

# 关于变更华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同

## 征询意见的公告

尊敬的委托人：

由华鑫证券有限责任公司（以下简称“我司”）管理的“华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划”成立于 2019 年 7 月 18 日。为给委托人提供更专业的资产管理服务，我司拟对《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXXG-2019 第 1 号）的部分条款及事项进行变更和说明，《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划说明书》、《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划风险揭示书》作为主合同的组成部分同步作变更，并按照合同约定向全体委托人征询意见。

拟将合同变更的相关事项列示如下：

### 一、主要变更事项的说明

（一）华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同（合同编号：HXXG-2019 第 2 号）

本次合同变更主要内容如下，详细修订内容详见附件 1-华鑫鑫国 1 号《管理合同》修订前后款对照表：

- 1、修改开放条款的表述，并同步修改全文相应部分表述；
- 2、修改关于投资顾问的条款，并同步更新合同其余相关部分的表述；
- 3、修改关于管理费的条款，并同步修改全文相应部分表述；
- 4、完善投资范围的表述；
- 5、完善收益分配的表述；
- 6、更新投资主办的基本信息；
- 7、其余附件内容、细节内容的修改。

更改后的资产管理合同请参见华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同（合同编号：HXXG-2019 第 2 号）。

（二）华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划说明书

《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划说明书》对相应资产管理合同同步变更。

（三）华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划风险揭示书

《华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划风险揭示书》对应资产管理合同同步变更。

### 二、本计划托管人对本次合同变更的意见

托管人宁波银行股份有限公司同意本次合同变更事宜，请参见关于华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同变更的征询函



### 三、向全体投资者征询意见及后续安排

根据《华鑫鑫国 1 号集合资产管理合同》（合同编号：HXXG-2019 第 1 号）的约定，管理人与托管人已就本次合同变更事项书面达成一致，现向全体委托人征询意见：

我司将设置临时开放期合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利，临时开放期为自本征询函公告之日起第 4 个工作日和第 5 个工作日，即 2019 年 12 月 26 日至 12 月 27 日。

投资者应在临时开放期终止前以邮件形式回复意见并发送至我司邮箱：zcg1b@cfsc.com.cn，回复意见。

投资者不同意变更的，可在临时开放期内提出退出本集合计划的申请；投资者未在临时开放期内回复意见或未在临时开放期内提出退出本集合计划申请的，视为投资者同意合同变更。如投资者同意变更，则变更事项自征询意见函（或通知）指定的日期届满的最后一工作日开始生效，对合同各方均具有法律效力。

