

华安证券恒赢 16 号集合资产管理计划风险揭示书

尊敬的投资者：

投资有风险。当您/贵机构认购或申购资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在做出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和资产管理合同，充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎做出投资决策。

根据有关法律法规，资产管理人华安证券股份有限公司及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

一、资产管理人声明与承诺

（一）资产管理人向投资者声明，中国证券投资基金业协会（以下简称“证券投资基金业协会”）为资产管理计划办理备案不构成对资产管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。

（二）资产管理人保证在投资者签署资产管理合同前已（或已委托推广机构）向投资者揭示了相关风险；已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力。

（三）资产管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用资产管理计划财产，不保证资产管理计划财产一定盈利，也不保证最低收益。

二、风险揭示

依据相关法律法规约定，在集合计划存续期间，投资者可以通过柜台交易市场等中国证监会认可的交易平台转让集合计划和份额。在办理转让业务时可能出现的风险包括但不限于：

(1) 操作系统风险

办理转让操作的系统可能因某些人为或客观原因出现故障，从而影响转让业务办理。

(2) 折溢价风险

份额可以办理转让后，份额的交易价格与其计划份额单位净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

3. 资产管理计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

本计划未在证券投资基金业协会完成备案手续或不予备案情形可能导致管理人无法按原计划建仓和投资，管理人应将投资者前期已存入托管账户中资金原路返回，在此期间暂不计息。

4. 资产管理计划投资于债券回购等投资杠杆业务所涉风险

债券回购存续期间，债券出于质押状态，正回购方无法卖出或另做他用，且在结算过程中，登记结算公司有可能依照有关业务规则或约定处置质押券，可能间接造成损失的风险以及杠杆业务带来放大投资或损失的风险。

5. 业绩报酬计提基准未能达到及可能变化的风险

本合同“业绩报酬计提基准”仅是管理人提取业绩报酬的基准，也是管理人在运作期内投资管理努力的方向和目标，业绩报酬计提基

（一）

3. 管理风险

资产管理计划运作过程中，资产管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

4. 流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

5. 信用风险

集合计划在交易过程中发生交收违约，或者集合计划所投资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，造成集合计划资产损失的风险。

6. 募集失败风险

本计划的成立需符合相关法律法规的规定，本计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。

资产管理人的责任承担方式：

- (1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；
- (2) 在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

7. 投资标的风险

或变更合同和说明书。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果投资者因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。

12. 参与股票投资的风险

本集合计划投资于国内依法发行的股票，会面临因投资标的、市场制度及交易规则等带来的特有风险。

13. 新股申购风险

新股申购风险是指获配新股上市后其二级市场交易价格下跌至申购价格以下的风险。

14. 参与定向增发股票风险

本集合计划参与定向增发后获配股票有一定的锁定期，锁定期间股票无法变现，同时锁定期间股票价格受市场因素、宏观因素等影响，股票价格有可能下跌至增发价格以下，且因股票流动受限管理人无法进行止损操作，本集合计划存在承担大幅亏损的风险。

15. 投资者风险承受能力与本集合计划风险等级不匹配的风险

投资者应按照管理人或者销售机构的要求，真实、准确、完整的提供信息、资料，包括但不限于投资者身份、财产与收入状况、证券投资经验、风险承受能力、诚信记录和投资偏好等信息，若投资者提供的信息、资料存在虚假、不完整、不准确情形或者上述信息发生变化定期更新不及时，可能导致投资者风险承受能力等级与本集合计划不匹配，最终投资者可能遭受超出其承受能力的风险。

统性的，由外部事件引发损失的风险。

(3) 不可抗力风险

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，可能导致委托资产的损失，从而带来风险。

三、投资者声明

作为本计划的投资者，本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，自愿自行承担投资该计划所面临的风险。本人/机构做出以下陈述和声明，并确认(自然人投资者在每段段尾“【_____】”内签名，机构投资者在本页、尾页盖章，加盖骑缝章)其内容的真实和正确：

1. 本人/机构已仔细阅读资产管理业务相关法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本计划运作方式及风险收益特征，愿意承担由上述风险引致的全部后果。【_____】

2. 本人/机构知晓，资产管理人、推广机构、资产托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产的收益状况作出任何承诺或担保。【_____】

3. 在购买本资产管理计划前，本人/机构已符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关合格投资者的要求并已按照管理人或代理推广机构的要求提供相关证明文件。【_____】

4. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【_____】

5. 本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同“当事人的权

13. 本人/机构知悉本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者财产损失的所有因素。【_____】

投资者（自然人签字或机构盖章）：

日期：

资产管理人（盖章）：

日期：



销售机构经办人（签字）：

日期：

