

关于华安证券恒赢11号集合资产管理计划合同条款变更的公告

尊敬的投资者：

为持续服务广大投资者，满足广大投资者的投资需求，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作为华安证券恒赢11号集合资产管理计划的管理人，经与托管民生银行股份有限公司协商一致后，对华安证券恒赢11号集合资产管理计划进行产品变更，管理人向全体投资者进行了合同条款变更通知，且通过其网站向投资者公告本集合计划合同变更事宜，并向监管部门进行报备。

一、合同主要变更内容为：

相关法律文件包括：《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议三》、《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》、《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风险揭示书》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。

1. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议》第一点由：“订立本资产管理合同(以下简称“本合同”)的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《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》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、《集合资产管理计划管理合同内容与格式指引（试行）》、《商业银行资产托管业务指引》及其他有

关法律法规的规定。”

调整为：“订立本资产管理合同(以下简称“本合同”)的依据是《中华人民共和国民法典》(以下简称《民法典》)《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)《中华人民共和国证券法》(以下简称《证券法》)《中华人民共和国期货和衍生品法》《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》《商业银行资产托管业务指引》及其他有关法律法规的规定。”

2. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第一部分前言，第二点和第三点由：“二、管理人应当对本集合计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会(以下简称“协会”)进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

三、协会接受本计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表协会对本计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。”

调整为：“二、管理人应当按照规定向中国证券投资基金业协会(以下简称“协会”或“基金业协会”)办理资产管理计划的设立、变更备案，并及时报送资产管理计划的运行情况、风险情况以及终止清算报告等信息。

三、协会办理资产管理计划备案不代表协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险作出保证和判断，也不表明协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。投资者应当充分了解资产管理计划的投资范围、投资策略和风险收益等信息，根据自身风险承受能力审慎选择资产管理计划，自主判断投资价值，自行承担投资风险。”

3. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二部分释义，第八、九点由：“(八)《管理办法》：指中国证监会于 2018 年 10 月 22 日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(证监会令[第 151 号])。

(九)《运作规定》：指中国证监会于 2018 年 10 月 22 日发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(证监会公告[2018]31 号)。”

调整为：“（八）《管理办法》：指中国证监会于2018年10月22日公布，2023年1月12日修订的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[第203号]）。

（九）《运作规定》：指中国证监会于2018年10月22日公布，2023年1月12日修订的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2023]2号）。”

4. 《华安证券恒赢11号集合资产管理计划资产管理合同》第二部分释义，第十七点由：

“（十七）募集期：指本计划启动推广之日起至结束日的期间，自发售之日起不超过60日。”

调整为：“（十七）募集期、初始募集期：指本计划启动发售之日起至初始募集结束日的期间，自发售之日起不超过60个自然日。”

5. 《华安证券恒赢11号集合资产管理计划资产管理合同》第四部分当事人及权利义务，第六大点管理人的义务由：

“六、管理人的义务包括但不限于：

（一）依法办理本计划的销售、登记、备案事宜；

（二）按照协会要求报送本计划运行信息；

（三）按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用本计划财产；

（四）对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；

（五）制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；

（六）配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作本计划财产；

（七）建立健全的内部管理制度，保证本计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；

（八）除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作本计划财产；

（九）保守商业秘密，不得泄露本计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；

(十) 公平对待所管理的不同财产,不得从事任何有损本计划财产及其他当事人利益的活动;

(十一) 除规定情形或符合规定条件外,不得为管理人、托管人及其关联方提供融资;

(十二) 按照本合同约定接受投资者和托管人的监督;

(十三) 以管理人的名义,代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(十四) 按照本合同约定计算并向投资者报告本计划份额净值;

(十五) 确定本计划份额参与、退出价格,采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定;

(十六) 对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查,形成书面工作底稿,并制作尽职调查报告;

(十七) 按照本合同约定负责本计划会计核算并编制财务会计报告;

(十八) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计;

(十九) 按照本合同的约定确定收益分配方案,及时向投资者分配收益;

(二十) 根据法律法规与本合同约定,编制向投资者披露的本计划季度、年度等定期报告,向协会备案,并抄报证监会相关派出机构;

(二十一) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项;

(二十二) 建立并保存投资者名单;

(二十三) 组织并参加本计划财产清算小组,参与本计划财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(二十四) 按照法律法规和中国证监会的规定,保存本计划的会计账册、妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据,保存期限自本计划终止之日起不得少于 20 年;

(二十五) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会相关派出机构、协会并通知托管人和投资者;

(二十六) 按照我国有关反洗钱法律、行政法规,履行客户身份识别反洗钱义务,识别、核实资产委托人的身份及资产管理计划的受益所有人,并按监管规定保存相关身份信息、资料;在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分,对高风险的客户采取适当的风控措施;在法律允许范围内,配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作,并提供必要客户信息、资料等;履行大额交易和可疑交易报告义务,并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规,要求资产委托人积极配合完成(包括本合同签订

前和履行过程中的)反洗钱调查等必要程序;

(二十七)采取了适当的措施,确保资产管理计划的委托人、受益所有人等不得为我国公安部等有权部门发布的恐怖活动组织及恐怖活动人员名单,不得为联合国、美国、欧盟等国家和国际组织发布的反洗钱和反恐怖融资名单,或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单;

(二十八)资产管理计划的投资行为不得违法我国、联合国、美国、欧盟等国家和国际组织有关经济制裁或反洗钱法律法规规定,或用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途;

(二十九)管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务,并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息,配合托管人履行反洗钱义务;

(三十)除必要的信息披露及监管要求外,管理人不得以托管人的名义进行营销宣传;

(三十一)法律法规、监管规定和本合同约定的其他义务。”

调整为:“六、管理人的义务包括但不限于:

(一)依法办理本计划的销售、登记、备案事宜;

(二)按照协会要求报送本计划运行信息;

(三)对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估,向合格投资者非公开募集资金;

(四)制作风险揭示书,向投资者充分揭示相关风险;

(五)按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务,管理和运用本计划财产;

(六)配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作本计划财产;

(七)建立健全内部管理制度,保证本计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立,对所管理的不同资产管理计划的受托财产分别管理,分别记账,进行投资;

(八)按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督;

(九)确定本计划份额参与、退出价格,采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合相关要求以及合同的约定;

(十)按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值;

(十一)对《管理办法》第三十八条第(五)项规定的非标准化资产和相关交易主体(如有)进行充分的尽职调查,形成书面工作底稿,并制作尽职调查报告;

(十二) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告;

(十三) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计;

(十四) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案, 及时向投资者分配收益;

(十五) 编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告;

(十六) 办理与受托资产管理业务活动有关的信息披露事项;

(十七) 组织并参加资产管理计划财产清算小组, 参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(十八) 以管理人的名义, 代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;

(十九) 对于托管人违反法律、行政法规规定或者资产管理合同, 对资产管理计划财产以及其他当事人的利益造成重大损失的, 应当及时采取措施制止, 并报告中国证监会相关派出机构;

(二十) 公平对待所管理的不同财产, 不得从事任何有损资产管理计划财产以及其他当事人利益的活动; 不得向管理人以及任何第三人输送利益; 不得委托第三人运作资产管理计划财产;

(二十一) 不得利用资产管理计划, 通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式, 违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资;

(二十二) 建立并保存投资者名单;

(二十三) 保存资产管理计划的会计账册, 妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据, 保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年;

(二十四) 保守商业秘密, 不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等, 依法依规提供信息的除外;

(二十五) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时, 及时报告中国证监会相关派出机构、协会并通知托管人和投资者;

