

华安理财安赢套利 1 号限额特定资产管理计划资产管理合同 变更征询函

尊敬的投资者：

华安理财安赢套利 1 号限额特定资产管理计划资产管理计划以下简称“本集合计划”）成立于 2013 年，为了满足广大投资者对本集合计划的投资需求，保证产品的平稳运行，根据中国证券监督管理委员会于 2013 年 6 月 26 日发布的最新《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》相关规定以及《华安理财安赢套利 1 号限额特定资产管理计划说明书》和《华安理财安赢套利 1 号限额特定资产管理合同》的约定，经与托管人交通银行股份有限公司协商一致后，本集合计划管理人拟在征询本集合计划委托人的意见基础上对本集合计划合同部分条款进行变更。征询对象为截至 2015 年 7 月 31 日登记在册的本集合计划委托人。征询方式为短信或电子邮件。

合同变更要点为：修改集合计划目标规模为无上限限制；调整投资范围和投资比例的文字表述，投资范围新增期权等金融衍生品；修改集合计划期限为无固定期限；修改集合计划开放期为每个月前三个工作日；修改集合计划退出费用收费期限；修改管理人自有资金参与集合计划的相关表述。说明书在此基础上做出如下变更：修改集合计划目标规模为无上限限制；修改投资范围和投资比例的文字表述；修

改集合计划期限为无固定期限；修改集合计划开放期为每个月前三个工作日；修改集合计划退出费用收费期限；修改管理人自有资金参与集合计划的相关表述。相关内容一并变更，具体见附表。

敬请委托人关注，本集合计划管理人拟于近期向全体委托人发送本集合计划合同变更征求意见短信、邮件。对本集合计划合同变更持反对意见的委托人，可通过回复短信、电子邮件的形式表示异议，也可通过拨打本公司客服电话 96518（安徽）、4008096518（全国）表示异议；未回复的委托人视为同意此变更。合同变更后，本公司将于每个月前三个工作日安排产品开放赎回（若有变动，管理人将公告通知）。

本集合计划管理人将在同意变更的委托人的数量达到合同约定要求后，通过管理人网站向委托人公告本集合计划合同变更事宜，并向中国证券业协会备案，同时抄送安徽省证监局。公告期满后按照变更后的条款执行。

华安证券股份有限公司

2015 年 7 月 23 日

附件：华安理财安赢套利 1 号限额特定资产管理计划资产管理合同条款变更对照表

变更前	变更后
《华安理财安赢套利1号限额特定资产管理计划资产管理合同》	《华安理财安赢套利1号限额特定资产管理计划资产管理合同（2015年7月变更）》
第四节第（三）条“目标规模”（P7）	
本集合计划推广期和存续期规模上限为 3 亿份。	本集合计划推广期和存续期无规模上限限制。
第四节第（四）条“投资范围和投资比例”（P7）	
<p>1、投资范围</p> <p>本计划的投资范围包括国内依法发行的股票、债券、证券投资基金、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、股指期货等金融衍生品、商品期货等证券期货交易所交易的投资品种，利率远期、利率互换等银行间市场交易的投资品种，证券公司专项资产管理计划、商业银行理财计划、集合资金信托计划等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可以参与融资融券交易，也可以将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司。</p> <p>2、资产配置比例（市值占总资产</p>	<p>1、投资范围</p> <p>本计划的投资范围包括国内依法发行的股票、债券、证券投资基金、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、股指期货、期权等金融衍生品、商品期货等证券期货交易所交易的投资品种，利率远期、利率互换等银行间市场交易的投资品种，证券公司专项资产管理计划、商业银行理财计划、集合资金信托计划等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可以参与融资融券交易，也可以将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司。管理人应考虑托管人系统首次开发及后续修改、测试所需的时间，待托管人书</p>

