

## 关于鹏华基金稳睿 888 号集合资产管理计划

### 整改措施的通告

全体投资者并托管人：

鹏华基金稳睿 888 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）已于 2020 年 9 月 30 日成立，贵公司作为当事人的《鹏华基金稳睿 888 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“原合同”）已于本计划成立日生效。此外，全体当事人于 2022 年 11 月 10 日签署完成了《〈鹏华基金稳睿 888 号集合资产管理计划资产管理合同〉补充协议一》（以下简称“补充协议一”，“原合同”和“补充协议一”以下合称“资产管理合同”）。

遵照证监会 2023 年修订的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其配套规则，为符合相关整改要求，我公司就本计划相关整改措施于 2023 年 9 月 20 日向托管人出具《关于鹏华基金稳睿 888 号集合资产管理计划整改措施的确认函》（以下简称“整改确认函”），托管人于 2023 年 9 月 26 日回复无异议，按照约定整改确认函于 2023 年 9 月 26 日生效。

上述整改确认函所述具体整改措施如下：

#### 一、资产管理合同项下“八、资产管理计划的参与、退出与转让-（十二）资产管理人自有资金参与”如下内容

##### “（十二）资产管理人自有资金参与

资产管理人以自有资金投资所持的本计划份额，与资产委托人所持的份额享有同等权益、承担同等风险。

资产管理人的自有资金参与本计划持有期限不得少于六个月。参与、退出时，应当提前 5 个工作日以邮件形式告知资产委托人和资产托管人。

资产管理人的自有资金参与本计划的份额不得超过计划总份额的 20%。资产管理人及其下设机构（含员工）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限的，资产

管理人应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时完成调整。”

调整为

“(十二) 资产管理人自有资金参与

资产管理人以自有资金投资所持的本计划份额，与资产委托人所持的份额享有同等权益、承担同等风险。

证券期货经营机构及其子公司、孙公司（含员工，下同）自有资金参与、退出集合资产管理计划的，应当提前5个工作日书面告知全体投资者和托管人，并取得其同意，具体方式为：管理人与托管人事先书面达成一致后，将以公告、邮件或其他方式通知全体投资者，投资者未在前述通知的指定时间内通过指定形式明确表示不同意该笔自有资金参与、退出的，即视为同意。投资者不同意的，管理人将保障投资者选择退出本计划的权利，视本计划实际运作情况设定临时开放期，临时开放期的安排应符合相关法律法规的规定；或者以管理人和投资者协商一致的方式处理。

证券期货经营机构自有资金参与集合资产管理计划的，持有期限不得少于6个月。

证券期货经营机构及其子公司、孙公司（含员工）以自有资金参与其自身或其子公司管理的单个集合资产管理计划的份额合计不得超过该资产管理计划总份额的50%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因集合资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，证券期货经营机构应当依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时调整达标。

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，证券期货经营机构及其子公司、孙公司（含员工）以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受本条前述规定的限制，但应当及时书面告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。”

二、资产管理合同项下“五、资产管理计划的基本情况-（四）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级-3、[投资比例]”如下内容

“(4) 本计划可进行债券正回购操作，且本计划总资产不得超过净资产的

200%，债券回购或逆回购资金余额不超过上一日资产净值的 100%；”

调整为

“（4）本计划可进行债券正回购操作，且本计划总资产不得超过净资产的 200%，债券回购或逆回购资金余额不超过上一日资产净值的 100%；若本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，总资产不得超过净资产的 120%（资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种不受前述 120%相关规定限制）。”

“（13）本计划的总资产不超过净资产的 200%，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资产管理计划资产净值的 20%；本管理计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的 10%。”

调整为

“（13）本计划的总资产不超过净资产的 200%，若本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，总资产不得超过净资产的 120%（资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种不受前述 120%相关规定限制）。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资产管理计划资产净值的 20%；本管理计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的 10%。”

**三、资产管理合同项下“十一、资产管理计划的投资-（二）投资范围及比例”如下内容**

“（4）本计划可进行债券正回购操作，且本计划总资产不得超过净资产的 200%，债券回购或逆回购资金余额不超过上一日资产净值的 100%；”

调整为

“（4）本计划可进行债券正回购操作，且本计划总资产不得超过净资产的 200%，债券回购或逆回购资金余额不超过上一日资产净值的 100%；若本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，总资产不得超过净资产的 120%（资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种不受前述 120%相关规定限制）。”

