

华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划 资产管理合同变更告知函

尊敬的投资者：

根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其配套规定，华安证券股份有限公司（以下简称“本公司”）作为华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划（以下简称“安赢套利 1 号”）的管理人，经与托管人交通银行股份有限公司协商一致，本公司拟将安赢套利 1 号进行变更，并按照《华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划说明书》有关约定履行法律文件变更程序。

一、本次安赢套利 1 号进行变更的主要内容：

第一条 针对原资管合同第一章前言部分对于引用法条的修订

原条款为：

“为规范华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”或“计划”）运作，明确《华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”）当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国合同法》、《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》（以下简称《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》（以下简称《运作规定》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》等有关法律法规的规定，投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本计划相关的涉及本合同各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本合同不一致或有冲突，均以本合同为准。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容与届时有效的法律法规存在冲突，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事



人应及时对本合同进行相应变更和调整。

当事人按照《管理办法》、《运作规定》、《华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

订立本合同的目的是在严格遵守国家有关法律法规的前提下，保护本合同各当事人合法权益，明确本合同各当事人之间权利和义务，保证本集合资产管理业务合法、合规及有效地进行。

订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用和公平，充分保护本合同各当事人的合法权益。

管理人应当对集合计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。”

修改为：

“为规范华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”或“计划”）运作，明确《华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”）当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国民法典》、《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》（以下简称《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》（以下简称《运作规定》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》等有关法律法规的规定，投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，其他与本计划相关的涉及本合同各当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本合同不一致或有冲突，均以本合同为准。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容与届时有效的法律法规存在冲突，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时对本合同进行相应变更和调整。

当事人按照《管理办法》、《运作规定》、《华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

订立本合同的目的是在严格遵守国家有关法律法规的前提下，保护本合同各当事人合法权益，明确本合同各当事人之间权利和义务，保证本集合资产管理业务合法、合规及有效地进行。

订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用和公平，充分保护本合同各当事人的合法权益。

管理人应当对集合计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。”

第二条 针对原资管合同补充协议一中对原资管合同第四章第（六）条第 1、3 款的修
订

原修订为：

“1、投资目标

在严格控制风险的基础上，主要投资于固定收益类资产（包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、货币市场基金），积极把握市场投资机会，追求本集合计划的稳健收益。

3、投资比例

本集合计划投资固定收益类资产（包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、货币市场基金）比例不低于资产总值的 80%。”

现调整为：

“1、投资目标

在严格控制风险的基础上，主要投资于固定收益类资产（包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、债券型公募基金、货币市场基金），积极把握市场投资机会，追求本集合计划的稳健收益。

3、投资比例

本集合计划投资固定收益类资产（包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、债券型公募基金、货币市场基金）比例不低于资产总值的 80%。”

第三条 针对原资管合同第四章第（六）条第 2 款

原条款为：

“2、投资范围



本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、货币市场基金，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

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。

如法律法规或监管机构以后允许集合资管计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。”

修改为：

“2、投资范围

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、债券型公募基金、货币市场基金，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

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。

如法律法规或监管机构以后允许集合资管计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。”

第四条 针对原资管合同补充协议一中对原资管合同第十七章第（一）、（三）、（五）条第1款的修订

原修订为：

“（一）本资产管理计划的投资目标

在严格控制风险的基础上，主要投资于固定收益类资产（包括现金、协议存款、通知存

款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、货币市场基金)，积极把握市场投资机会，追求本集合计划的稳健收益。

(三) 投资比例

本集合计划投资固定收益类资产（包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、货币市场基金）比例不低于资产总值的 80%。

(五) 投资限制

为维护投资者的合法权益，对本计划限制以下投资行为：

1、本集合计划投资固定收益类资产（包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、货币市场基金）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。”

现调整为：

“(一) 本资产管理计划的投资目标

在严格控制风险的基础上，主要投资于固定收益类资产（包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、债券型公募基金、货币市场基金），积极把握市场投资机会，追求本集合计划的稳健收益。

(三) 投资比例

本集合计划投资固定收益类资产（包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、债券型公募基金、货币市场基金）比例不低于资产总值的 80%。

(五) 投资限制

为维护投资者的合法权益，对本计划限制以下投资行为：

1、本集合计划投资固定收益类资产（包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大

华安证券
有限公司

额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、债券型公募基金、货币市场基金) 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。”

第五条 针对原资管合同第十七章第（二）条第 1 款

原条款为：

“1、本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、货币市场基金，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。”

修改为：

“1、本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金、协议存款、通知存款、银行存款、大额存单、同业存单、债券回购、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、中央银行票据、金融债、地方政府债、次级债、中期票据、资产支持证券、资产证券化产品、债券型公募基金、货币市场基金，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。”

第六条 针对原资管合同第十七章第（五）条第 5 款

原条款为：

“5、本集合计划持有剩余期限超过 397 天的债券当日市值不得超过集合计划净值的 20%。”

修改为：

“5、本集合计划持有剩余期限超过 397 天的债券当日市值及债券型公募基金所对应的当日市值合计不得超过集合计划资产净值的 20%，其中含权债券按回售期计算剩余期限。”

相关法律文件包括：《华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划资产管理合同之补充协议一》、《华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划资产管理合同之补充协议二》、《华安证

券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划资产管理合同之补充协议三》、《华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划说明书》等，上述法律文件已同步在管理人网站披露，敬请投资者仔细阅读。

二、相关流程安排及重要提示说明

根据《华安证券安赢套利 1 号周开债券型集合资产管理计划资产管理合同》第二十八部分“合同的补充、修改与变更及其他事项”约定，本次变更内容将在管理人网站公告满 5 个工作日后生效，投资者对变更的内容有异议，可在变更内容生效前按照本合同的规定申请退出（不收取赎回费）。

管理人将经托管人同意后的合同拟变更内容在管理人网站公告，并通过书面形式（短信）进行告知，投资者应于 2022 年 6 月 24 日 11:00 前回复意见，具体安排如下：

1、2022 年 6 月 20 日至 2022 年 6 月 24 日作为此次合同变更征询期，2022 年 6 月 27 日为本集合计划开放日（不收取赎回费），投资者可以在相应期间进行申购与赎回操作，该开放期安排为本计划变更期间的临时开放期安排。

本计划后续运作开放期将继续按照自产品变更生效之日的下一周起，每两周开放一次，每次开放日为该两周的首个周一；若遇节假日及非交易日，则顺延至下一个工作日，如有变动，管理人可视情况调整，以管理人公告为准。

2、同意变更的投资者请短信“同意”至我司客服电话 95318；不同

意变更的投资者请短信“不同意”至我司客服电话 95318，并在征询期内办理本集合计划的退出事宜；若投资者短信回复不同意，但在开放日未申请退出本集合计划的，将视为同意管理人对合同做出的补充或修改。

3、在征询期内投资者既未回复短信，又未在开放期内办理其所持有的本集合计划全部份额退出手续的，视为投资者同意管理人对合同做出的补充或修改。

4、变更后的产品合同将于 2022 年 6 月 28 日生效。生效后的首个封闭运作周期业绩报酬计提基准为中国人民银行一年期定期存款基准利率+2.4%（截至 2022 年 6 月 17 日中国人民银行一年期定期存款利率为 1.5%），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。

感谢您的支持与配合！如有疑问，可拨打客服电话 95318 进行相关咨询或登陆网站 www.hazq.com 查询或了解相关内容。

特此公告。

华安证券股份有限公司

2022年6月20日