<p>比例)</p> <p>(1) 固定收益类资产(一年期以上的国债、金融债、一年期以上的政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、一年期以上的央行票据、中期票据、短期融资券、债券型基金、资产支持受益凭证、期限大于7天的债券逆回购等): 0~95%</p> <p>(2) 权益类资产(国内上市的A股及权证、股票型基金、混合型基金、买入股指期货合约价值等): 0~95%</p> <p>(3) 现金类资产(现金、银行存款、一年期以内的国债、一年期以内的央行票据、一年期以内的政策性金融债、期限小于或等于7天的债券逆回购、货币市场基金等): 5~100%</p> <p>(4) 期货等衍生品(股指期货、商品期货等): 0~80%(买入股指期货合约价值加卖出股指期货合约价值+买入商品期货合约价值加卖出商品期货合约价值合计计算)</p> <p>在任一时点,本计划持有股指期货的风险敞口不得超过计划净值的80%,并保持不低于交易保证金1倍的现金或到期日在一年以内的政府债券。</p> <p>本计划以套保、套利为目的参与股指期货交易,风险敞口按以下方法计算:</p> <p>对于以套保、套利为目的参与股</p>	<p>面确认系统开发完成后,才可进行期权、融资融券交易。</p> <p>2、资产配置比例(市值占总资产比例)</p> <p>(1) 固定收益类资产(一年期以上的国债、金融债、一年期以上的政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转换债券、一年期以上的央行票据、中期票据、短期融资券、债券型基金、资产支持受益凭证、期限大于7天的债券逆回购等): 0~95%</p> <p>(2) 权益类资产(国内上市的A股及权证、股票型基金、混合型基金、买入股指期货合约价值等): 0~95%</p> <p>(3) 现金类资产(现金、银行存款、一年期以内的国债、一年期以内的央行票据、一年期以内的政策性金融债、期限小于或等于7天的债券逆回购、货币市场基金等): 5~100%</p> <p>(4) 股指期货、商品期货: 0~80%(买入股指期货合约价值加卖出股指期货合约价值加上买入商品期货合约价值加卖出商品期货合约价值合计计算)</p> <p>在任一时点,本计划持有股指期货的风险敞口不得超过计划净值的80%,并保持不低于交易保证金1倍的现金或到期日在一年以内的政府债券。</p>
--	---

指期货交易的，风险敞口按照套保、套利组合中的“权益类证券市值-卖出股指期货合约价值+买入股指期货合约价值”的净额计算；

本计划在任何交易日日终在扣除股指期货合约占用的交易保证金后，应当根据资产管理合同的约定保持不低于集合资产管理计划资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。在计划开放日，该比例不低于 10%。

委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券，但其投资比例不得超过资产净值的 7%。（投资于指数基金或者完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划可以不受上述限制。）交易完成 5 个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所报告。管理人应在本计划募集成立前书面向托管人提供其关联方列表，并及时更新。

如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资

本计划以套保、套利为目的参与股指期货交易，风险敞口按以下方法计算：

对于以套保、套利为目的参与股指期货交易的，风险敞口按照套保、套利组合中的“权益类证券市值-卖出股指期货合约价值+买入股指期货合约价值”的净额计算；

本计划在任何交易日日终在扣除股指期货合约占用的交易保证金后，应当根据资产管理合同的约定保持不低于集合资产管理计划资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。在计划开放日，该比例不低于 10%。

委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券，但其投资比例不得超过资产净值的 7%。（投资于指数基金或者完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划可以不受上述限制。）交易完成 5 个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所报告。管理人应在本计划募集成立前书面向托管人提供其关联方列表，并及时更新。

如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 10

<p>比例超标，管理人应在超标发生之日起的10个交易日内将投资比例降至许可范围内（如遇相关证券不能交易的，上述时间期限自动顺延）。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>	<p>个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起的10个交易日内将投资比例降至许可范围内（如遇相关证券不能交易的，上述时间期限自动顺延）。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>
<p>第四节第（五）条“管理期限”（P8）</p>	
<p>管理期限为3年，符合条件可展期。</p>	<p>本计划无固定期限。</p>
<p>第四节第（六）条“封闭期、开放期及流动性安排”（P8）</p>	
<p>1、封闭期：本集合计划定期开放，非开放时间均为封闭期，该期间内不办理参与、退出业务。本集合计划首个封闭期为1年。</p> <p>2、开放期：首个封闭期结束后前三个工作日为首个开放期，遇节假日顺延。首个开放期结束之后，每满3个月后前三个工作日为开放日，遇节假日顺延。开放期可办理申购、赎回业务。</p> <p>3、流动性安排：为保证具有良好</p>	<p>1、封闭期：本集合计划定期开放，非开放时间均为封闭期，该期间内不办理参与、退出业务。本集合计划首个封闭期为1年。</p> <p>2、开放期：首个封闭期结束后前三个工作日为首个开放期，遇节假日顺延。首个开放期结束之后，每个月前三个工作日为开放日，遇节假日顺延。开放期可办理申购、赎回业务。</p> <p>3、流动性安排：为保证具有良好流动性，本计划在封闭期持有的现金</p>

