

# 华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划

## 发行公告

管理人：华安证券股份有限公司

托管人：中国民生银行股份有限公司

## 一、重要提示

1、本公司作为华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）的管理人，承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，安全保管计划资产、办理资金收付事项、监督管理人投资行为，但不保证本集合计划资产投资不受损失，不保证最低收益。

3、本公告仅对本集合计划推广的有关事项和规定予以说明。投资者如欲了解华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划的详细情况，请阅读本公司网站（[www.hazq.com](http://www.hazq.com)）的《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划说明书》、《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》及《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划风险揭示书》。

4、为保护委托人的利益，管理人郑重提示委托人：在每次参与本集合计划时，委托人应依据《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》及《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划说明书》，通过管理人网站（[www.hazq.com](http://www.hazq.com)）等方式直接向管理人进行查询确认。

5、本公司可根据推广期间的具体情况对推广事宜做适当调整。本集合计划定于 2020 年 1 月 15 日至 2020 年 2 月 14 日正式发售。投资者可通过华安证券下属网点参与本集合计划。本公司可根据推广期间的具体情况对推广事宜做适当调整。

## 二、计划概况

- 1、**计划名称：**华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划
- 2、**计划类型：**固定收益类集合资产管理计划
- 3、**管理人：**华安证券股份有限公司
- 4、**托管人：**中国民生银行股份有限公司
- 5、**推广机构：**华安证券股份有限公司
- 6、**计划募集规模：**本集合计划推广期和存续期均无规模上限。
- 7、**存续期限：**本集合计划管理期限为十年，到期后可展期。

**8、开放期：**参与开放期：集合计划成立后每周一开放参与，投资者可以在参与开放日内申请参与本集合计划，若遇节假日及非交易日，则不开放。

退出开放期：集合计划成立满 9 个月的当月的最后 2 个工作日以及之后每满 9 个月的当月 17 日和 18 日为退出开放日，投资者可以在退出开放日内申请退出本集合计划，遇节假日及非交易日顺延。如有变动，管理人可视情况调整，以管理人公告为准。投资者可根据管理人届时的公告在开放期进行参与或退出。

**9、建仓期：**本集合计划建仓期自产品成立之日起不得超过 6 个月。

**10、费率情况：**本集合计划无参与费；退出费：持有期小于 240 个自然日（不含）退出费率为 1%，持有期超过 240 个自然日（含）退出费率为 0；管理费：0.5%；托管费：0.05%。

**11、业绩报酬提取：**

(1) 管理人收取业绩报酬的原则：

(a) 按委托人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬；

(b) 在符合业绩报酬计提条件时，在计划分红日（具体以届时的分红公告为准，下同）、委托人退出日和计划终止日计提业绩报酬，提取频率不超过每 6 个月一次；

(c) 在计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；

(d) 在委托人退出和计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

(e) 在委托人退出或计划终止时，业绩报酬按委托人退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额包括一笔参与份额的一部分，则将该部分参与份额视为一笔参与份额进行核算。

(2) 封闭期间业绩报酬的计提方法：

(a) 当计划分红日、委托人退出日或计划终止日时，若持有期年化收益率  $R$  小于或等于业绩报酬计提基准，管理人不提取业绩报酬；

(b) 当计划分红日、委托人退出日或计划终止日时，若持有期年化收益率  $R$  大于 业绩报酬计提基准，管理人提取超出部分的 60%作为业绩报酬。

(c) 以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，推广期参与的为计划成立日，存续期参与的为申购参与当日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业

绩报酬的年化收益率。年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{P_1 - P_0}{P} \times \frac{365}{N} \times 100\%$$

业绩报酬计提日为计划分红日、委托人退出日或计划终止日；

R 为年化收益率

$P_1$  为业绩报酬计提日的份额累计净值；

$P_0$  为上一个发生业绩报酬计提日的份额累计净值；

P 为上一个发生业绩报酬计提日的份额净值；

N 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数。

(d) 管理人以超额比例的方式提取业绩报酬。

具体计算方法如下：

年化收益率(R)	提取比例	业绩报酬(F)
$R \leq$ 业绩报酬计提基准	0	0
$R >$ 业绩报酬计提基准	60%	$F = A \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 60\% \times N / 365$

注：①F 为委托人每笔参与应提取的业绩报酬；

②R 为年化收益率；

③A 为委托人每笔参与在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的资产净值总额。

(e) 业绩报酬的支付

提取业绩报酬时，由管理人向托管人发送业绩报酬划款指令，托管人收到指令后从本集合计划资产中以现金的方式一次性支付给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。管理人的业绩报酬由管理人负责计算，托管人不承担复核义务。

(f) 业绩报酬的计算与复核

业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。

**11、参与金额：**首次参与计划的最低金额为人民币 30 万元；对于已经是本集合计划委托人的投资者，追加参与最低金额为 1000 元人民币。

## 12、投资范围及投资比例

(1) 投资范围：

(a) 本集合计划投资于国内依法发行的国债、各类金融债（含次级债、混

合资本债)、中央银行票据、企业债券、公司债券(含非公开发行公司债)、可转债、可交换债、债券型基金、分级基金优先级、资产证券化产品、现金、债券逆回购、银行存款、同业存单、超短期融资券、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、货币市场基金及中国证监会允许本集合计划投资的其他固定收益类产品,可参与债券正回购。投资信用类债券,主体评级(或债项)必须在AA(含)以上。

