理方式

##### 1、巨额退出的认定

资产管理计划的净份额退出申请超过上一日资产管理计划总份额的 20%,为巨额退出。

##### 2、巨额退出的处理方式

出现巨额退出时,资产管理人可以根据本资产管理计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分延期退出。

(1) 接受全额退出:当资产管理人认为有能力兑付资产委托人的全部退出申请时,按正常退出程序执行。

(2) 部分延期退出:当资产管理人认为兑付资产委托人的退出申请有困难,或认为兑付资产委托人的退出申请进行的资产变现可能使计划资产净值发生较大波动时,资产管理人在当日接受退出比例不低于上一日计划总份额 20%的前提下,对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请,应当按单个委托人申请退出份额占当日申请退出总份额的比例,确定该委托人当日受理的退出份额;未受理部分除委托人在提交退出申请时选择将当日未获受理部分予以撤销者外,延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的退出申请不享有退出优先权,退出价格为下一个开放日的价格,以此类推,直到全部退出为止。若确因市场情况导致当年开放日结束时仍未完成全部退出的办理,则可进一步延期,但应于当年开放日结束后 10 个工作日内完成。

当发生退出延迟办理时,资产管理人应当及时告知资产委托人。

#### (七) 拒绝或暂停参与、暂停或延缓退出的情形及处理

##### 1、在如下情况下,资产管理人可以拒绝接受投资者的参与申请:

(1) 资产管理计划份额持有人达到 200 人。

(2) 达到资产管理人事先规定的当次开放期的规模上限。

(3) 根据市场情况,资产管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对资产管理计

---

划业绩产生负面影响，从而损害现有资产委托人的利益的情形。

（4）因资产管理计划收益分配、或资产管理计划内某个或某些证券进行权益分派等原因，使资产管理人认为短期内接受参与可能会影响或损害现有资产委托人利益的。

（5）资产管理人认为接受某笔或某些参与申请可能会影响或损害其他资产委托人利益的。

（6）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定拒绝接受某些资产委托人的参与申请时，参与款项将退回资产委托人账户。

2、在如下情况下，资产管理人可以暂停或顺延开放期接受投资者的参与申请：

（1）因不可抗力导致无法受理资产委托人的参与申请。

（2）证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。

（3）发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值情况。

（4）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

资产管理人决定暂停或顺延开放期接受全部或部分参与申请时，应当告知资产委托人。在暂停参与的情形消除时，资产管理人应及时恢复参与业务的办理并予以告知资产委托人。

3、在如下情况下，资产管理人可以暂停或延缓或顺延开放期接受资产委托人的退出申请：

（1）因不可抗力导致资产管理人无法支付退出款项。

（2）境内、境外相关证券交易场所交易时间临时停市，导致资产管理人无法计算当日资产管理计划财产净值。

（3）发生本资产管理计划合同规定的暂停资产管理计划资产估值的情况。

（4）法律法规规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一的，资产管理人应当及时告知资产委托人。在暂停退出的情况消除时，资产管理人应及时恢复退出业务的办理并及时告知资产委托人。

（八）非交易过户的认定及处理方式

1、资产管理人及注册登记机构只受理继承、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：

“继承”是指资产委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承。

“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将资产委托人持有的计划份额强制

---

划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2、办理非交易过户业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

## **五、 资产管理计划的收益分配**

### **（一）收益分配原则**

1、本计划每个封闭期内最多进行一次收益分配，收益分配基准日为封闭期倒数第二个工作日。在收益分配基准日，当份额净值大于或等于 1.05 元时，本计划方可进行收益分配；每次收益分配比例不得低于收益分配基准日份额净值超过面值部分的 80%。

2、每一计划份额享有同等分配权。

3、本资产管理计划收益分配方式为现金分红。收益分配时发生的银行转账等手续费用由资产委托人自行承担。

4、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

### **（二）收益分配方案的确定与通知**

计划收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

在收益分配方案公布后，资产管理人依据具体方案的规定就支付的现金收益向资产托管人发送划款指令，资产托管人按照资产管理人的指令及时进行现金收益的划付。

## **六、 资产管理业务的费用与税收**

### **（一）资产管理业务费用的种类**

1、资产管理人的管理费。

2、资产托管人的托管费。

3、销售机构的客户服务费。

4、资产管理人依据资产管理合同收取的业绩报酬。

5、计划相关账户开立及维护费用。

6、委托财产的证券交易费用及境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（out-of-pocket fees）；