(二十六) 按照我国有关反洗钱法律、行政法规, 履行客户身份识别反洗钱义务, 识别、核实投资者的身份及资产管理计划的受益所有人, 并按监管规定保存相关身份信息、资料; 在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分, 对高风险的客户采取适当的风控措施; 在法律允许范围内, 配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作, 并提供必要客户信息、资料等; 履行大额交易和可疑交易报告义务, 并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规, 要求投资者积极配合完成 (包括本合

同签订前和履行过程中的)反洗钱调查等必要程序;

(二十七)采取适当的措施,确保资产管理计划的投资者、受益所有人等不得为我国公安部等有权部门发布的恐怖活动组织及恐怖活动人员名单,不得为联合国、美国、欧盟等国家和国际组织发布的反洗钱和反恐怖融资名单,或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单;

(二十八)资产管理计划的投资行为不得违反我国、联合国、美国、欧盟等国家和国际组织有关经济制裁或反洗钱法律法规规定,或用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途;

(二十九)管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务,并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息,配合托管人履行反洗钱义务;

(三十)除必要的信息披露及监管要求外,管理人不得以托管人的名义进行营销宣传;

(三十一)保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与本计划时使用的结算账户或其同名账户;

(三十二)法律、行政法规、中国证监会及协会规定和本合同约定的其他义务。”

6.《华安证券恒赢11号集合资产管理计划资产管理合同》第四部分当事人及权利义务,第八大点托管人的义务由:

“八、托管人的义务包括但不限于:

(一)安全保管本计划财产;

(二)除依据法律法规规定和本合同约定外,不得为托管人及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管本计划财产;

(三)对所托管的不同财产分别设置账户,确保本计划财产的完整与独立;

(四)公平对待所托管的不同财产,不得从事任何有损本计划财产及其他当事人利益的活动;

(五)按规定开设和注销本计划的托管账户及其他投资所需账户;

(六)复核本计划资产净值和份额净值;

(七)办理与本计划托管业务有关的信息披露事项;

(八)根据相关法律法规和本合同约定,复核管理人编制的本计划财产的定期报告中的财务数据,并出具书面意见;

(八) 编制私募资产管理业务托管年度报告,并向协会备案,抄报中国证监会相关派出机构;

(九) 按照法律法规要求和本合同约定,根据管理人的划款指令,及时办理清算、交割事宜;

(十) 保守商业秘密,除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外,不得向他人泄露;

(十一) 根据法律法规和中国证监会的规定保存本计划的会计账册,妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料,保存期限自本计划终止之日起不得少于 20 年;

(十二) 监督管理人的投资运作,发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的规定或托管协议附件《交易监控合规表》约定的,应当拒绝执行,立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和协会;

(十三) 投资于《管理办法》第三十七条第(五)项规定资产时,准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责,并向投资者充分揭示;

(十五) 国家有关法律法规、监管规定及本合同约定的其他义务。

托管协议与本合同、说明书约定不一致的,托管人的托管职责以托管协议的约定为准。”
调整为:“八、托管人的义务包括但不限于:

(一) 安全保管本计划财产;

(二) 按规定开立和注销本计划的托管账户及其他投资所需账户;

(三) 对所托管的不同财产分别设置账户,确保本计划财产的完整与独立;

(四) 按照资产管理合同约定,根据管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜;

(五) 复核本计划资产净值和份额净值;

(六) 向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方,以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息;

(七) 投资于《管理办法》第三十八条第(五)项规定资产时,准确、合理界定安全保管资产管理计划财产,监督管理人投资运作等职责;

(八) 监督管理人的投资运作,发现管理人的投资或者清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的,应当拒绝执行,立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构;

(九) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项;

(十) 对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具意见;

(十一) 编制托管年度报告，报送中国证监会相关派出机构；

(十二) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产以及其他当事人利益的活动；

(十四) 不得为托管人以及任何第三人输送利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；

(十五) 保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(十六) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；

(十六) 法律、行政法规、中国证监会及协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

托管协议与本合同、计划说明书约定不一致的，托管人的托管职责以本合同的约定为准。”

7. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第五部分本计划的基本情况，第一大点的第四小点和第五小点中，由：

“(四) 本计划的投资目标

在严格控制风险的基础上，主要投资于债券等固定收益类金融产品等低风险品种，把握市场投资机会，追求本集合计划的稳健收益。

(五) 本计划的投资范围

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。”

调整为：

“(四) 投资目标

在严格控制风险的基础上，主要投资于债券等固定收益类资产，把握市场投资机会，追求本集合计划的稳健收益。

(五) 投资范围

(1) 现金、银行存款、国内依法发行的国债、中央银行票据、地方政府债、各类金融债（含次级债、混合资本债等）、企业债券、公司债券（含非公开发行公司债）、可转债、可交换债、永续债、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、资产支持证券（票据）、货币市场基金、债券型公募基金、固定收益类公募银行理财及中国证监会允许本集合计划投资的其他固定收益类品种；

(2) 本计划可参与 A 股定向增发股票，可参与可转债与可交换债转股；

(3) 本集合计划可参与债券回购（包含正回购和逆回购）。

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。”

8. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第五部分本计划的基本情况，第一大点的第十五小点，由：

“（十五）其他需要订明的内容
无。”

调整为：“（十五）本集合计划的各项费用

1.认购费/参与费率:0%

2.托管费率：0.05%/年

3.管理费率：1.0%/年

4.退出费率：0%

5.业绩报酬/其他费用：参见合同“第二十部分资产管理计划的费用与税收”

（十六）其他需要订明的内容
无。”

9. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第六部分本计划的募集，第一大点本计划的募集对象中，由：“本计划向合格投资者募集，计划份额持有人累计不得超过 200 人。

合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本计划的金额不低于【30】万元且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织”

调整为：“本计划向合格投资者非公开募集，计划份额持有人不得超过 200 人。

合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本计划的金额不低于本合同约定的最低参与金额（不含参与费用）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织”

10. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第六部分本计划的募集，第三大点本计划的募集期限，由：“本计划募集期自计划份额发售之日起不超过 60 天，具体时间由管理人根据相关法律法规以及本合同确定，并在计划说明书中披露。”

调整为：“本计划的募集期限由管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定，初始募集期自资产管理计划份额发售之日起不超过 60 个自然日。管理人有权根据本计划销售的实际情况按照相关程序延长或缩短初始募集期，此类变更适用于所有募集机构。延长或缩短募集期的相关信息将及时发布通知，即视为履行完毕延长或缩短募集期的程序。”

11. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第六部分本计划的募集，第五大点本计划认购申请的确认中，由：“对未被确认的投资人，管理人应在募集期届满后 30 日内向投资者的资金结算账户中返还该等投资者已缴纳的认购金额,并加计银行同期活期存款利息。”

调整为：“当计划达到目标规模后，管理人有权暂停接受投资者的认购申请。如果当日认购申请的份额和名额加上已有的认购份额和名额已经超过目标规模或 200 人，则次日对认购申请的份额按照“时间优先，金额优先”原则进行确认，以保证集合计划份额或名额不超过目标规模或 200 人。对未被确认的投资人，管理人应在募集期届满后 30 日内向投资者的资金结算账户中返还该等投资者已缴纳的认购金额,并加计银行同期活期存款利息，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准，投资者已缴纳款项未划转至达本计划销售募集账户的除外。”

12. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第六部分本计划的募集，第六大点认购份额的计算方式由：“六、认购份额的计算方式

认购份额的计算方法如下：

认购份数=（认购金额+认购期间的利息）/资产管理计划份额初始销售面值

认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分舍去，舍去部分归入资产管理计划资产。”

调整为：“六、认购份额的计算方式

认购份额的计算方法如下：

净认购金额=认购金额-认购费用

认购份额=（净认购金额+认购期间的利息）/资产管理计划份额初始募集面值，本计划份额的初始募集面值为 1 元。

认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点后 2 位以后的部分舍去，舍去部分归入资产管理计划资产。”

13. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第六部分本计划的募集，第八大点本计划的最低认购金额和支付方式，由：

“八、本计划的最低认购金额和支付方式

认购资金应以现金形式交付。投资者初始单笔认购金额不低于 30 万元人民币（最低认购金额不包含认购费）并可追加认购，单笔最低追加金额为 1000 元（不含认购费用）。管理人可以对每个账户的认购和持有计划份额进行限制，具体限制请参见《计划说明书》或相关公告。”

调整为：“八、本计划的最低认购金额和支付方式

认购资金应以货币资金形式交付。投资者初始单笔认购金额不低于本合同约定的最低参与金额（不含认购费用）并可追加认购，单笔最低追加金额为 1000 元（不含认购费用）。管理人可以对每个账户的认购和持有计划份额进行限制，具体限制请参见计划说明书或相关公告。”

14. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第六部分本计划的募集，第九大点中，由：“认购资金在募集期间发生的利息收入按银行同业活期存款利率计算。”

调整为：“认购资金在募集期间发生的利息收入按银行同期活期存款利率计算，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准。”

15. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第六部分本计划的募集，新增第十大点：

“十、募集账户信息

本计划销售募集账户由管理人和管理人委托的销售机构自行开立，销售募集账户的开户行、账户名称、账户号码等信息以管理人或销售机构届时公告为准。管理人和管理人委托的销售机构在其网站上发布公告即视为履行了向投资者告知的义务。”

16. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第七部分本计划的成立与备案，第二大点由：“二、本计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告本计划成立。管理人应在本计划成立起 5 个工作日内报协会备案，抄报中国证监会相关派出机构。本计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。”

调整为：“二、本计划在募集金额缴足之日起 10 个工作日内，由管理人公告本计划成立。本计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。”

17. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第七部分本计划的成立与备案，第三大点本计划募集失败的处理方式，第二小点中，由：“在募集期届满后 30 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，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准。”

调整为：“在募集期届满后 30 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，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准，投资者已缴纳款项未划转至达本计划销售募集账户的除外。托管人仅依据管理人的划款指令办理有关集合计划设立失败后资金的退还有关事宜，因上述事宜产生的任何纠纷由管理人与投资者协商解决，托管人需提供必要的协助配合。”

18. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第七部分本计划的成立与备案，第四大点由：“四、本计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，符合本合同约定以现金管理为目的的投资行为除外。”

调整为：“四、管理人应在本计划成立之日起 5 个工作日内报协会备案。本计划在成立后备案完成前，可以以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。

五、资产管理计划无法完成备案的，应当及时告知投资者，并按照合同约定履行终止清算程序。”

19. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第八部分本计划的参与、退出与转让，第十五大点由：

“十五、管理人以自有资金参与本计划

（一）自有资金参与的条件

管理人以自有资金参与本计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司股东会、董事会或其他授权程序的批准。

（二）自有资金的参与方式

管理人在推广期和存续期内可以以自有资金参与本计划。

（三）自有资金参与的份额比例

自有资金参与的份额不得超过本计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本计划的份额合计不得超过计划总份额的 50%。因本计划规模变动等客观因素导致前

述比例被动超标的，管理人应当依照中国证监会规定及本合同约定及时调整达标。

（四）自有资金的收益分配

管理人自有资金所持的集合资产管理计划份额，应当与投资者所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。

（五）自有资金的责任承担

管理人以自有资金所持的本计划份额，与其他份额持有人所持的同类计划份额享有同等权益、承担同等风险。

（六）自有资金的退出

管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。自有资金参与、退出时，应提前5个工作日告知投资者和托管人。

为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人自有资金的参与、退出可不受前述比例和持有期限限制，但应及时告知投资者和托管人，并向相关证监会派出机构及协会报告。”

调整为：“十五、证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划

（一）自有资金参与的条件

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司股东大会/股东会、董事会或其他授权程序的批准。

（二）自有资金的参与方式

证券期货经营机构及其子公司在募集期和存续期内可以以自有资金参与本计划，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。

（三）自有资金参与的份额比例

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与其自身或其子公司管理的本计划的份额合计不得超过该计划总份额的50%。中国证监会对自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动预警或者超标的，证券期货经营机构及其子公司应当依照中国证监会规定及本合同约定及时调整达标。

（四）自有资金的收益分配

证券期货经营机构及其子公司自有资金所持的集合资产管理计划份额，应当与投资者所持的同类份额享有同等权益、承担同等风险。

（五）自有资金的责任承担

证券期货经营机构及其子公司以自有资金所持的本计划份额，与其他份额持有人所持的同类计划份额享有同等权益、承担同等风险。

（六）自有资金参与和退出的告知义务

托管人和投资者签署本合同即视为同意证券期货经营机构及其子公司以自有资金在募集期参与本计划。

证券期货经营机构及其子公司在存续期以自有资金参与、退出本计划，应当提前5个工作日告知全体投资者和托管人，管理人提前5个工作日在其网站发布公告即视为履行告知义务。管理人公告后，投资者不同意的，可以在开放期选择退出本计划，如投资者未在开放期选择退出本计划即视为已经充分理解并同意证券期货经营机构及其子公司的自有资金参与、退出事项，管理人无需就前述自有资金参与、退出事项再取得投资者同意；托管人不同意的应当以书面形式告知管理人，托管人未以书面形式告知管理人的即视为已经充分理解并同意证券期货经营机构及其子公司的自有资金参与、退出事项，管理人无需就前述自有资金参与、退出事项再取得托管人同意。

除前款事项外，证券期货经营机构及其子公司在募集期自有资金参与的以及存续期因本计划规模变动等因素导致自有资金被动预警或者超标需退出的，无需提前5个工作日告知全体投资者和托管人并取得其同意，但需事后及时告知。监管另有规定的，从其规定。法律法规规定应当披露的，管理人应及时、全面、客观地向投资者和托管人进行披露。

为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金的参与、退出本计划可不受前述比例和持有期限限制，但应及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。”

20. 《华安证券恒赢11号集合资产管理计划资产管理合同》第十一部分资产管理计划的投资，第二大点本资产管理计划的投资范围及比例，第一小点投资范围由：

“1、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。

2、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。

3、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。

4、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。”

调整为：“1、本集合计划投资于国内依法发行的国债、中央银行票据、地方政府债、各类金融债（含次级债、混合资本债等）、企业债券、公司债券（含非公开发行公司债）、永续债、可转债、可交换债、债券型公募基金、固定收益类公募银行理财、资产支持证券（票据）、现金、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资产。投资信用类债券，主体评级（或债项）必须在 AA（含）以上。

2、本集合计划可参与 A 股定向增发，可参与可转债与可交换债转股。

3、本集合计划可参与债券回购（包含正回购和逆回购）。

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。”

21. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十一部分资产管理计划的投资，第二大点本资产管理计划的投资范围及比例，第二小点资产配置比例由：

“(二) 资产配置比例

1、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；

2、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。

3、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%；

4、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%；

5、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。

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。

本计划成立后备案完成前，管理人可以现金管理为目的，投资于【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、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种】。”

调整为：“(二) 资产配置比例

1、本集合计划投资固定收益类资产比例为资产总值的 80-100%，总资产占净资产的比例不超过 200%，参与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；

2、本集合计划投资于同一资产的资金，不超过本计划资产净值的 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，不受前款规定的投资比例限制。

3、本集合计划投资可转债、可交换债等资产金额不超过计划资产净值的 40%；

4、本集合计划参与权益类资产不超过计划资产净值的 20%；

5、本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，该资产管理计划的总资产不得超过其净资产的 120%。本集合计划投资于国债、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不受前述规定限制；

6、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。

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。

本计划成立后备案完成前，管理人可以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种。”

22. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十一部分资产管理计划的投资，第五大点本资产管理计划的投资策略中，第一小点资产配置策略由：“管理人通过将集合计划资产主要配置于国债、金融债、公司债等固定收益类金融产品，将组合整体投资风险控制在较低水平，逐步提升组合收益水平。”

调整为：“管理人通过将集合计划资产主要配置于国债、金融债、公司债等固定收益类资产，同时辅之以权益类（如有）资产配置，将组合整体投资风险控制在较低水平，逐步提升组合收益水平。”

23. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十一部分资产管理计划的投资，第五大点本资产管理计划的投资策略中，第二小点固定收益类资产投资策略新增：

“8、回购策略

在有效控制风险情况下，通过合理质押组合中持仓的债券进行正回购，用融回的资金

做加杠杆操作，提高组合收益。为提高资金使用效率，在适当时点和相关规定的范围内进行债券回购，以增加组合收益率。”

24. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十一部分资产管理计划的投资，第五大点本资产管理计划的投资策略中，新增权益类资产投资策略和可转换、可交换债券投资策略：

“(三) 权益类资产投资策略（如有）

1、本资产管理计划主要采取自下而上的主动投资管理策略，对公司的历史沿革、财务状况、盈利能力及前景、资产及权益价值等进行全面深入的研究分析，自上而下判断公司所在行业在长周期所在的位置以评估公司的合理价值，注重安全边际，选择能为投资者持续创造价值的股票，提高选股的有效性。

2、定增标的精选投资策略

本资产管理计划的股票定量分析方法将在市场现有定增项目中，分析各行业公司的估值指标（如 PE、PB、PE/G、PS、股息率等）、成长性指标（主营业务收入增长率、净利润增长率、毛利率增长率、净利润现金保障倍数等）、现金流量指标和其他财务指标，从中筛选出价值相对低估、成长性确定、现金流状况好、盈利能力和偿债能力强的公司，作为本计划的备选定增股票池；再通过分析备选股票所代表的公司的资产收益率、资产周转率等变量的时间序列，以及通过对市场整体估值水平、行业估值水平、主要竞争对手估值水平的比较，并参考国际市场估值水平来评估其投资价值。

在定量分析的基础上，本计划的股票定性分析方法将采用深度价值挖掘和多层面多维度分析体系，从定增项目目的、定增对象结构、定增项目类别，并结合管理人的投研平台，多层次地分析备选定增项目所对应公司业务环节的竞争优势和劣势，分析定增项目对公司未来的影响，以及对所处行业与上下游产业的影响。管理人将通过调研深入了解发行人的行业背景、市场地位、产销规模、核心技术、股东和管理层情况、持续经营与盈利能力等各方面的信息，对定增价格的合理性做出判断，并结合市场情况、风险偏好和估值水平，在进行全面和深入研究基础上做出投资决定，在控制风险的基础上力求获取较高的定增投资收益。

“(四) 可转换、可交换债券投资策略

可转换、可交换债券兼具固定收益类资产和权益类资产的特性，具有抵御下行风险，

分享股票价格上涨收益的特点。本计划结合债性和股性特征，在对公司基本面和转债条款深入研究的基础上进行估值分析，投资于公司基本面优良，且有较高安全边际和良好流动性的可转换、可交换债券，获取稳健的投资回报。”

25. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十一部分资产管理计划的投资，第七大点投资限制和投资禁止，第一小点投资限制，第一点由：

“1、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”

调整为：“1、本集合计划投资固定收益类资产比例为资产总值的 80-100%，总资产占净资产的比例不超过 200%，参与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”

26. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十一部分资产管理计划的投资，第七大点投资限制和投资禁止，第一小点投资限制，第四点由：

“4、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%”

调整为：“4、本集合计划参与权益类资产不超过计划资产净值的 20%”

27. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十一部分资产管理计划的投资，第七大点投资限制和投资禁止，第一小点投资限制，第五点由：“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。”

调整为：“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二十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报告。”

28. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十一部分资产管理计划的投资，第七大点投资限制和投资禁止，第一小点投资限制，新增第六点：“本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50% 的，该资产管理计划的总资产不得超过其净资产的 120%。本集合计划投资于国债、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不受前述规定限制。”

29. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十一部分资产管理计划的投资，第七大点投资限制和投资禁止，第一小点投资限制，新增第七点：“本集合计划所投资资产支持证券（票据）应满足如下要求：

本集合计划投资资产支持证券（票据），底层资产非资产管理产品或其受（收）益权，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支持证券（票据），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支持证券（票据），投资品种挂牌场所为银行间市场和交易所市场。”

30. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十一部分资产管理计划的投资，第九大点由：“本计划存续期间，为规避特定风险，全体投资者同意，投资于对应类别资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%，如遇此种情形，资产管理人应当向在相应类别资产的比例低于计划总资产 80% 的五个工作日内向资产托管人提供书面说明文件。”

调整为：“本计划存续期间，为规避特定风险，全体投资者同意投资于对应类别资产的

比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%，如遇此种情形，资产管理人应当向在相应类别资产的比例低于计划总资产 80%的五个工作日内向资产托管人提供书面说明文件。相关特定风险包括但不限于：证券市场短期内发生急剧波动，管理人基于专业判断认为相关投资行为不利于本资产管理计划收益最大化的。”

31. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十四部分利益冲突及关联交易由：

“一、在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定并严格遵守管理人内部有关投资决策管理及关联交易管理等制度的前提下，本产品可能投资于投资者、管理人、托管人及其关联方所发行、管理、保荐、托管、销售或存在其他法律关系或利益联系的金融产品，或者与该等金融产品以公平合理的价格进行交易，但投资者或托管人各自就其自身或其关联方另有限制并书面通知管理人的除外。投资者知悉并同意本计划从事上述关联交易。

二、管理人将本计划资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循投资者利益优先原则，事后告知投资者和托管人，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。管理人以本计划资产从事重大关联交易的，还应向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。在集中交易市场交易的，由管理人参考最近成交价格确定公允价格，在非集中交易市场交易的，由管理人与交易方在不违反公平交易、不进行利益输送等合法合规原则下，协商确定交易价格。如有第三方权威机构定价的，可参考第三方权威机构的定价。

三、本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率

若管理人运用委托财产买卖管理人、托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体参与投资的符合本合同投资范围规定的投资产品，但管理人需要遵循投资者利益优先的原则、防范利益冲突，符合监管机构的规定，并履行信息披露义务。投资者签署本合同即表明其已经知晓且认可本基金可能进行上述关联交易。

计划管理人应在集合计划季度报告与年度报告中披露重大关联交易和利益冲突情形。年

度报告应于每个会计年度截止日后四个月内通过管理人网站通告。

四、管理人运用计划资产从事关联交易的，应事后及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露。管理人运用本计划从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。

五、投资者应事前就其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知管理人。若投资者未能事前就其关联方、关联证券或其他禁止交易证券明确告知管理人致使本计划财产发生违规投资行为的，管理人与托管人均不承担任何责任。”

调整为：“一、本计划存在的或者可能存在利益冲突的情形

本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：本计划可租用管理人关联方提供的证券交易单元；管理人、托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。

此外，管理人可以在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作。

二、本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率

资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人将从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，资产管理人将视具体利益冲突情形和重要程度选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处理方式、对投资者利益的影响等。

三、本计划从事关联交易的情形

（一）关联方范围和关联交易范围

管理人关联方名单以管理人年报或官网披露的最新年报为准。

托管人关联方名单及更新以托管人年报或官网披露的最新版年报为准，若因托管人关联方信息未及时披露或更新造成的后果，管理人不承担责任。管理人依据年报生成的托管人关联方清单与托管人监督口径不一致的，管理人不承担责任。