“(13) 本计划的总资产不超过净资产的 200%，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资产管理计划资产净值的 20%；本管理计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的 10%。”

调整为

“(13) 本计划的总资产不超过净资产的 200%，若本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，总资产不得超过净资产的 120%（资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种不受前述 120%相关规定限制）。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资产管理计划资产净值的 20%；本管理计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的 10%。”

**四、资产管理合同项下“十一、资产管理计划的投资-（五）投资限制”如下内容**

“3、本计划总资产不得超过净资产的 200%，计算本计划的总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产；”

调整为

“3、本计划总资产不得超过净资产的 200%，计算本计划的总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产；若本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，总资产不得超过净资产的 120%（资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种不受前述 120%相关规定限制）。”

**五、资产管理合同项下“十七、越权交易的界定-（三）资产托管人对资产管理人的投资监督-3、[投资比例]”如下内容**

“(4) 本计划可进行债券正回购操作，且本计划总资产不得超过净资产的 200%，债券回购或逆回购资金余额不超过上一日资产净值的 100%；”

调整为

“(4) 本计划可进行债券正回购操作，且本计划总资产不得超过净资产的

200%，债券回购或逆回购资金余额不超过上一日资产净值的 100%；若本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，总资产不得超过净资产的 120%（资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种不受前述 120%相关规定限制）。”

“（13）本计划的总资产不超过净资产的 200%，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资产管理计划资产净值的 20%；本管理计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的 10%。”

调整为

“（13）本计划的总资产不超过净资产的 200%，若本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，总资产不得超过净资产的 120%（资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种不受前述 120%相关规定限制）。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资产管理计划资产净值的 20%；本管理计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的 10%。”

“3、本计划总资产不得超过净资产的 200%”

调整为

“3、本计划总资产不得超过净资产的 200%，若本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，总资产不得超过净资产的 120%（资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种不受前述 120%相关规定限制）。”

六、资产管理合同项下“十三、利益冲突及关联交易”整体调整为如下内容

“一、关联交易及利益冲突情形

资产委托人知悉，尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，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：资产管理人、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；资产

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。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。资产委托人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

资产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。资产委托人认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

#### （1）关联方范围

关联方为管理人、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。本计划与前述关联方之间有关的交易为关联交易。

#### （2）一般关联交易和重大关联交易

##### 1、重大关联交易

重大关联交易是指，资产管理人运用计划财产投资于资产管理人、资产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，以及中国证监会、基金业协会规定的其他重大关联交易情形。

##### 2、一般关联交易

重大关联交易以外的关联交易为一般关联交易。

#### （3）关联交易审批程序

在进行投资交易时，资产管理人会对投资组合关联交易进行识别，并区分重大关联交易、一般关联交易。资产管理人根据法律法规、合同约定执行重大关联交易、一般关联交易的事前、事中、事后相应管理流程。

重大关联交易需经管理人董事会审议通过后（除由全体董事三分之二以上同意外，还应当经过管理人三分之二以上的独立董事同意）方可执行，所有关联交易事项每半年应提交管理人董事会审查。

#### （4）特别风险提示

提示资产委托人注意：虽然资产管理人积极遵循资产委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因资产管理人

运用委托财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响资产委托人的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。此外，资产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，进而可能影响委托财产的投资收益。

## 二、关联交易及利益冲突的应对及处理

(1) 资产委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意资产管理人从事前文已经明确列明的一般关联交易情形，资产管理人无需就前述具体一般关联交易再行分别取得资产委托人的授权，但该等一般关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益，并依据相关要求履行信息披露和监管报告义务。

(2) 对于本计划涉及的重大关联交易事项，为保护资产委托人权益，资产管理人应当通过逐笔征求意见或者公告确认等方式提前取得其同意，并依据相关要求履行信息披露和监管报告义务；未取得资产委托人同意的，资产管理人不得开展该重大关联交易。

(3) 资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人应当坚持资产委托人利益优先、平等自愿、等价有偿的原则，从充分维护资产委托人利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，资产管理人应当视具体利益冲突情形选择在向资产委托人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、处置方式、对资产委托人利益的影响等。

(4) 后续关于关联交易的法律法规或监管要求如发生变化，本章规定的相关事项届时将按照调整后的法律法规或监管要求予以执行并及时告知投资者和托管人。”

上述整改确认函所述事项与资产管理合同不一致的，应以整改确认函为准；整改确认函未尽事项，应以资产管理合同的约定为准。

特此通告。