### 四、合同变更的效力及生效时间

本征询公告构成变更后合同的组成部分，变更后的合同将于 2020 年 1 月 10 日（含）正式生效。

特此公告。



附件一：

华鑫鑫国 1 号《管理合同》修订前后条款对照表

修订前	修订后
华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同（编号：HXXG-2019 第 1 号）	华鑫鑫国 1 号集合资产管理计划资产管理合同（编号：HXXG-2019 第 2 号）
<b>第二节 释义</b>	
投资顾问：指根据本资产管理合同及其他相关协议，为本资产管理计划提供涉及投资策略、投资决策、投资指令、交易安排等方面的建议或意见的机构。本计划的投资顾问为国开证券股份有限公司。	投资顾问 指根据本资产管理合同及其他相关协议，为本资产管理计划提供涉及投资策略、投资决策、投资指令、交易安排等方面的建议或意见的机构。
<b>第四节 当事人的权利与义务</b>	
三、管理人的权利和义务 （一）管理人的权利 10、有权获得投资顾问的投资建议服务，并对其提供的投资建议有审议、修改和最终的决策权。	三、管理人的权利和义务 （一）管理人的权利 10、有权获得投资顾问的投资建议服务（如有），并对其提供的投资建议有审议、修改和最终的决策权。
<b>第五节 资产管理计划的基本情况</b>	
十、本集合计划的投资顾问 本计划将聘请【国开证券股份有限公司】作为投资顾问，对本计划的投资提供投资建议。资产管理人确认本计划所聘请的投资顾问符合《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》、《指导意见》、《管理办法》关于投资顾问资质的规定，管理人依法应当承担的责任不因聘请投资顾问而免除。	十、本集合计划的投资顾问 本计划无投资顾问。
<b>第六节 资产管理计划的募集</b>	
一、销售期、封闭期、开放期 （二）开放期和封闭期： 1、开放期 开放期可办理参与、退出业务。本集合计划原则上定期开放，本计划成立之日起 6 个月为封闭期，封闭期的到期日（T 日）以及下一个工作日（T+1 日）为首个开放参与期，办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间，遇法定节假日顺延。集合计划按规定限制或暂停退出的情况除外。具体时间由管理人公告为准，管理人有权根据实际情况将开放期顺延，但管理人应提前 1 个工作日告知委托人和托管人具体的开放时间。业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常工作日的交易时间。集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%，且管理人应当确保集合资产管理计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日内可变现资产的价值不低于本集合计划资产净值的 10%，按规定限制或暂停退出的情况除外。	一、销售期、封闭期、开放期 （二）开放期和封闭期： 1、开放期 本集合计划原则上定期开放，本计划成立之日起 6 个月为封闭期，6 个月封闭期后的自然月的 10 日、11 日为首个开放参与期，上一个产品周期的到期日（T 日）为开放日的第一日，之后每满 6 个月开放一次，开放期 2 个工作日（遇法定节假日顺延）。开放期可办理参与、退出业务，办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间，遇法定节假日顺延。具体开放期以管理人公告为准，集合计划按规定限制或暂停退出的情况除外。 管理人有权根据实际情况将开放期顺延，但管理人应提前 1 个工作日告知委托人和托管人具体的开放时间。业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常工作日的交易时间。集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%，且管理人应当确保集合资产管理计划

	<p>开放退出期内，资产组合中 7 个工作日内可变现资产的价值不低于本集合计划资产净值的 10%，按规定限制或暂停退出的情况除外。</p>
<p>五、本集合计划的各项费用 (二) 管理费率： 本集合计划的管理费率为【0.2】%/年，管理费由集合计划财产承担。</p>	<p>五、本集合计划的各项费用 (二) 管理费率： 本集合计划的管理费率为【0.6】%/年，管理费由集合计划财产承担。</p>
<p><b>第八节 资产管理计划的参与、退出与转让</b></p>	
<p>一、集合计划的参与</p> <p>本计划自成立后每满 6 个月的最后一天为该周期的到期日 T。本计划每满 6 个月开放一次，开放期为上一个产品周期的到期日 (T 日) 以及下一个工作日 (T+1 日)，办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间，遇法定节假日顺延。集合计划按规定限制或暂停退出的情况除外。</p> <p>具体开放期以管理人公告为准，在开放期内管理人可办理集合计划的参与、退出业务。本集合计划采用“预约退出”原则，委托人只有在退出预约日进行预约退出的份额才能在本周期的到期日 (T 日) 自动退出。</p>	<p>一、集合计划的参与</p> <p>本集合计划原则上定期开放，本计划成立之日起 6 个月为封闭期，6 个月封闭期后的自然月的 10 日、11 日为首个开放参与期，上一个产品周期的到期日 (T 日) 为开放日的第一日，之后每满 6 个月开放一次，开放期 2 个工作日 (遇法定节假日顺延)。开放期可办理参与、退出业务，办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间，遇法定节假日顺延。具体开放期以管理人公告为准，集合计划按规定限制或暂停退出的情况除外。</p> <p>例如，本计划的成立日为 2019 年 7 月 18 日，则 2020 年 1 月 10 日为首个封闭期的到期日，封闭期为 2019 年 7 月 18 日至 2020 年 1 月 9 日。下个封闭期的开放日为 2020 年 1 月 10 日和 2020 年 1 月 13 日，下期封闭期的到期日为 2020 年 7 月 10 日，以此类推。</p>