本计划关联交易包括投资于本机构、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券、本机构及其关联方管理的产品，与本机

构及其关联方开展逆回购交易或逆回购质押券发行人为本机构及其关联方的等情形。

（二）重大关联交易

重大关联交易是指管理人将资产管理计划资产投资于本机构、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券等情形。

管理人以本计划资产从事重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，按照管理人内部审批机制和评估机制逐笔进行事前审批，并事先逐笔以公告形式取得投资者同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

（三）一般关联交易

一般关联交易是指除前述重大关联交易外的关联交易。管理人以本计划资产从事一般关联交易的，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人可以以本计划资产从事一般关联交易，管理人在本计划运作过程中从事一般关联交易时，视作已事先统一取得投资者同意。

管理人以本计划资产从事一般关联交易的，应当遵循投资者利益优先原则，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益，按照管理人内部审批机制和评估机制进行事前审批，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

（四）关联交易管控机制

管理人坚持公平和诚信原则，按照市场公平合理价格执行关联交易。禁止任何利益输送、内幕交易、非公平交易等，保护投资者合法权益。管理人已建立健全私募资管业务关联交易制度，对关联交易的界定、关联交易的审批、责任划分、信息披露等进行了规范；管理人已建立健全内部审批机制和评估机制，关联交易由投资经理发起，其中一般关联交易由资产管理总部私募投资决策小组进行审批，重大关联交易由公司私募资产管理业务决策委员会进行审批。审批内容包括依据法规、内部制度、产品合同审核关联交易的合法性、合规性、定价公允性等。

利益冲突和关联交易如法律法规或监管部门另有规定的，按其规定处理，管理人通过管理人网站等方式告知投资者和托管人相关事宜，无需另行履行合同变更程序。”

32. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十九部分资产管理计划财产的估值和会计核算，第三大点估值方法，第二小点债券估值方法由：

“(二) 债券估值方法

1. 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，按估值日交易所收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

2. 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，按估值日交易所收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值；

3. 交易所上市交易的可转债、可交换债，选取每日收盘价作为估值全价进行估值；

4. 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

5. 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

6. 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照延长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。”

调整为：“(二) 债券估值方法

1、交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

2、交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值。对于含投资者回售权的固定收

益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间建议选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值净价或推荐估值净价，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照长待偿期所对应的价格进行估值。

3、交易所上市以全价交易的可转债、可交换债，选取每日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价作为估值净价进行估值，交易所上市以净价交易的可转债、可交换债，选取每日收盘价作为估值净价进行估值。

4、交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券（票据）和私募债，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值。

5、对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

6、对银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间，选取第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值净价或推荐估值净价估值，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的，按照延长待偿期所对应的价格进行估值。

7、在任何情况下，管理人如采用本项第1-6小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果管理人认为按本项第1-6小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，计划管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。”

33. 《华安证券恒赢11号集合资产管理计划资产管理合同》第十九部分资产管理计划财产的估值和会计核算，第三大点估值方法中，删去第三小点权证估值方法。

34. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十九部分资产管理计划财产的估值和会计核算，第三大点估值方法，第四小点基金估值方法由：

“(四) 基金估值方法

1. 在证券交易所挂牌交易的封闭式基金按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；封转开期间的封闭式基金按估值日基金份额净值估值。

2. 在证券交易所挂牌交易的 ETF 基金、LOF 基金场内部分按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，以最近交易日的收盘价估值。

3. 在场外交易的开放式基金（含 LOF 基金场外部分）按估值日前一交易日基金份额净值估值；估值日前一交易日没有基金份额净值的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近公告的基金份额净值估值；如果估值日前一交易日无基金份额净值，且最近交易日后经济环境发生重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日基金份额净值，确定公允价值进行估值。

4. 处于封闭期的开放式基金，按最近一个公布的基金份额净值估值；如果估值日前无基金份额净值，按成本进行估值。

5. 货币市场基金的收益以基金公布的前一日收益计提。”

调整为：“(三) 基金估值方法

1、在证券交易所挂牌交易的封闭式基金按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；封转开期间的封闭式基金按估值日基金份额净值估值，估值日基金净值未公布的，按此前最近公布的基金净值估值。

1、在证券交易所挂牌交易的 ETF 基金、LOF 基金场内部分按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，以最近交易日的收盘价估值。

2、在场外交易的开放式基金（含 LOF 基金场外部分）按估值日基金份额净值估值；估值日基金份额净值未公布的，按最近公告的基金份额净值估值。

3、处于封闭期的开放式基金，以最近公布的基金份额净值估值；如果估值日前无基金份额净值，按成本进行估值。

5、货币市场基金的收益以基金公布的前一日万份收益计提。

如遇到基金拆分、到期、转型等情况，管理人根据基金公告与托管人共同协商确定估值方法。

公开募集基础设施证券投资基金按照法律法规规定确定其公允价值。

其他资产管理产品（含固定收益类公募银行理财、私募证券投资基金、信托计划等），按最近公布的产品净值估值。”

35. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十九部分资产管理计划财产的估值和会计核算，第三大点估值方法，第五小点其他资产的估值方法由：

“（五）其他资产的估值方法

按成本估值，在投资收益到账日以实际收益入账。”

调整为：“（五）其他资产的估值方法

以合理评估能够反映公允价值的第三方定期提供的净值估值，如无能反映公允价值的第三方估值，采用估值技术确定公允价值。”

36. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第十九部分资产管理计划财产的估值和会计核算，第四大点估值对象由：

“四、估值对象

本计划财产项下所有的股票、权证、债券、基金、期货和银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。”

调整为：“四、估值对象

本计划财产项下所有的股票、债券、基金、期货和衍生品以及银行存款本息、应收款项、其他投资等资产及负债。”

37. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十二部分信息披露与报告，第一大点管理人应向投资者提供下列信息披露文件中，新增：

“前款第（二）（三）项信息披露文件，管理人披露时应当经托管人复核。

前款第（四）项、第（六）项信息披露文件，管理人应当及时报送中国证监会相关派出机构。”

38. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十二部分信息披露与报告，第三大点临时报告中，新增：

“临时报告的情形包括但不限于：

1、集合计划运作过程中，投资经理变更或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

2、暂停受理或者重新开放受理参与或者退出申请；

3、发生巨额退出并延期支付；

4、集合计划终止和清算；

5、集合计划存续期满并展期；

6、合同的补充、修改和变更；

7、证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与和退出；

8、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

9、负责本计划的推广机构发生变更；

10、集合计划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；

11、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资管；

12、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

13、集合计划分红；

14、其他管理人认为的重大事项。”

39. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十二部分信息披露与报告，第六大点由：

“六、管理人、托管人向监管机构的报告

管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募资产管理业务管理年度报告和私募资产管理业务托管年度报告，并报中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会备案。”

调整为：“六、管理人、托管人向监管机构报告的种类、内容、时间等相关事项

1、管理人应当于每月十日前向相关监管机构报送本计划的持续募集情况、投资运作情况、资产最终投向等信息。

2、管理人应当在每季度结束之日起一个月内，编制私募资产管理业务管理季度报告，并报送相关监管机构。管理人、托管人应当在每年度结束之日起四个月内，分别编制私募资产管理业务管理年度报告和托管年度报告，并报送相关监管机构。

3、资产管理计划成立之日起五个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额或者资产缴付证明等材料报协会备案；自资产管理合同变更之日或资产管理计划终止之日起五个工作日内报协会备案，资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算报告报协会备案。资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，及时向中国证监会相关派出机构报告。

4、出现以下情形时，管理人应及时向中国证监会相关派出机构和协会报告：

（1）为应对集合资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划突破关于以自有资金投资集合计划的限制规定。