(b) 本集合计划所投资资产证券化产品应满足如下要求:

本集合计划投资资产证券化产品,底层资产非产品,底层资产相对分散,现金流稳定,现金流归集路径清晰;本集合计划投资资产证券化产品,仅限于投资优先级,且投资评级为AA(含)以上的份额;本集合计划投资资产证券化产品,投资品种挂牌场所为银行间市场和交易所市场。

(c) 本集合计划可参与一级市场新股申购、可转债与可交换债转股。

(d) 投资者在此同意并授权管理人可以将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。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投资者,并向中国证监会相关派出机构、证券投资基金业协会和证券交易所报告。

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,可以将其纳入本集合计划的投资范围。法律法规或中国证监会变更集合计划原有投资品种投资比例限制的,资产管理人在履行合同变更程序后,可以相应调整本集合计划的投资比例上限规定。

(2) 投资比例:

(a) 本集合计划投资固定收益类资产比例为资产总值的80-100%,可参与债券正回购,但债券正回购金额不得超过该计划资产净值的100%,中国证监会另有规定的除外;

(b) 本集合计划投资于同一资产的资金,不超过该计划资产净值的25%;管理人管理的全部集合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;

全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于1000 万元的封闭式集合资产管理计划,以及完全按照有关指数的构

成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划，不受前款规定限制；

(c) 本集合计划投资可转债、可交换债等产品金额不超过资管计划资产净值的40%；

(d) 本集合计划参与新股申购所获配新股及可转债或可交换债因转股而持有的股票，合计不超过计划资产净值的20%；

(e) 现金类资产

本集合计划现金类资产比例为资产总值的0-100%。其中，现金类资产包括但不限于：现金、银行存款、同业存单、剩余期限在7天以内的债券逆回购、货币市场基金、期限在1年以内的国债、政策性金融债及央行票据等。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

法律法规或中国证监会允许计划投资其他品种的，资产管理人应事先取得投资者同意，在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

**13、参与价格：**推广期间单位计划参与价格为计划份额面值，即人民币 1.00 元。

**14、业绩报酬计提基准：**首个封闭期业绩报酬计提基准为产品成立时中国人民银行一年期定期存款基准利率+3.9%，封闭期内若一年期定期存款基准利率调整，业绩报酬计提基准不作变更。其后每个封闭期的业绩报酬计提基准，管理人将根据实际情况进行适当调整，届时以管理人公告为准。

### 三、推广对象

本集合资产管理计划主要投资于债券等固定收益类金融工具，风险评级为R2级，可面向C2、C3、C4和C5类投资者进行推广。

## 四、推广期

### 1、推广期参与

在推广期内，投资者在 2020 年 1 月 15 日至 2020 年 2 月 14 日可以参与本集合计划。推广期内管理人有权根据实际情况提前结束推广期并及时向投资者披露。

### 2、存续期参与

参与开放期：集合计划成立后每周一开放参与，投资者可以在参与开放日内申请参与本集合计划，若遇节假日及非交易日，则不开放。

退出开放期：集合计划成立满 9 个月的当月的最后 2 个工作日以及之后每满 9 个月的当月 17 日和 18 日为退出开放日，投资者可以在退出开放日内申请退出本集合计划，遇节假日及非交易日顺延。如有变动，管理人可视情况调整，以管理人公告为准。投资者可根据管理人届时的公告在开放期进行参与或退出。

投资者可在本集合计划的推广销售机构各营业网点参与本集合计划。投资者可登录华安证券网站（www.hazq.com）或拨打华安证券客户服务电话（95318）咨询参与事宜。办理业务的具体时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。

### 3、募集账户信息

户名：华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划募集专户

帐号：631334711000014

开户行：中国民生银行合肥政务区支行

大额行号：3053 6100 0058

## 五、本集合计划推广的当事人

### 1、管理人

机构名称：华安证券股份有限公司

法定代表人：章宏韬

通信地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

联系电话：0551-65161551

### 2、托管人

名称：中国民生银行股份有限公司  
法定代表人或负责人：洪崎  
通讯地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号  
联系电话：010-58560666

### 3、推广机构

名称：华安证券股份有限公司  
通信地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号  
网址：www.hazq.com  
服务热线：95318

## 六、本集合计划的验资与成立

管理人在本集合资产管理计划的募集金额缴足之日起十个工作日内，聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划进行验资，出具验资报告。如果本集合计划同时满足：本集合计划的参与资金总额不低于 1000 万元人民币且其委托人的人数为 2 人（含）以上，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本集合计划成立。本集合计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入本集合计划份额登记机构指定的专门账户，不得动用。本集合计划管理人依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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》及集合计划说明书可以报告计划成立。

如果本集合计划不能成立，集合计划资产管理合同终止。

华安证券股份有限公司

2020 年 1 月 10 日