流动性，本计划在封闭期持有的现金类资产比例均不低于 5%，开放期不低于 10%。在合同中安排了大额资金退出预约，巨额退出应对措施，以控制极端情况下的流动性风险。	类资产比例均不低于 5%，开放期不低于 10%。在合同中安排了大额资金退出预约，巨额退出应对措施，以控制极端情况下的流动性风险。
--	--

第四节第（十一）条“本集合计划的各项费用”（P9）

1、参与费：委托人参与本计划，免收参与费； 2、托管费：0.25 %年费率； 3、管理费：委托人参与本计划，免收管理费；	1、参与费：委托人参与本计划，免收参与费； 2、托管费：0.25 %年费率； 3、管理费：委托人参与本计划，免收管理费；
--	--

4、退出费：

持有期 (P)	退出费率
P<1 年	0.6%
1 年≤P<2 年	0.3%
P≥2 年	0

4、退出费：

持有期 (P)	退出费率
P<90 天	0.6%
90 天≤P<180 天	0.3%
P≥180 天	0

5、业绩报酬：

年化收益率区间	业绩报酬提取比例
小于等于 0	0
0 ~ 6% (含 6%)	10%
大于 6%	20%

5、业绩报酬：

年化收益率区间	业绩报酬提取比例
小于等于 0	0
0 ~ 6% (含 6%)	10%
大于 6%	20%

第五节第（二）条第 4 项（1）“退出费用”（P12）

<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th>持有期 (P)</th> <th>退出费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>P<1 年</td> <td>0.6%</td> </tr> <tr> <td>1 年≤P<2 年</td> <td>0.3%</td> </tr> <tr> <td>P≥2 年</td> <td>0</td> </tr> </tbody> </table>	持有期 (P)	退出费率	P<1 年	0.6%	1 年≤P<2 年	0.3%	P≥2 年	0	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th>持有期 (P)</th> <th>退出费率</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>P<90 天</td> <td>0.6%</td> </tr> <tr> <td>90 天≤P<180 天</td> <td>0.3%</td> </tr> <tr> <td>P≥180 天</td> <td>0</td> </tr> </tbody> </table>	持有期 (P)	退出费率	P<90 天	0.6%	90 天≤P<180 天	0.3%	P≥180 天	0
持有期 (P)	退出费率																
P<1 年	0.6%																
1 年≤P<2 年	0.3%																
P≥2 年	0																
持有期 (P)	退出费率																
P<90 天	0.6%																
90 天≤P<180 天	0.3%																
P≥180 天	0																

第六节 “管理人自有资金参与集合计划” (P15)

管理人是否以自有资金参与本集合计划：是

管理人以自有资金参与本集合计划的：

1、自有资金参与的条件：计划符合成立条件。

2、自有资金的参与方式和金额：计划发行结束后，管理人将以的最终发售规模为基准，按照计划总份额 20% 的比例以现金认购方式参与本计划。

3、自有资金参与的金额和比例：管理人自有资金参与计划的比例为总份额的 20%，最多不超过 1000 万元。

4、自有资金的收益分配：管理人自有资金参与份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利。

5、自有资金责任承担方式和金额：管理人自有资金参与份额承担与计划份额相对应损失的责任。

委托人在推广期认购且持有期为 1 年的份额，若持有期的年化收益率低于 4%（已扣除提取业绩报酬后），管理人将以自有资金参与本计划而持有的份额资产为限，对年化收益率低于 4% 的差额进行补偿，直至差额全部弥补或管理人持有的本计划份额补偿完毕

管理人是否以自有资金参与本集合计划：是

管理人以自有资金参与本集合计划的：

1、自有资金参与的条件：计划符合成立条件。

2、自有资金的参与方式和金额：计划发行结束后，管理人将以最终发售规模为基准，按照不超过计划总份额 20% 的比例以现金认购方式参与本计划。

3、自有资金参与的金额和比例：在本集合计划推广期，管理人自有资金参与计划的比例不超过总份额的 20%，且最多不超过 1000 万元。首次开放之后，管理人自有资金参与计划的比例不超过总份额的 20%。