（2）公司董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本公司设立的资产管理计划。

（3）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证券期货经营机构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二十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，及时向中国证监会相关派出机构报告。

（4）从事关联交易。

（5）出现重大风险事件。

5、托管人监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者资产管理合同约定的，应当拒绝执行，并向中国证监会相关派出机构报告。

6、其他需要向监管机构报告的事项，管理人、托管人将根据《指导意见》《管理办法》《运作规定》及其他法律法规、监管规定及要求及时进行报告。

7、中国证监会及相关派出机构、协会对管理人、托管人上述向其备案和报告事项要求有调整的，按中国证监会及相关派出机构、协会最新要求执行。”

40. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十三部分风险揭示，第一大点，第一项特殊风险揭示由：

“（一）特殊风险揭示

若存在以下事项，应特别揭示风险：

1. 资产管理计划委托募集所涉风险

本计划管理人可委托销售机构销售本计划，受托销售机构销售本计划时，可能存在包括但不限于如下违法违规行为而令投资者面临计划募集风险：

（1）销售机构采用公开宣传或变相公开宣传的方式销售本资产管理计划。

（2）销售机构进行虚假宣传，或通过任何方式以保本保收益误导投资者，或推介材料存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

（3）销售机构违反《私募办法》的有关规定，未审查投资者是否满足合格投资者相关条件，未对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行鉴别，未履行投资者适当性审查义务。

（4）销售机构可能因未在中国证监会注册取得资产管理计划销售业务资格或未成为中国基金业协会会员而不具备受托募集资产管理计划的资格。

（5）销售机构从业人员可能未经正式授权即从事资产管理计划募集活动。

（6）销售机构可能存在将资产管理计划募集结算资金归入其自有财产、挪用资产管理计划募集结算资金、侵占计划财产和客户资金等违法活动。

2. 资产管理计划份额转让所涉风险

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, 业绩报酬计提基准不是预期收益和保证收益率, 不构成管理人对委托财产的任何承诺或担保, 投资者仍可能面临实际收益率达不到业绩报酬计提基准甚至本金受损的风险。同时业绩报酬计提基准由管理人根据投资策略和资产组合及市场变化趋势等确定, 可能发生变化, 最终以管理人披露为准。”

调整为: “一、资产管理计划投资将可能面临下列各项风险, 包括但不限于:

(一) 特殊风险揭示

若存在以下事项, 应特别揭示风险:

1、资产管理合同与中国证券投资基金业协会合同指引不一致所涉风险

本计划合同条款不可避免的和 2023 年 12 月 15 日中国证券投资基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》不完全相同, 更为复杂、更为具体, 因此带来的风险由本计划财产和投资者承担。

2、资产管理计划委托募集所涉风险

本计划管理人可委托销售机构销售本计划, 受托销售机构销售本计划时, 可能存在包括但不限于如下违法违规行为而令投资者面临计划募集风险:

(1) 销售机构采用公开宣传或变相公开宣传的方式销售本资产管理计划。

(2) 销售机构进行虚假宣传, 或通过任何方式以保本保收益误导投资者, 或推介材料存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

(3) 销售机构违反《管理办法》和《运作规定》的有关规定，未审查投资者是否满足合格投资者相关条件，未对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行鉴别，未履行投资者适当性审查义务。

(4) 销售机构对于本计划风险收益特征的评估与表述可以和管理人不同，可能存在本计划资产管理合同、风险揭示书或计划说明书中的风险收益特征表述与销售机构对本计划风险评级结果不一致的风险。投资者在投资本计划前，必须按照销售机构的标准和要求完成其对于投资者于本计划的客户适当性匹配检验及其他适当性义务。

(5) 销售机构可能因未在中国证监会注册取得资产管理计划销售业务资格或未成为中国证券投资基金业协会会员而不具备受托募集资产管理计划的资格。

(6) 销售机构从业人员可能未经正式授权即从事资产管理计划募集活动。

(7) 销售机构可能存在将资产管理计划募集结算资金归入其自有财产、挪用资产管理计划募集结算资金、侵占计划财产和客户资金等违法活动。

3、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，利息金额以本计划注册登记机构的记录为准，投资者已缴纳款项未划转至达本计划销售募集账户的除外。

4、资产管理计划未在中国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

本计划未在中国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。

5、资产管理计划份额转让所涉风险

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。

6、本计划未设置份额持有人大会，不存在所涉风险。

7、本计划未聘请外包服务机构，不存在所涉风险。

8、投资股权类资产所涉风险（如有）

本计划投资标的的价值取决于投资对象的经营状况，原股东对所投资企业的管理和运营，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化以及区域市场竞争格局的变化等都可能影响所投资企业经营状况，进而影响资产管理计划投资标的的价值。

（1）参与股票投资的风险（如有）

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。

（2）新股申购风险（如有）

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。

（3）投资流通受限股票的风险（如有）

本集合计划投资范围包括定向增发（如有），定向增发后获配股票有一定的锁定期，锁定期股票无法变现，同时锁定期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，且因股票流通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。

（4）科创板投资风险（如有）

科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性，由此带来股价波动的投资风险。

（5）参与新三板的投资风险（如有）

挂牌公司的状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利能力发生变化，从而导致本集合计划投资收益波动的风险。

9、从事重大关联交易、一般关联交易的风险

管理人可能运用本计划从事重大关联交易，相关投资存在一定风险，提请投资者知悉、

充分关注。投资者可能面临本计划关联方名单获取、界定、识别不准确、不完整、不及时导致管理人无法及时准确识别相关重大关联交易以至于本计划从事前述重大关联交易未事先征询投资者意见以及其他可能的相关风险，以及投资者认知的本计划关联方、一般和重大关联交易的区分标准和管理人采用的名单和标准不完全一致的风险。

管理人以本计划资产从事一般关联交易的，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人可以以本计划资产从事一般关联交易，投资者无法事前知悉每一笔一般关联交易的风险。

10、债券回购风险

债券回购为提升整体组合收益提供了可能，但也存在一定的风险。债券回购的主要风险包括信用风险、投资风险及杠杆的风险。其中，信用风险指回购交易中交易对手在回购到期时，不能偿还全部或部分证券或价款，造成净值损失的风险；投资风险是指在进行回购操作时，回购利率大于债券投资收益而导致的风险以及由于回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大的风险；而杠杆的风险是指在进行回购操作时，在对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性（标准差）进行了放大，即组合的风险将会加大。回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对净值造成损失的可能性也就越大。

11、本计划提前终止的风险

若发生本计划约定的提前终止情形，管理人有权在履行合同约定的信息披露义务后进行本计划的提前终止。由此将可能导致投资者无法按照设想妥善安排其投资计划，或无法按照本合同约定的时间收回其持有份额所对应的资产管理计划财产以及收回金额不及预期等风险。”

41. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十三部分风险揭示，第一大点，第二项一般风险揭示，第二小点市场风险，由：

“2. 市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、衍生品风险等。”

调整为：“2、市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种

因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：

(1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

(2) 经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

(3) 利率风险

金融市场利率波动会导致资产价格和资产利息的损益，同时直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划的收益水平产品随之发生变化，从而产生风险。

(4) 购买力风险

投资者的利润主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

(5) 再投资风险

由于金融市场利率下降造成的无法通过再投资而实现收益的风险。

(6) 上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

(7) 衍生品风险

金融衍生品具有杠杠效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失。”

42. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十三部分风险揭示，第一大点，第二项一般风险揭示，删去第六小点和第七小点：

“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. 投资标的的风险

本计划投资标的的价值取决于投资对象的经营状况，原股东对所投资企业的管理和运营，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化以及区域市场竞争格局的变化等都可能影响所投资企业经营状况，进而影响资产管理计划投资标的的价值。”

43. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十三部分风险揭示，第一大点，第二项一般风险揭示，新增：