- 
- 7、资产管理计划相关的验资费、会计师费和律师费。
  - 8、资产管理计划财产的银行汇划费用。
  - 9、外汇兑换交易的相关费用；
  - 10、与缴纳税收有关的手续费、汇款费、税务代理费等；
  - 11、按照国家有关规定和资产管理合同约定，可以在计划资产中列支的其他费用。

(二) 费用计提方法、计提标准和支付方式

1、资产管理人的固定管理费

本计划的固定管理费按计划财产净值的 0.5% 年费率计提。固定管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的固定管理费

E 为前一日的计划财产净值

本计划的固定管理费自资产管理计划合同生效日起，每日计提，按季支付。经资产管理人和资产托管人核对后，由资产托管人于下季初五个工作日之内从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人。

2、资产托管人的托管费

本计划的托管费按计划财产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日的计划财产净值

本计划的托管费自资产管理计划合同生效日起，每日计提，按季支付。经资产管理人和资产托管人核对后，由资产托管人于下季初五个工作日之内从资产管理计划财产中一次性支付给资产托管人。

3、客户服务费

客户服务费按资产管理计划资产净值的年费率计提。计算方法如下：

本计划年客户服务费年费率为 1.00%

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的客户服务费

E 为前一日资产管理计划资产净值

本计划的客户服务费自资产管理合同生效之日起，每日计提，按季支付。经资产管理人和资产托管人核对后，由资产托管人于下季初五个工作日之内，从资产管理计划财产划出，

---

由资产管理人代收，资产管理人收到后支付给销售机构。

#### 4、资产管理人的业绩报酬

##### （1）业绩报酬的计提原则

在资产委托人全部或部分退出资产管理计划或资产管理计划终止财产清算完毕时，资产管理人按资产委托人每笔退出份额或计划终止时所持有份额在资产委托人持有期间增值收益的 20%收取业绩报酬。

##### （2）业绩报酬的计算方法

业绩报酬按份额并以持有期间资产的投资增值部分（包含收益分配部分和净值增长部分）为基础进行计算，具体计算方法如下：

$$\text{业绩报酬} = S_i \times (\text{NAV1} + \sum D - \text{NAV0}) \times 20\%$$

其中：

$S_i$  为资产委托人每笔退出份额或计划终止时所持有的份额

$\text{NAV0}$  为资产委托人每笔退出份额或计划终止时所持有份额所对应的认购或参与时的净值，涉及多笔时间不同的认购或参与份额的，分别计算

$\text{NAV1}$  为退出开放日或计划终止日的计划份额净值

$\sum D$  为持有期每份额累计派发现金红利

业绩报酬由注册登记机构负责计算，资产托管人不承担复核义务，业绩报酬在资产委托人全部或部分退出资产管理计划时或资产管理计划终止财产清算完毕时计提，并在每个封闭期结束后或资产管理计划终止财产清算完毕后的 6-10 个工作日内计提。资产管理人向资产托管人发送划款指令，由资产托管人从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人。

5、证券账户开户费由托管人在开户时先行垫付，产品在证券账户开户一个月内成立的，经管理人与托管人核对无误后，自证券账户开户一个月内由托管人从委托资产中扣划；如证券账户开户一个月内产品未能成立，由管理人在收到托管人缴费通知后的 5 个工作日内支付给托管人，托管人不承担垫付开户费用义务。

6、上述费用根据有关法规及相应协议规定，列入当期费用，由资产托管人从计划财产中支付。

##### （三）不列入资产管理计划业务费用的项目

1、资产管理人和资产托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或计划财产的损失。

2、资产管理人和资产托管人处理与计划运作无关的事项发生的费用。

---

3、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入计划费用的项目。

#### （四）费用调整

资产管理人和资产托管人与资产委托人协商一致，可根据市场发展情况调整管理费率和托管费率、客户服务费率及业绩报酬计算方式，并报中国证监会备案。但费率调整对资产委托人无实质不利影响的，可仅由资产管理人与托管人协商一致，可进行调整并公告，并报中国证监会备案。

#### （五）资产管理业务的税收

本计划运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。组合根据实际从登记结算机构收到的股息、利息等相关收入直接确认收益。资产委托人应缴纳的税收，由资产委托人负责，资产管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