4、自有资金的收益分配：管理人自有资金参与份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利。

5、自有资金责任承担方式和金额：管理人自有资金参与份额承担与计划份额相对应损失的责任。

委托人在推广期认购且持有期为 1 年的份额，若持有期的年化收益率低于 4%（已扣除提取业绩报酬后），管理人将以自有资金参与本计划而持有的

为止。

6、自有资金退出的条件：管理人承诺本计划推广期投入的承担有限收益补偿责任的自有资金参与份额 1 年内不得退出，但管理人自有资金投入取得的分红收益除外。

7、管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月，参与、退出时应当提前 3 个工作日告知委托人和托管人，募集期投入且承担责任的自有资金在约定责任解除前不得退出；

8、为应对巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，但需事后及时告知委托人和托管人；

9、因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限时的处理原则及处理措施：如因计划规模变动等客观因素导致自有资金参与计划被动超限的，管理人应在 10 个工作日内退出部分自有资金参与份额，退出时应提前 5 个工作日将超限情况和处理方法告知委托人和托管人。

10、风险揭示：管理人有限补偿本金的风险

若持有期的年化收益率低于 4%

份额资产为限，对年化收益率低于 4% 的差额进行补偿，直至差额全部弥补或管理人持有的本计划份额补偿完毕为止。本计划成立满一年后，管理人以自有资金参与本计划，不再承担补偿责任。

6、自有资金退出的条件：管理人承诺本计划推广期投入的承担有限收益补偿责任的自有资金参与份额在 1 年内不得退出，但管理人自有资金投入取得的分红收益除外。

7、管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月，参与、退出时应当提前 3 个工作日告知委托人和托管人，募集期投入且承担责任的自有资金在约定责任解除前不得退出；

8、为应对巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，但需事后及时告知委托人和托管人；

9、因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限时的处理原则及处理措施：如因计划规模变动等客观因素导致自有资金参与计划被动超限的，管理人应在 10 个工作日内退出部分自有资金参与份额，退出时应提前 5 个工作日将超限

(已扣除提取业绩报酬后), 管理人将以自有资金参与本计划而持有的份额资产为限, 对年化收益率低于 4% 的差额进行补偿, 直至差额全部弥补或管理人持有的本计划份额补偿完毕为止。此时管理人持有并用于补偿的集合计划份额资产也低于推广期管理人初始参与金额。在补偿过程中, 可能出现管理人持有的集合计划份额全部补偿完毕而委托人所持有份额净值仍未能达到份额面值的情况, 给委托人的投资本金带来风险。但委托人推广期参与并持有不为 1 年的份额以及存续期参与的份额均不能享受本金补偿的权利。

11、信息披露: 管理人实施有限收益补偿责任时, 应至少于 T-3 个工作日 (T 为有限收益补偿责任实施日) 之前将有限收益补偿责任实施方案告知委托人和托管人, 并且于有限收益补偿责任实施后的 5 个工作日内, 将该有限补偿责任条款实施情况、实际补偿额等信息向委托人进行披露。

情况和处理方法告知委托人和托管人。

10、风险揭示: 管理人有限补偿本金的风险

若投资者推广期认购且持有期为 1 年, 其持有期的年化收益率低于 4% (已扣除提取业绩报酬后), 管理人将以自有资金参与本计划而持有的份额资产为限, 对年化收益率低于 4% 的差额进行补偿, 直至差额全部弥补或管理人持有的本计划份额补偿完毕为止。此时管理人持有并用于补偿的集合计划份额资产也低于推广期管理人初始参与金额。在补偿过程中, 可能出现管理人持有的集合计划份额全部补偿完毕而委托人所持有份额净值仍未能达到份额面值的情况, 给委托人的投资本金带来风险。但委托人推广期参与并持有不为 1 年的份额以及存续期参与的份额均不能享受本金补偿的权利。本计划成立满一年后, 管理人以自有资金参与本计划, 不再承担补偿责任。

11、信息披露: 管理人实施有限收益补偿责任时, 应至少于 T-3 个工作日 (T 为有限收益补偿责任实施日) 之前将有限收益补偿责任实施方案告知委托人和托管人, 并且于有限收益补偿责任实施后的 5 个工作日内, 将

	该有限补偿责任条款实施情况、实际补偿额等信息向委托人进行披露。
--	---------------------------------