“9、投资者参与、退出集合计划风险

(1) 本计划投资者人数上限为 200 人。本计划投资者达到一定人数时，管理人有权停止认/申购。投资者可能面临因上述原因而无法参与本计划的风险。

(2) 当管理人发现投资者申请部分退出本计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划份额所对应的资产净值低于本合同约定的最低参与金额（不含参与费用）的，管理人可能采取强制赎回或赎回部分确认失败导致客户退出金额与申请份额对应的资金不一致所涉及的风险。

10、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现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。

11、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，业绩报酬计提基准不是预期收益和保证收益率，不构成管理人对受托财产的任何承诺或担保，投资者仍可能面临实际收益达不到业绩报酬计提基准甚至本金受损的风险。同时业绩报酬计提基准由管理人根据投资策略和资产组合及市场

变化趋势等确定，可能发生变化，最终以管理人披露为准。

12、净值披露信息与投资者实际收益不一致的风险

管理人按照合同约定对本计划投资的资产进行估值，可能因费用计提、业绩报酬计提、底层资产的管理人/受托人（如有）提供的资产价值不准确或未及时更新等因素，致使本计划披露的净值可能与投资者实际收益不一致。投资者的实际收益以管理人最终分配的实际收益为准。

13、反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》《金融机构反洗钱规定》《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》《金融机构客户尽职调查和客户身份资料及交易记录保存管理办法》《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息，投资者无权知悉，投资者签署本合同，则视为知悉并同意前述安排。

14、交易所资金前端控制带来的风险

本资产管理计划由管理人作为交易参与人通过交易单元在上海和深圳证券交易所进行证券交易。根据《证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，证券交易所、证券登记机构对交易参与人相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过交易所对交易参与人实施前端控制。可能存在如下风险：

（1）管理人操作失误，合计资产总额发生变动导致最高额度未能及时变更等，存在影响产品正常交易、无法有效进行风险控制等风险。

（2）因不可抗力、意外事件、技术故障或者重大差错等原因导致资金前端控制出现异常，中国结算及沪、深交易所采取最高额度调整、暂停资金前端控制、限制交易单元接入等处置措施，产生业务风险。

本资产管理计划可能因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易，由此造成的损益由计划财产承担。

15、使用电子签名合同的风险

本计划可以采用电子签名方式签署，可能存在因网络中断或不运作、传送安全系统失灵、系统遭受非法攻击等多种因素造成数据的损坏或丢失。电子签名合同签订后，投资者凭密码进行交易，投资者通过密码登录后所有操作均将视同本人行为，如投资者设置密码泄露，可能导致他人在未经授权的情况下操作份额持有人指定资金账户，给投资者造成潜

在损失。

16、合同变更和合同展期风险

管理人就合同变更和合同展期征求投资者意见期间，未明确提出异议的投资者、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的投资者均视为同意修改或变更合同、合同展期和计划说明书。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和合同展期，从而存在风险。

17、管理人以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司带来的风险（如有）

本计划存续期间，管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司，并将资产管理合同中管理人享有的权利和承担的义务一并转让给上述从事资产管理业务的公司（即受让方），由此产生的风险。”

44. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十三部分风险揭示，第一大点，第二项一般风险揭示，其他风险部分的第一小点由：

“包括但不限于关联交易风险、技术风险和操作风险、发生不可抗力事件的风险等。

（1）关联交易的风险

管理人将本计划资产投资于管理人、托管人及于管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他管理人发行的证券或者承销期内承销的证券，事后管理人将及时以公告的方式向托管人和投资者披露，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。”

调整为：“包括但不限于证券期货经营机构自有资金参与和退出的风险、技术风险和操作风险、发生不可抗力事件的风险等。

（1）证券期货经营机构自有资金参与和退出的风险

投资者签署本合同即视为同意证券期货经营机构及其子公司以自有资金在募集期参与本计划。证券期货经营机构及其子公司在存续期以自有资金参与、退出本计划，应当提前 5 个工作日告知全体投资者和托管人，管理人提前 5 个工作日在其网站发布公告即视为履行

了告知义务。证券期货经营机构及其子公司在募集期自有资金参与的以及存续期因本计划规模变动等因素导致自有资金参与比例被动预警或者超标需退出的，无需事前公告。

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出事项公告后，如投资者未在开放期选择退出本计划即视为已经充分理解并同意管理人已公告的自有资金参与、退出事项。证券期货经营机构及其子公司自有资金参与和退出行为可能使本计划面临再投资风险或流动性风险，从而影响计划损益，管理人将认真履行相关职责，关注计划规模变动情况。”

45. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十四部分资产管理合同的变更、终止与财产清算，第一大点资产管理合同的变更，由：

“一、资产管理合同的变更

（一）因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同，并由管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。

（二）因其他原因需要变更资产管理合同的，经全体投资者、管理人和托管人协商一致后，可对本合同内容进行变更，但本合同约定资产管理人有权与资产托管人协商一致后变更合同内容的情形除外，包括：

1. 投资经理的变更。
2. 资产管理计划认购或参与、非交易过户的原则、时间、业务规则等变更。
3. 对资产管理合同的变更不涉及合同当事人权利义务关系发生重大变化，且对投资者利益无实质性不利影响。

本计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意。

（三）管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出本计划的权利。

合同变更后管理人可以采取临时开放等方式合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利”

调整为：“一、资产管理合同的变更

（一）一般情形下的合同变更，管理人和托管人应事先书面达成一致，经托管人同意后的合同拟变更内容应当及时在管理人网站公告，公告内容应包含但不限于以下内容：合同变更的内容、不同意变更的投资者的退出安排。管理人须在公告后 5 个工作日内通过管理人网站或其他适当方式向投资者发送合同变更征询意见。投资者不同意变更的，应在公告发布之日起至公告规定的退出申请截止日前，按公告规定的方式提出退出本集合计划

的申请，投资者未在规定时间内提出退出申请的，视为同意合同变更。对于合同变更期间本计划产品风险等级发生变化且投资者风险承受能力不再匹配产品风险等级的，管理人有权做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划份额净值）。但本合同约定资产管理人有权与资产托管人协商一致后变更合同内容的情形除外，包括：

1. 投资经理的变更。
2. 资产管理计划认购或参与、退出，份额转让，非交易过户的原则、时间、业务规则等变更。
3. 调低资产管理计划相关费用或比例。
4. 对资产管理合同的变更不涉及合同当事人权利义务关系发生重大变化，且对投资者利益无实质性不利影响。

本计划改变投资范围和投资比例的，应当事先取得投资者同意。

本计划变更生效后，投资者有权在本计划任意开放日按本合同的约定申请退出。

（二）因监管规则变化，需要变更资产管理合同的，管理人可以与托管人协商后更新或修改资产管理合同，更新或修改的内容在管理人网站公告满1个工作日后生效。

（三）管理人应当保障投资者选择退出资产管理计划的权利，公平、合理安排相关后续事项，具体以管理人公告为准。

（四）本计划需要变更管理人或者托管人的，不包含本款第（五）项的情形，参照本款第（一）项履行合同变更程序。

（五）因发生下列事项需要变更合同的：

1、管理人因被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等原因不能履行管理人职责，资产管理计划由其他管理人承接；

2、托管人因被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产等原因不能履行托管人职责，资产管理计划由其他托管人承接。

投资者在此同意，如果上述事件发生，在管理人/托管人和受让人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和管理人承担的义务转让给其他从事资产管理业务的公司、将本合同中由托管人享有的权利和托管人承担的义务转让给其他从事托管业务的公司，并均无须就此项变更与投资者另行签署专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告投资者，管理人保障投资者退出本计划的权利，并在相关通告中对退出事项做出合理安排。”

46. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十四部分资产管理合同的变更、终止与财产清算，第二大点由：“二、本合同发生变更的，管理人应按照基金业协会要求及时向基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。”

调整为：“二、本合同发生变更的，管理人应当自资产管理合同变更之日起 5 个工作日内报协会备案。”

47. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十四部分资产管理合同的变更、终止与财产清算，第三大点资产管理计划的展期中，由：

“三、资产管理计划的展期

(一) 资产管理计划展期应符合以下条件：

1. 本计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定；

2. 本计划展期没有损害投资者利益的情形；

3. 中国证监会规定的其他条件；

(二) 本计划展期的，应当符合本计划的成立条件。

(三) 展期的安排

1. 通知展期的时间

存续期届满前 3 个月且不超过 1 个月。

2. 通知展期的方式

管理人将通过短信、电子邮件或信函方式向投资者发送展期征询意见。

3. 投资者回复的方式

投资者应当在管理人网站公告之日起 10 个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确回复意见。在征询意见发出后的 10 个工作日内提出退出本计划的申请；投资者未在前述时间回复意见的，视为投资者同意展期。

4. 投资者不同意展期的处理办法

若投资者明确回复不同意展期，投资者有权按照管理人公告内容在存续期届满日前（含

届满日)到推广机构办理退出手续或按本合同规定办理集合计划份额转让手续;若投资者未在存续期届满日前(含届满日)到推广机构办理本计划份额退出、转让手续,则由管理人决定对上述份额于存续期届满之日做自动退出处理。若投资者未回复意见或回复意见不明确的,并未在上述期限内办理转让或退出手续,视为不同意展期,管理人不再另行通知确认。

5. 展期的实现

如果同意计划展期的投资者人数不少于2人,展期的投资者持有份额规模不少于1000万元,则本计划存续期将依法展期;如果同意计划展期的各投资者人数低于2人,或展期的投资者持有份额规模不少于1000万元,则本计划到期终止,管理人将按照本合同约定办理计划到期终止和清算事宜。”

调整为:“三、资产管理计划的展期

本计划可以展期。

(一)资产管理计划展期应符合以下条件:

1、本计划运作规范,管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定;

2、本计划展期没有损害投资者利益的情形;

3、符合资产管理计划的成立条件;

4、中国证监会规定的其他条件。

(二)展期的安排

1、通知展期的时间

本集合计划原存续期届满前,管理人可以决定到期清算终止或展期继续管理本集合计划。本集合计划拟展期的,管理人应当在计划存续期届满前1个月征询托管人是否同意继续托管展期后的集合计划资产。在获得托管人同意后,管理人可开展本集合计划展期准备事宜,通过公告等形式通知投资者展期安排,并按照合同变更的一般情形进行展期。

2、展期的期限

管理人可以决定展期的期限,并以公告形式通知投资者,具体期限以管理人公告为准。

3、投资者回复的方式

投资者如同意参与集合计划展期,应在公告规定期限内按照管理人公告规定的形式作出答复;未在规定时间内作出答复的,视为同意本集合计划展期。

4、投资者不同意展期的处理办法

若投资者明确回复不同意展期,投资者有权按照管理人公告内容在存续期届满日前(含

届满日)到推广机构办理退出手续或按本合同规定办理集合计划份额转让手续;若投资者未在存续期届满日前(含届满日)到推广机构办理本计划份额退出、转让手续,则由管理人决定对上述份额于存续期届满之日做自动退出处理。若投资者未回复意见或回复意见不明确的,并未在上述期限内办理转让或退出手续,视为同意展期,管理人不再另行通知确认。

5、展期的实现

如果同意计划展期的投资者人数不少于2人,展期的投资者持有份额规模不少于1000万元,则本计划存续期将依法展期;如果同意计划展期的各投资者人数低于2人,或展期的投资者持有份额规模少于1000万元,则本计划到期终止,管理人将按照本合同约定办理计划到期终止和清算事宜。”

48. 《华安证券恒赢11号集合资产管理计划资产管理合同》第二十七部分资产管理合同的效力,由:“一、本合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人的,本合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人/主要负责人或委托代理人签字或盖章之日起成立;投资者为自然人的,合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人/主要负责人或委托代理人签字或盖章之日起成立(如采用电子方式签署合同的,应该满足相关电子合同签约成立的条件)。本合同自本计划成立之日起生效。

二、本合同自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

三、本合同的有效期限为【十】年。

四、投资者自签订本合同即成为本合同的当事人。在本计划存续期间,投资者自全部退出计划之日起不再是本合同的当事人。”

调整为:“一、本合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。

二、本合同可采用电子签名方式或书面方式进行签署,合同自三方签署后成立。以电子签名方式签署本合同的,投资者、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定。三方一致同意投资者自签署电子签名约定书之日起,投资者以电子签名方式接受电子签名合同、计划说明书、风险揭示书或其他文书的,视为签署本合同、计划说明书、风险揭示书或其他文书,与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力,无须另行签署

纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。

三、本合同采用书面签署方式时，投资者为法人的，本合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立（如采用电子方式签署合同的，应该满足相关电子合同签约成立的条件）。

四、本合同自本计划成立之日起生效。

五、本合同的有效期限为自合同生效之日起至本合同项下权利义务履行完毕为止。

六、投资者自签订本合同即成为本合同的当事人。在本计划存续期间，投资者自全部退出计划之日起不再是本合同的当事人。再次参与不用另行签署本合同（期间合同发生变更的除外），参与申请被管理人确认后，即视为投资者重新成为本合同的当事人，本合同对投资者具有法律约束力。”

49. 《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十八部分其他事项，新增第五、六大点：“五、计划说明书、风险揭示书、经注册登记机构确认有效的投资者认购、参与、退出本计划的申请材料或数据电文和投资者通过电子签名方式产生的数据电文、管理人通过其公司网站发布的销售公告及其他公告等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。计划说明书如与本合同有不一致的，以本合同为准。

六、本合同未尽事宜，当事人依据有关法律法规和集合计划说明书的规定办理。如集合资产管理合同、说明书及托管协议中的约定存在冲突的，相关约定以集合资产管理合同的约定为准。如本合同约定与法律法规有任何冲突之处，冲突之处按法律法规规定执行。”

二、相关流程安排及重要提示说明

根据《华安证券恒赢 11 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十四条“资产管理合同的变更、终止与财产清算”约定，本次变更内容将在管理人网站公告满 5 个工作日后的规定生效日生效，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，并通过管理人或销售机构指定的形式进行告知，投资者应于**2024年5月16日11:00**前回复意见，具体安排如下：

1、2024年5月10日至2024年5月16日作为此次合同变更征询期，**2024年5月17日、2024年5月20日**为本集合计划开放期（不收取赎回费）。

本集合计划后续开放期安排将继续按照：集合计划成立后每满**12**个月当月的**17、18**日为后续开放期，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。

2、同意变更的投资者请短信回复“同意”至我司客服电话**95318**，或以管理人或销售机构指定的形式回复；不同意变更的投资者请短信回复“不同意”至我司客服电话**95318**，或以管理人或销售机构指定的形式回复，并在开放期内办理本集合计划的退出事宜；若投资者回复“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，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、在本次开放期间参与集合计划的投资者，应当详阅且知悉相关补充协议、告知函、公告等文件内容，并签署《资产管理合同》及



其补充协议、《风险揭示书》，签署完成以上文件即为同意本次合同变更的相应条款。

5、针对出现不同意变更事项且又不同意退出的情况，管理人有权发布公告额外安排一次临时开放期。

6、变更后的产品合同将于 2024 年 5 月 21 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+2.1%(截至 2023 年 9 月 1 日中国人民银行一年期定期存款利率为 1.50%)，运作期间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。其后每个运作期间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。