---

## 第三章 资产管理合同主要内容

### 一、 当事人及权利义务

#### （一）资产委托人

##### 1、资产委托人概况

签署资产管理合同且合同正式生效的投资者即为资产管理合同的资产委托人。资产委托人的详细情况在合同签署页列示。

##### 2、资产委托人的权利

- （1）分享资产管理计划财产收益。
- （2）参与分配清算后的剩余资产管理计划财产。
- （3）按照资产管理合同的约定参与和退出资产管理计划。
- （4）监督资产管理人及资产托管人履行投资管理和托管义务的情况。
- （5）按照资产管理合同约定的时间和方式获得资产管理计划的运作信息资料。
- （6）国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他权利。

资产管理计划设定为均等份额，除资产管理合同另有约定外，资产委托人持有的每份计划份额具有同等的合法权益。

##### 3、资产委托人的义务

- （1）遵守资产管理合同。
- （2）交纳购买资产管理计划份额的款项及规定的费用。
- （3）在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任。
- （4）及时、全面、准确地向资产管理人告知其投资目的、投资偏好、投资限制和风险承受能力等基本情况。
- （5）向资产管理人或其销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合资产管理人履行反洗钱义务。
- （6）不得违反资产管理合同的约定干涉资产管理人的投资行为。
- （7）不得从事任何有损资产管理计划及其投资人、资产管理人管理的其他资产及资产托管人托管的其他资产合法权益的活动。
- （8）按照资产管理合同的约定承担资产管理费、托管费、客户服务费、业绩报酬以及因资产管理计划财产运作产生的其他费用。

---

(9) 国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。

(二) 资产管理人

1、资产管理人概况

名称：华安基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 31 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 31 楼

邮政编码：200120

法定代表人：朱学华

联系人：唐硕

联系电话：021-38969999

2、资产管理人的权利：

(1) 按照资产管理合同的约定，独立管理和运用资产管理计划财产。

(2) 按照资产管理合同的约定，及时、足额获得资产管理人报酬。

(3) 按照有关规定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利。

(4) 根据资产管理合同及其他有关规定，监督资产托管人；对于资产托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定的行为，对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会。

(5) 自行销售或者委托有基金销售资格的机构销售资产管理计划，制定和调整有关资产管理计划销售的业务规则，并对销售机构的销售行为进行必要的监督。

(6) 自行担任或者委托经中国证监会认定的可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构担任资产管理计划份额的注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查。

(7) 视市场状态、投资判断及运营成本的情况，主动终止本计划，届时将提前十个工作日在资产管理人网站上公告。

(8) 国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他权利。

3、资产管理人的义务

(1) 办理资产管理计划的备案手续。

(2) 自资产管理合同生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产管理计划财产。

(3) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理

---

和运作资产管理计划财产。

（4）建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的资产管理计划财产与其管理的基金财产、其他委托财产和资产管理人的财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，进行投资。

（5）除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，不得为资产管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产。

（6）办理或者委托经中国证监会认定的可办理开放式证券投资基金份额登记业务的其他机构代为办理资产管理计划份额的登记事宜。

（7）按照有关合同和规定行使资产管理计划财产投资权利而应承担的义务，包括但不限于选择经纪商及投资标的等。

（8）按照资产管理合同的约定接受资产委托人和资产托管人的监督。

（9）以资产管理人的名义，代表资产委托人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

（10）根据《试点办法》和资产管理合同的规定，编制并向资产委托人报送资产管理计划财产的投资报告，对报告期内资产管理计划财产的投资运作等情况做出说明。

（11）根据《试点办法》和资产管理合同的规定，编制特定资产管理业务季度及年度报告，并向中国证监会备案。

（12）计算并按照资产管理合同的约定向资产委托人报告资产管理计划份额净值。

（13）进行资产管理计划会计核算。

（14）保守商业秘密，不得向任何第三方泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，但法律法规、资产管理合同及监管机构另有规定的除外。

（15）保存资产管理计划资产管理业务活动的全部会计资料，并妥善保存有关的合同、协议、交易记录及其他相关资料。

（16）公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。

### （三）资产托管人

#### 1、资产托管人概况

名称：招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

---

联系人：张燕

联系电话：0755-83199084

网站：<http://www.cmbchina.com>

## 2、资产托管人的权利

(1) 按照资产管理合同的约定，及时、足额获得资产托管费。

(2) 根据资产管理合同及其他有关规定，监督资产管理人对资产管理计划财产的投资运作，对于资产管理人违反资产管理合同或有关法律法规规定的行为，对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的情形，有权报告中国证监会并采取必要措施。