<p>二、集合计划的退出</p> <p>(一) 退出的办理时间</p> <p>本计划自成立后每满6个月的最后一天为该周期的到期日T。本计划每满6个月开放一次, 开放期为上一个产品周期的到期日(T日)以及下一个工作日(T+1日), 办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所正常工作日的交易时间, 遇法定节假日顺延。集合计划按规定限制或暂停退出的情况除外。</p> <p>具体开放期以管理人公告为准, 在开放期内管理人可办理集合计划的参与、退出业务。本集合计划采用“预约退出”原则, 委托人只有在退出预约日进行预约退出的份额才能在本周期的到期日(T日)自动退出</p>	<p>二、集合计划的退出</p> <p>(一) 退出的办理时间</p> <p>本集合计划采用“预约退出”原则, 委托人只有在退出预约日进行预约退出的份额才能在本周期的到期日(T日)自动退出</p>
<p>(三) 退出的程序和确认</p> <p>1、预约退出申请的提出: 退出需要在各期产品到期日前预约申请, 否则将根据管理人公告自动参与下期产品。每期产品的到期日(T日)之前第15个工作日和第14个工作日为预约退出日(即T-15日、T-14日), 对于已在退出预约日(即T-15日、T-14日)办理退出预约申请成功的份额, 将自动办理退出业务, 委托人无需在T日再次办理退出申请。如果委托人持有到期而未申请退出, 且到期时没有滚动发行相同投资期限的下期产品, 则管理人为委托人办理退出。</p> <p>2、预约退出申请的确认: 销售机构在退出预约日(即T-15日、T-14日)规定时间受理委托人申请, 管理人在退出预约日后1日内对该申请的有效性进行确认, 委托人可在退出预约日后第2日向原销售网点、原销售机构指定网络系统查询预约退出确认情况。</p>	<p>(三) 退出的程序和确认</p> <p>1、预约退出申请的提出: 退出需要在各期产品到期日前预约申请, 否则将根据管理人公告自动参与下期产品。每期产品的到期日(T日)之前第6个工作日和第5个工作日为预约退出日(即T-6日、T-5日), 对于已在退出预约日(即T-6日、T-5日)办理退出预约申请成功的份额, 将自动办理退出业务, 委托人无需在T日再次办理退出申请。如果委托人持有到期而未申请退出, 且到期时没有滚动发行相同投资期限的下期产品, 则管理人为委托人办理退出。</p> <p>2、预约退出申请的确认: 销售机构在退出预约日(即T-6日、T-5日)规定时间受理委托人申请, 管理人在退出预约日后1日内对该申请的有效性进行确认, 委托人可在退出预约日后第2日向原销售网点、原销售机构指定网络系统查询预约退出确认情况。</p>
<p><b>第十一节 资产管理计划的投资</b></p>	
<p>五、投资范围和投资组合设计</p> <p>(一) 投资范围</p> <p>固定收益类资产包括国债、央行票据、地方政府债、政策性金融债, 政府支持机构债、非政策性金融债、公司债(含非公开发行的公司债)、企业债、项目收益债、可转换债、可分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、集合票据、次级债、中小企业私募债、混合资本债、资产支持证券、资产支持票据、非公开定向债务融资工具、永续中票、同业存单、大额可转让存单(CD)、债券型证券投资基金、债券逆回购、债券质押式回购等标准化债权类资产。以上债券的主体或债项评级在AA(含)以上(短期融资券、超短期融资券除外)。</p> <p>(二) 本计划的投资比例和投资限制</p>	<p>五、投资范围和投资组合设计</p> <p>(一) 投资范围</p> <p>固定收益类资产包括国债、央行票据、地方政府债、政策性金融债, 政府支持机构债、非政策性金融债、公司债(含非公开发行的公司债)、企业债、项目收益债、可转换债、可分离交易可转债、可交换债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、集合票据、次级债、证券公司次级债、中小企业私募债、混合资本债、资产支持证券、资产支持票据、非公开定向债务融资工具、永续中票、同业存单、大额可转让存单(CD)、债券型证券投资基金、债券逆回购、债券质押式回购等标准化债权类资产。以上债券的主体或债项评级在AA(含)以上(短期融资券、超短期融资券除外), 若无债项评级, 主体评级或担保机构评级需为AA(含)以上, 且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考。</p> <p>(二) 本计划的投资比例和投资限制</p>

	<p>增加：（7）法律法规、中国证监会规定的其他投资限制。</p>
<p>七、投资决策与风险控制        （二）投资程序        （2）具体的投资实施：管理人根据本合同中关于委托财产运用范围和投资比例的规定，对投资顾问提供的投资建议进行审核，审核通过的，管理人及时执行相关操作，审核不通过的，管理人有权不执行投资顾问建议。管理人也在投顾顾问不给建议的情况下自行进行投资。</p>	<p>七、投资决策与风险控制        （二）投资程序        （2）具体的投资实施：管理人根据本合同中关于委托财产运用范围和投资比例的规定自行进行投资。</p>
<p><b>第十二节 投资顾问</b></p>	

