

华泰证券（上海）资产管理有限公司关于私募资产管理计划 关联交易及自有资金相关事项的公告

中国证监会 2023 年 1 月 12 日发布了修订后的《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]，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》（证监会公告[2023]2 号，以下简称《运作管理规定》），并于 2023 年 3 月 1 日生效。上述《管理办法》《运作管理规定》中对于私募资产管理计划关联交易及自有资金投资的相关规则进行一定调整。鉴于此，按照《管理办法》《运作管理规定》最新要求，华泰证券（上海）资产管理有限公司（以下简称“本公司”或“管理人”）现将旗下成立于 2023 年 3 月 1 日前并持续运作的私募资产管理计划（包括集合资产管理计划、单一资产管理计划，不包括资产支持专项计划）关于关联交易、自有资金的有关事项明确如下：

一、关联交易

（一）关联方范围

本公司承诺依照法律、法规及内部制度对产品开展的关联交易进行管理和控制。结合法律法规、监管规定及公司内部制度，对本公司所管理的私募资产管理计划“关联方”的范围明确为：

1. 本公司；
2. 本公司的股东；
3. 本公司的股东控制、与他人共同控制或施加重大影响的法人或其他组织；
4. 本公司的股东及其控制企业的重要上下游企业；
5. 与本公司的股东有其他重大利害关系的公司；
6. 本公司控制、与他人共同控制或施加重大影响的法人或其他组织；
7. 本公司或公司股东的董事、监事、高级管理人员及其直接或者间接控制的企业；
8. 该私募资产管理计划自身的托管机构；
9. 该私募资产管理计划托管机构的控股股东、实际控制人；

10. 与该私募资产管理计划托管机构有其他重大利害关系的公司；

11. 该私募资产管理计划自身的投资顾问；

12. 该私募资产管理计划投资顾问的控股股东、实际控制人；

13. 与该私募资产管理计划投资顾问有其他重大利害关系的公司。

14. 本公司所管理的其他金融产品（包括本公司管理的公募证券投资基金、其他集合资产管理计划和单一资产管理计划）、本公司所管理的资产支持专项计划。

如相关法律法规、基金业协会自律规则或管理人公司制度对上述关联方范围进行调整的，按照调整后的关联方范围执行。

（二）一般关联交易、重大关联交易的区分标准

重大关联交易包括：

1、私募资管计划与同一关联方之间进行的、标的额达到或超过管理人最近一期经审计净资产值 5%且超过 3000 万元的关联交易；

2、相关法律法规、基金业协会自律规则、管理人公司制度规定为重大关联交易的其他情形。

除重大关联交易外，其余关联交易为一般关联交易。

（三）本公司对关联方交易的内部管控机制

按照市场通行的方式和条件进行关联交易，遵循公平公正、诚实守信原则，审慎尽责，坚持公平交易，避免利益冲突，禁止利益输送，保护投资者合法权益，本公司已建立关联交易管理机制，对关联认定、关联交易定价、关联交易审批程序等进行了规范。本公司依据产品合同约定及关联交易相关制度对关联交易的合法合规性以及公允性进行审核，并履行对关联方交易的通知审批、披露、报告等程序。

（四）关联方交易的特别风险提示

管理人遵循投资者利益优先和审慎经营原则，根据资产管理合同的约定，在实际投资操作中可能会投资于管理人、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承销期内承销的证券、前述机构管理的公募证券投资基金、私募资管产品以及从事其他类型的关联交易，尽管管理人遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作，防范利益冲突，但该等交

易仍构成关联交易，存在利益冲突风险，可能影响投资者的利益。管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响受托财产的投资收益。此外，根据资产管理合同的约定，管理人以本计划资产从事一般关联交易的，无需就具体关联交易再行分别、逐笔取得投资者的同意，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事该等关联交易，管理人仅需要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，故存在投资者在一般关联交易完成前未充分知晓具体交易情况的风险（如资产管理合同约定从事一般关联交易需分别、逐笔取得投资者同意的除外）。投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。

二、集合计划的自有资金参与及退出

（一）自有资金参与的金额和比例

在集合计划存续期内，管理人、管理人控股股东及其子公司（孙公司）的自有资金参与集合计划的份额合计不得超过集合计划总份额的 50%。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过前述比例的，管理人将在具备退出集合计划条件时将自有资金比例降至适合比例，并在退出集合计划后及时以网站公告的形式告知托管人和投资者。

（二）自有资金参与及退出的相关流程

投资者签署私募资产管理合同即视为知悉并同意管理人可以在初始募集期内以自有资金参与集合资产管理计划。管理人在初始募集期以自有资金参与集合资产管理计划的，应当在募集公告中披露自有资金参与情况；管理人在存续期以自有资金参与、退出集合资产管理计划的，应当提前 5 个工作日告知和征询全体投资者和托管人的意见，投资者应在管理人指定的征询日期内按指定的形式回复意见。投资者未在指定征询日期内回复的视为同意；投资者不同意管理人自有资金参与、退出的，有权在管理人公告规定的时间内提出退出集合计划的申请；对于明确回复不同意管理人自有资金参与、退出且逾期未退出的投资者，管理人将统一做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划份额净值），具体强制退出时间以管理人公告为准。

为应对集合资产管理计划巨额退出以解决流动性风险或因集合计划规模变

动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过前述比例的,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、管理人控股股东及其子公司(孙公司)以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受上述限制,但管理人应于事后5个工作日内及时告知投资者和托管人,并根据监管要求向中国证监会相关派出机构报告。

本公司对以上涉及自有资金内容进行调整的,将及时公告披露。同时,如果中国证监会、中国证券投资基金业协会等相关监管部门或自律组织对私募资产管理产品关联交易和自有资金要求另有新增规定或要求的,本公司将另行公告,并遵照执行。

华泰证券(上海)资产管理有限公司

(公章)

年 月 日