(3) 按据资产管理合同的约定，依法保管资产管理计划财产。

(4) 资产托管人可根据需要决定是否聘任境外托管人。资产托管人有权选择、更换境外托管人。根据资产管理计划财产的投资地域，境外托管人可能不时委任次托管人在境外作为境外托管人的代理人履行托管职责。为避免歧义，除非上下文另有约定，否则资产管理合同中所称的境外托管人均包括次托管人。

(5) 国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他权利。

境外托管人在履行职责过程中，因本身过错、疏忽原因而导致的基金财产受损的，资产托管人承担相应责任。在决定境外托管人是否有过错、疏忽等不当行为，应根据境外资产托管人所在地法律、投资地法律及投资当地的证券市场惯例决定。

## 3、资产托管人的义务

(1) 安全保管资产管理计划财产。

(2) 设立专门的资产托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉资产托管业务的专职人员，负责财产托管事宜。

(3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立。

(4) 除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，不得为资产托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产。

(5) 按规定开设和注销资产管理计划的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。

(6) 复核资产管理计划份额净值。

(7) 复核资产管理人编制的资产管理计划财产的投资报告，并出具书面意见。

(8) 编制资产管理计划的年度托管报告，并向中国证监会备案。

(9) 按照资产管理合同的约定，根据资产管理人的投资指令，及时办理清算、交割事

---

宜。

（10）根据法律法规及监管机构的有关规定，保存资产管理计划资产管理业务活动有关的合同、协议、凭证等文件资料。

（11）公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动。

（12）保守商业秘密，不得向任何第三方泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，但法律法规、资产管理合同及监管机构另有要求的除外。

（13）按照法律法规及资产管理合同的规定监督资产管理人的投资运作，资产托管人发现资产管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知资产管理人并及时报告中国证监会；资产托管人发现资产管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反资产管理合同约定的，应当立即通知资产管理人并及时报告中国证监会。

（14）国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。

## 二、 报告义务

### （一）运作期报告

#### 1、资产管理人向资产委托人提供的报告种类、内容和提供时间

##### （1）年度报告

资产管理人应当编制年度报告，在年度结束后 90 天内向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。其中，资产管理人在每年结束后 60 天内完成年度报告并提供资产托管人复核，资产托管人在收到后 30 天内对相关财务数据进行复核。资产管理计划成立未满 3 个月，不编制当期的年度报告。

##### （2）季度报告

资产管理人应当在每季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成计划季度报告并经资产托管人复核后，向资产委托人披露投资状况、投资表现、风险状况等信息。资产管理人应于每季度结束之日起 8 个工作日内完成季度报告，并将季度报告提供资产托管人复核，资产托管人在收到后 7 个工作日内完成复核，并将复核结果书面通知资产管理人。资产管理计划成立未满 2 个月，不编制当期的季度报告。

##### （3）净值报告

---

资产管理人每月至少应向资产委托人报告一次经资产托管人复核的计划份额净值。

(4) 上述向资产委托人提供的报告中涉及证券投资明细的报告，原则上每季度至多报告一次。该等明细报告仅需包含报告基准日的主要持仓，而无需报告报告期内计划的交易明细。

## 2、资产管理人向资产委托人提供报告及资产委托人信息查询的方式

资产管理人向资产委托人提供的报告，将严格按照《试点办法》及其他有关规定通过以下至少一种方式进行。资产委托人信息查询将通过以下至少一种中国证监会允许的、资产管理合同约定的方式进行。

### (1) 网站

《资产管理合同》、《投资说明书》、定期报告、临时报告等有关本资产管理计划的信息将在资产管理人网站上披露，资产委托人可随时查阅。

网址：[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)

### (2) 邮寄服务

资产管理人向资产委托人邮寄定期报告、临时报告等有关本计划的信息。资产委托人在合同签署页上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，资产委托人应当及时通知资产管理人。

### (3) 传真或电子邮件

如资产委托人留有传真号、电子邮箱等联系方式的，资产管理人也可通过传真、电子邮件、电报等方式将报告信息通知资产委托人。

## 3、资产托管人向资产委托人提供计划财产托管情况查询的方式

资产托管人按照规定定期向资产委托人提供资产托管报告，置于托管人办公地点备查，委托人可在营业时间前来查询。

## (二) 向监管机构的报告

资产管理人、资产托管人应当根据法律法规和监管机构的要求履行报告义务。资产托管报告由托管人向管理人提供，由管理人与特定资产管理业务管理年度报告一并报中国证监会备案。