管理人和委托人一致同意聘请【国开证券股份有限公司】为本计划的投资顾问。投资顾问应当恪尽职守，遵循诚实、信用、审慎、公平的原则，凭借自身的专业能力为本计划提供投资顾问服务。管理人应切实履行主动管理职责，依法应当承担的责任不因聘请投资顾问而免除。

投资顾问的基本信息：

名称：【国开证券股份有限公司】

法定代表人：【张宝荣】

基本信息：国开证券股份有限公司成立于 2003 年 12 月 29 日，已取得证券期货业务许可证。

投资顾问有权获取为开展投资顾问服务所必需的本计划的文件和信息资料，包括但不限于获取本合同及计划资产的盈亏、净值等数据信息。投资顾问应：

- 一、自投资顾问协议及本合同生效之日起，按照诚实信用、勤勉尽责的原则为本基金提供投资建议；
- 二、在履行投资顾问职责过程中，禁止从事内幕交易、操纵市场等违规行为；
- 三、保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有规定外，不得向他人泄露；
- 四、不得提供任何有损基金财产及其他当事人利益的投资建议；
- 五、投资建议不得违反本合同的投资限制及禁止行为；
- 六、国家有关法律法规、监管机构及本合同、投资顾问协议规定的其他义务。

具体事宜由管理人与投资顾问另行签署《投资顾问协议》进行约定。

经资产管理人、资产托管人及全体资产委托人一致同意后，管理人可对投资顾问进行更换/解聘。

当出现下列情况之一时，管理人在提前公告通知委托人后有权单方面解聘或更换投资顾问，但为本资产管理计划聘请新投顾必须符合相关法律法规和本合同的规定：

- 1) 投资顾问未经管理人同意，以管理人的名义开展包括但不限于宣传等其他任何活动。
- 2) 投资顾问向委托人承诺保底或收益率。
- 3) 投资顾问在担任其他证券资产管理类产品投资顾问时，因实施与本资产管理计划利益冲突的行为并使本计划资产委托人利益遭受损失的。
- 4) 投顾未履行投顾合同规定的义务时。
- 5) 投顾违反投顾合同的任何承诺时。

管理人确认本计划所聘请的投资顾问符合《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》、《指导意见》、《管理办法》关于投资顾问资质的规定，因聘请投资顾问导致的法律责任和合规责任均由管理人自行承担，托管人对投资顾问的资质与聘请不负有监督义务且不承担任何

本集合计划不设投资顾问。



责任。

## 第十五节 投资经理的指定与变更

### 一、投资主办的指定

#### 投资主办人简历

##### 杨镭

投资经理，中国科学技术大学概率论与数理统计学学士、中山大学岭南学院管理学硕士，具有八年证券从业经验，曾先后就职于平安人寿保险、平安证券、华鑫证券等多家金融机构，长期从事量化研究、投资等相关工作，熟悉市场上各类投资品种，擅长 CTA、股指期货等衍生品的量化建模与投资。目前负责另类投资产品的投资管理工作。

取得基金从业资格，最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。

### 一、投资主办的指定

#### 投资主办人简历

##### 杨镭

投资经理，中国科学技术大学概率论与数理统计学学士、中山大学岭南学院管理学硕士，具有八年证券从业经验，曾先后就职于平安人寿保险、平安证券、华鑫证券等多家金融机构，长期从事量化研究、投资等相关工作，熟悉市场上各类投资品种，擅长 CTA、股指期货等衍生品的量化建模与投资。目前负责另类投资产品的投资管理工作。

##### 袁馨

投资经理，南京大学金融与保险学系学士、北京大学国家发展研究院金融学硕士，具有四年证券从业经验，曾先后就职于天风证券股份有限公司、东证融汇证券资产管理有限公司(原东北证券股份有限公司上海分公