## 三、 资产管理合同的展期

---

### （一）展期的条件

资产管理合同如需要展期的，资产管理人应当在资产管理合同期限届满 1 个月前，按照资产管理合同约定的方式取得资产托管人和 2 个（含）以上的资产委托人同意。

### （二）展期的方式

在法律、法规允许的范围内，管理人可以对资产管理合同进行展期。委托人在做出是否同意计划展期的意见的同时，还可以选择是否在资产管理人指定的日期退出资产管理计划，或继续持有展期后的资产管理计划。

### （三）展期的程序

#### 1、展期的申请

资产管理合同存续期满拟展期时，管理人应当至少在存续期届满前 1 个月前征求资产托管人同意继续托管展期后的计划资产。

#### 2、委托人参与展期

资产管理计划展期申请经资产托管人同意后，管理人以管理人网站公告及书面两种形式，提示委托人可以：

在本资产管理计划开放期退出本资产管理计划；

继续参与本资产管理计划，在存续期满日如本资产管理计划达到计划成立条件，则本资产管理计划将展期，委托人可以在展期后的开放期退出本计划；

继续参与本资产管理计划，在存续期满日如本资产管理计划没有达到计划成立条件，本资产管理计划将终止，管理人将按照本资产管理计划终止程序处理资产返还事宜。

截至本资产管理计划存续期满日，委托人未明示提出不参与展期申请的，视为继续参与本资产管理计划。

## 四、 资产管理合同的变更、终止与财产清算

### （一）合同的变更

资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致后，可对资产管理合同内容进行变更。

资产管理合同约定资产管理人有权变更合同内容的情形可由资产管理人根据相关法律法规规定及资产管理合同的约定办理合同变更，并至少应于变更前 15 日书面通知资产委托

---

人和资产托管人，上述情形包括：

- 1、投资经理的变更。
- 2、资产管理计划认购、参与、退出、非交易过户的原则、时间、业务规则等变更。
- 3、因相应的法律法规发生变动而应当对资产管理合同进行变更。
- 4、对资产管理合同的变更不涉及合同当事人权利义务关系发生变化。
- 5、对资产管理合同的变更对资产委托人、资产托管人利益无不利影响。

#### （二）合同变更的备案

对资产管理合同任何形式的变更、补充，资产管理人应当在变更或补充发生之日起 5 个工作日内将资产管理合同样本报中国证监会备案。在资产管理计划运作期间开放参与和退出或发生资产委托人违约退出的，资产管理人应当于每季度结束之日起 15 个工作日内将客户资料表报中国证监会备案。

#### （三）合同终止的情形

资产管理合同终止的情形包括下列事项：

- 1、资产管理合同存续期限届满而未延期的；
- 2、资产管理合同的委托人少于 2 人的；
- 3、资产管理人被依法取消特定客户资产管理业务资格的；
- 4、资产管理人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 5、资产托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产的；
- 6、经全体委托人、资产管理人和资产托管人协商一致决定终止的；
- 7、资产管理人视市场状态、投资判断及运营成本的情况，选择主动终止本计划；
- 8、法律法规和资产管理合同规定的其他情形。

#### （四）资产管理计划财产的清算

1、资产管理合同终止时，应当按法律法规和资产管理合同的有关规定对计划财产进行清算。

##### 2、资产管理计划财产清算小组

（1）计划财产清算小组成员由资产管理人、资产托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

##### 3、清算程序

---

(1) 计划合同终止情形发生后，由计划财产清算小组统一接管计划财产。

(2) 计划财产清算小组根据计划财产的情况确定清算期限。

(3) 计划财产清算小组对计划财产进行清理和确认。

(4) 对计划财产进行变现

合同终止后，资产管理计划仍持有可流通非现金资产的，在 5 个交易日内（含合同终止日当日）由资产管理人进行强制变现处理；资产管理计划持有的流通受限证券，如未到期回购、未上市新股等，自限制条件解除日起（含解除当日）3 个交易日内完成变现。未变现资产于清算期间损益由全体资产委托人享有或承担。

(5) 制作清算报告

资产管理人编制清算报告交资产托管人复核后，由资产管理人向中国证监会备案并告知资产委托人。

(6) 对计划财产进行分配

#### 4、清算费用

清算费用是指计划财产清算小组在进行计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由计划财产清算小组优先从计划财产中支付。清算费用包括但不限于：

(1) 聘请会计师、律师，以及其他工作人员所发生的报酬；

(2) 资产管理计划资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；

(3) 信息披露所发生的费用；

(4) 诉讼仲裁所发生的费用；

(5) 其他与清算事项有关的费用。

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外，所有清算费用由资产管理人向资产托管人出具指令，由资产托管人复核后办理支付。

#### 5、计划剩余财产的分配

依据资产管理计划财产清算的分配方案，将资产管理计划财产清算后的全部剩余资产扣除资产管理计划财产清算费用及各项负债后，按资产管理计划的投资人持有的计划份额比例进行分配。计划财产按下列顺序清偿：

(1) 支付清算费用。

(2) 交纳所欠税款。

(3) 清偿计划债务。

(4) 按计划份额持有人持有的计划份额比例进行分配。

---

如存在资产管理计划财产未能及时变现的,资产管理人应在清算报告中列明与未变现资产相关的估值方法、费用计提及分配方法等的处理程序。

计划财产未按前款(1)、(2)、(3)项规定清偿前,不分配给计划份额持有人。

6、计划财产清算账册及文件由计划资产管理人保存 15 年以上。

#### (五) 资产管理计划财产相关账户的注销

在证券资产变现完毕、相关权益结清后 5 个工作日内,资产管理人将委托资产托管人注销资产管理计划财产证券账户的通知书及其他销户资料寄送资产托管人,资产托管人原则上应于收到资产管理人、资产委托人提供资料后的 10 个工作日内完成证券账户注销。

资产管理人在开放式基金变现完毕、相关权益结清后 15 个工作日内完成场外开放式基金账户注销,并向资产托管人出具销户确认通知书。

计划财产清算完毕后,资产托管人注销资产管理计划的资金账户,资产管理人应给予必要的配合。

## 五、 违约责任

(一)因资产管理合同当事人的违约行为造成资产管理合同不能履行或者不能完全履行的,由违约的一方承担违约责任;如属资产管理合同当事人双方或多方当事人的违约,根据实际情况,由违约方分别承担各自应负的违约责任。但是发生下列情况,当事人可以免责:

1、资产管理人和/或资产托管人按照中国证监会的规定或当时有效的法律法规、资产管理合同约定的作为或不作为而造成的损失等。

2、在没有故意或重大过失的情况下,资产管理人由于按照资产管理合同规定的投资原则而行使或不行使其投资权而造成的损失等。

3、资产托管人对因为资产管理人投资产生的存放或存管在资产托管人以外机构(不含境外托管人等资产托管人的代理人)的委托财产,或交由期货公司或证券公司负责清算交收的委托资产(包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等)及其收益;由于该等机构或该机构会员单位等资产管理合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给委托财产造成的损失等。

4、资产托管人对于存放在资产托管人以外(不含境外托管人等资产托管人的代理人)银行账户内的资金的损失,以及因资产管理人投资运作产生的实际存管在交易对手、中介机构等其他机构、不在资产托管人保管和控制范围内的委托资产中的证券、债券、票据资产等

---

有价证券等实物的毁损造成的损失。

5、资产管理人对因其投资产生的存放或存管在资产托管人以外机构（不含境外托管人等资产托管人的代理人）的委托资产，在谨慎挑选并要求保证委托财产安全的前提下，就该机构对委托财产的安全保管义务及该机构或该机构会员单位等资产管理合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给委托财产造成的损失等。

6、资产管理人及资产托管人对因所引用的投资对象、证券经纪商及其他中介机构提供的信息的真实性、准确性和完整性存在瑕疵，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的。

7、资产委托人理解委托财产的投资、运作、托管面临资产管理合同第二十章中列举的各类风险，资产管理人及资产托管人就委托财产面临的上述固有风险免于承担责任。

8、对于无法预见、无法抗拒、无法避免且在资产管理合同签署之日后发生的不可抗力事件，导致合同当事人方无法全部履行或部分履行资产管理合同的，任何一方当事人不承担违约责任，但是，合同各方当事人应当在合理行为能力范围内勤勉尽责，以降低此类事件对委托财产和其他当事人方的影响；

9、因证券市场波动、上市公司合并、计划财产规模变动、股权分置改革中支付对价等资产管理人之外的因素致使计划财产投资不符合资产管理合同项下约定的投资策略的，将不视为资产管理人的违约行为。

10、境外资产托管人在收到与证券账户中持有的证券有关的在公开渠道或代理人获得的公司行动信息后，应按约定将所收到的公司行动的详细资料及回复截止期限通知资产托管人和资产管理人，除非该等信息或资料可以由境外资产托管人在其会采用的其他渠道作核对，境外资产托管人对该等信息或资料的准确性或完整性不负上任何责任。若在境外资产托管人列明的回复截止期限前没有得到资产管理人的对公司行动做出的指令，境外资产托管人将按照资产管理人预设的公司行动标准指令或在有关公司行动的通知上所列的市场预设模式行事，如没有预设的公司行动标准指令，境外资产托管人将不执行该项公司行动。