司), 历任自营交易、投资经理助理、投资主办人。

以上投资主办均取得基金从业资格, 最近三年无被监管机构重大行政监管措施、无行政处罚。

## 第二十章 集合计划的费用与税收

### 一、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### (一) 管理人的管理费

集合计划管理费按照集合计划资产净值的【0.2%】年费率计算, 计算方法如下:

$$H = E \times 0.2\% / 365$$

H 为每日应支付的管理费

E 为前一日集合计划资产净值

#### (三) 投资顾问的投资顾问费

投资顾问的投资顾问费分为固定投资顾问费及浮动投资顾问费。

##### (1) 固定投资顾问费

资产管理计划的固定投资顾问费按前一日资产管理计划资产净值的【0.1】%年费率计提, 固定投资顾问费的计算方法如下:

$$H = E \times 【0.1】\% \div 365$$

H 为每日应计提的固定投资顾问费

E 为前一日的资产管理计划资产净值

本计划成立之日起, 固定投资顾问费每日计提, 按【季】支付, 由资产管理人于本计划成立之日的【次季度】起, 【每季度】首日起【10】个工作日内与资产托管人核对投资顾问费金额。双方核对无误后, 资产管理人发送资产管理计划投资顾问费划付指令, 资产托管人根据划付指令从资产管理计划资产中支付给投资顾问, 若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延, 若遇不可抗力或计划资产无法变现致使无法按时支付的, 顺延至最近可支付日支付。

投资顾问指定收取投资顾问费的银行账户为:

户名: 国开证券股份有限公司

### 一、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

#### (一) 管理人的管理费

集合计划管理费按照集合计划资产净值的【0.6%】年费率计算, 计算方法如下:

$$H = E \times 0.6\% / 365$$

H 为每日应支付的管理费

E 为前一日集合计划资产净值

#### (三) 投资顾问的投资顾问费

本计划不收取投资顾问费。

开户行：【137101590010000063】

账号：【广发银行股份有限公司北京魏公村支行】

(2) 浮动投资顾问费

浮动投资顾问费为管理人提取的业绩报酬部分的 50%，管理人的业绩报酬详见本合同本章节的“二、业绩报酬”部分

除业绩报酬外，上述条款提及的税费应在计算计划资产净值时予以扣除，交易所或第三方金融机构调整税费征收种类或相关费率时，以上税费也随之调整，具体调整时间以管理人通知为准。

**第二十一节 资产管理计划的收益与分配**

三、收益分配原则

(四)原则上集合计划份额可在产品成立后每 6 个月进行一次收益分配，分红日为该期产品到期的最后一个工作日即到期日。

(五)对于在开放期申请退出并确认的客户，本集合计划在该期产品到期的最后一个工作日将退出份额的收益分配给客户，对于在开放期末申请退出的客户，本集合计划在该期产品到期的最后一个工作日进行份额折算，将收益折算为份额。

(六)若集合计划可分配收益大于零，则管理人将剩余全部可分配收益折算为份额，向委托人分配。但若集合计划可分配收益小于零，则管理人不对集合计划进行收益分配，在每次收益分配日，对所有计划份额，按照单位净值为 1.0000 折算等值的计划份额，从对应的参与记录中强制扣减相应数量的计划份额。

三、收益分配原则

(四)在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数由管理人决定，本计划收益分配方式为红利转投。

(五)对于在开放期申请退出并确认的客户，本集合计划在该期产品到期的最后一个工作日将退出份额的收益分配给客户，对于在开放期末申请退出的客户，本集合计划在该期产品到期的最后一个工作日进行红利转投。

(六)若集合计划可分配收益大于零，则管理人将剩余全部可分配收益进行红利转投。但若集合计划可分配收益小于零，则管理人不对集合计划进行收益分配。

## 第二十三节 风险揭示

### 一、特殊风险

#### 4、聘请投资顾问的风险

本计划由管理人参照投资顾问的“投资建议”进行投资交易，投资风险由委托人承担。投资顾问的投资服务能力、服务水平将直接影响本计划的收益水平。在本计划投资管理运作过程中，可能因投资顾问对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等因素影响本计划的收益水平。

### 一、特殊风险

#### 4、聘请投资顾问的风险(若有)

管理人参照投资顾问的“投资建议”进行投资交易，投资风险由委托人承担。投资顾问的投资服务能力、服务水平将直接影响本计划的收益水平。在本计划投资管理运作过程中，可能因投资顾问对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等因素影响本计划的收益水平。