11、委托人、资产管理人和资产托管人认可境外资产托管人和境外资产托管人的授权代理人(包括次托管人)可能采取任何境外资产托管人或其前述授权代理人在其合理酌情权下合理的任何行动以遵守任何关于防止欺诈、防止洗钱、反恐怖或防止其他刑事犯罪活动或为可能受到制裁的任何个人或实体提供金融或其他服务的法律、法规、公共或监管机构的强制要求(“相关要求”)。该等行动可能包括但不限于:拦截和调查基于本协议项下委托财产的任何交易(特别是那些涉及资金国际转移的交易),包括有关资金付出和收入的资金来源和资

---

金的拟收款人,和其他由资产管理人或以资产管理人名义发出或发往资产管理人或资产管理人名下的任何讯息。在某些情况下,该行动可能延迟或阻止适当指令的处理,关于本协议项下委托财产交易的清算,或境外资产托管人履行本协议下的义务。但境外资产托管人将尽力通知资产管理人和资产托管人该等情况的存在。

全部或部分因境外资产托管人或境外资产托管人的授权代理人(包括次托管人)为遵守法律规定而采取的任何合理行动而造成或引起任何人遭受的损失(无论是直接损失还是间接损失,包括但不限于利润和利益的损失)或损害,境外托管人及其任何关联方、资产托管人均不负责。

12、法律法规规定及资产管理合同约定的其他情况。

(二)资产管理人、资产托管人在履行各自职责的过程中,违反法律法规的规定或者资产管理合同约定,给计划财产或者资产委托人造成损害的,应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任,但不因各自职责以外的事由与其他当事人承担连带赔偿责任;资产管理人、资产托管人因共同行为给计划财产或资产委托人造成损害的,应当承担连带赔偿责任。

(三) 违约退出

1、资产委托人在合同约定的开放日之外的日期或时间主动提出退出申请的,视为违约退出。

2、违约退出的处理。

(1) 违约退出的方式和金额限制、业绩报酬的计算等。参照资产管理合同“资产管理计划的参与和退出”等条款的约定。

(2) 违约退出的程序。资产委托人违约退出的,需遵循销售机构或资产管理人的违约退出规定。详细规则以销售机构或资产管理人的公布为准。

(3) 违约退出的价格。违约退出份额净值为申请受理当日的计划份额净值。

(4) 退出违约金。资产委托人违约退出的,应支付净退出金额(扣除管理费、托管费和业绩报酬等费用后的实际退出金额)的 2%作为退出违约金,退出违约金全额归入资产管理计划财产。

(5) 违约退出金额和违约金的计算:

违约退出款项的计算方法如下:

违约退出总额=退出份额×退出受理当日计划份额净值

违约退出金额=违约退出总额－业绩报酬

违约金=违约退出金额×违约退出费率

---

违约退出净额=违约退出金额-违约金

在资产管理计划运作期间发生资产委托人违约退出的，资产管理人应当于违约退出申请确认后 5 个工作日内将客户资料表报中国证监会备案。

(6) 因资产委托人违约退出可能导致合同终止而影响其他委托人权益的，资产管理人有权拒绝或部分接受资产委托人的违约退出申请，即资产管理人有权但无义务办理违约退出。

(四) 在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护资产委托人利益的前提下，资产管理合同能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

## 六、 法律适用和争议的处理

有关资产管理合同的签署和履行而产生的任何争议及对资产管理合同项下条款的解释，均适用中华人民共和国法律法规（为资产管理合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规），并按其解释。

各方当事人同意，因资产管理合同而产生的或与资产管理合同有关的一切争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会华南分会，根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为深圳，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。

争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护资产委托人的合法权益。

## 七、 资产管理合同的效力

(一) 资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。资产委托人为法人的，资产管理合同经资产委托人、资产管理人和资产托管人加盖公章以及三方法定代表人或授权代表签字之日起成立；资产委托人为自然人的，资产管理合同经资产委托人本人签字或授权的代理人签字、资产管理人和资产托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字之日起成立。资产管理合同于资产管理计划备案手续办理完毕，获中国证监会书

---

面确认之日起生效。

（二）资产管理合同自生效之日起对资产委托人、资产管理人、资产托管人具有同等的法律约束力。

（三）资产管理合同一式叁份，当事人各执壹份，每份具有同等的法律效力。

（四）资产管理合同有效期为 3 年。

---

## 第四章 资产管理人与资产托管人概况

### 一、 资产管理人

名称：华安基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 31 楼

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 31 楼

邮政编码：200120

法定代表人：朱学华

联系人：唐硕

联系电话：021-38969999

网站：[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)

### 二、 资产托管人

名称：招商银行股份有限公司

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：张燕

联系电话：0755-83199084

网站：<http://www.cmbchina.com>

---

## 第五章 风险提示

计划投资可能面临下列各项风险，包括但不限于：

### （一）市场风险

证券市场价格因受各种因素的影响而引起的波动，将使计划资产面临潜在的风险。市场风险可以分为股票投资风险和债券投资风险。

#### 1、股票投资风险主要包括：

（1）国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响，导致市场价格水平波动的风险。

（2）宏观经济运行周期性波动，对股票市场的收益水平产生影响的风险。

（3）上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致股票价格变动的风险。

#### 2、债券投资风险主要包括：

（1）市场平均利率水平变化导致债券价格变化的风险。

（2）债券市场不同期限、不同类属债券之间的利差变动导致相应期限和类属债券价格变化的风险。

（3）债券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险。

### （二）管理风险

在实际操作过程中，资产管理人可能限于知识、技术、经验等因素而影响其对相关信息、经济形势和证券价格走势的判断，其精选出的投资品种的业绩表现不一定持续优于其他投资品种。

### （三）流动性风险

在市场或个股流动性不足的情况下，资产管理人可能无法迅速、低成本地调整投资计划，从而对计划收益造成不利影响。

在资产委托人提出追加或减少资产管理计划财产时，可能因巨额退出而顺延办理或延迟支付款项，同时存在现金不足的风险和现金过多带来的收益下降风险。

### （四）信用风险

本计划交易对手方发生交易违约或者计划持仓债券的发行人拒绝支付债券本息，导致资

---

产管理计划财产损失。

(五)特定的投资方法及资产管理计划财产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险  
本计划采取的投资策略可能存在使计划收益不能达到投资目标或者本金损失的风险。

#### 1、海外市场风险

海外市场风险是指由于海外市场因素如基础利率、股票价格和商品价格的变化或由于这些市场因素的波动率的变化而引起的证券价格的非预期变化，并产生损失的可能性。

#### 2、汇率风险

汇率的不利变动可能对资产带来影响，从而使得委托资产面临损失的可能性。

#### 3、法律及政治管制风险

由于各个国家/地区适用不同法律法规的原因，可能导致委托财产的某些投资行为在部分国家/地区受到限制或合同不能正常执行，从而使得委托财产面临损失的可能性。

#### 4、上市公司经营风险

由于委托财产所投资于香港发行的股票。上市公司的经营状况受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使委托财产投资收益下降。

#### 5、税务风险

在投资各国或地区市场时，因各国、地区税务法律法规的不同，可能会就股息、利息、资本利得等收益向各国、地区税务机构缴纳税金，包括预扣税，该行为可能会使得资产回报受到一定影响。各国、地区的税收法律法规的规定可能变化，或者加以具有追溯力的修订，所以可能须向该等国家或地区缴纳委托财产销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

#### 6、多空策略风险

所谓多空对冲策略投资，即在买入看多资产的同时卖出具有一定相关性的看空资产。多空对冲策略的使用虽然总体上会降低投资组合的投资风险，但是，在极端市场环境下可能面临多空双边亏损的情况，进而给计划资产带来较大损失。

#### (六)操作或技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

---

在计划的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致资产委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理公司、注册登记机构、销售机构、证券交易所、证券注册登记机构等。

(七) 其他风险

战争、自然灾害等不可抗力因素的出现,将会严重影响证券市场的运行,可能导致计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出资产管理人自身直接控制能力之外的风险,可能导致资产委托人利益受损。

---

## 第六章 投资经理的指定与变更

### （一）投资经理的指定

#### 1、投资经理的指定

资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定，且本投资经理与资产管理人所管理的证券投资基金的基金经理不得相互兼任。办理特定资产管理业务的投资经理应当报中国证监会备案。

#### 2、本计划投资经理

本资产管理计划财产投资经理为陆秋渊。

陆秋渊，复旦大学世界经济硕士研究生，2007年7月应届毕业生进入华安基金管理有限公司，任全球投资部研究员、投资经理助理。

### （二）投资经理的变更

资产管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知资产委托人。**资产管理人提前3个工作日在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。**