

## 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

根据中国证监会颁发的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（2018年10月22日证监会令第151号公布 2023年1月12日证监会令第203号修订）及其实施要求，中信建投证券股份有限公司（以下简称“本公司”或“管理人”）于2023年4月10日发布了《关于私募资产管理计划关联交易、自有资金及业绩报酬相关事项的公告》，公告了旗下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，不包括参公运作的大集合产品、资产支持专项计划）关联交易、自有资金及业绩报酬相关事项。现结合内部制度及管理变化，将关联交易及自有资金相关事项公告如下：

### 一、关联交易相关事项

#### （一）关联方范围

资产管理产品关联方包括：

1、本公司、本公司的控股股东、实际控制人及与本公司有重大利害关系的公司；

2、资产管理产品的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及与托管人有重大利害关系的公司；

3、资产管理产品的投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及与投资顾问有重大利害关系的公司；

上述第1项为本公司全部资产管理产品的关联方；第2、3项为单个资产管理产品的关联方。

#### （二）关联交易的范围

1、资产管理产品资产买卖本公司、产品托管人、产品投资顾问（如有）及前述主体的控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；

2、资产管理产品资产买卖本公司及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；

3、资产管理产品资产买卖产品托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；

4、资产管理产品开展的以本公司控股股东、实际控制人及与其有重大利害关系的公司等关联方（不包括本公司、本公司的子公司）为交易对手的债券交易（交易所集中竞价交易除外）、正回购交易（交易所集中竞价交易除外）、股票大宗交易及场外衍生品交易；

5、资产管理产品开展的以资产管理产品托管人及其控股股东、实际控制人及其他关联方为交易对手的债券交易（交易所集中竞价交易除外）、正回购交易（交易所集中竞价交易除外）、股票大宗交易及场外衍生品交易；

6、资产管理产品开展转融通证券出借业务，最终借入方为本公司及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司；

7、资产管理产品接受资产管理产品关联方发行的证券作为质押券的逆回购交易，包括银行间市场逆回购以及交易所市场协议逆回购等可以明确交易对手的逆回购交易；

8、法律法规规定及资产管理合同约定的其他关联交易类型。

上述交易类型中如法律法规或本公司制度有禁止性规定的，资产管理产品应遵守禁止性规定，不得开展相关交易。

### **（三）重大关联交易的范围**

资产管理产品重大关联交易的具体类型如下：

1、“（二）关联交易的范围”第1项、第2项所述交易；

2、“（二）关联交易的范围”第3项至第6项中单笔交易金额达到或超过产品净资产15%的交易；

3、法律法规规定及资产管理合同约定的其他重大关联交易类型。

### **（四）一般关联交易的范围**

资产管理产品一般关联交易指除重大关联交易以外的关联交易。

### **（五）关联交易内部管控机制**

本公司制定并实施了关联交易管理制度，规范关联交易的禁止与限制事项、定价、审批、信息披露等事项。公司建立信息系统对关联方交易进行识别，按资产管理合同约定及公司制度履行对关联方交易的审批、披露、报告等程序。在关联交易定价方面，应符合法律法规、监管规则及产品合同的约定，确定合理的定价方法和科学的定价程序，真实公允地反映价值。在关联交易审批方面，资管产品从事重大关联交易的，投资经理需根据交易金额或投资比例等完

成相应事前审批程序，并通过公告等方式对逐笔交易征得委托人同意。对于一般关联交易，无需就具体关联交易逐笔取得投资者的同意，无需履行特别审批程序，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，合规风控部门定期对一般关联交易进行跟踪分析。

#### **（六）关联交易的特别风险提示**

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受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。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，进而可能影响受托财产的投资收益。此外，管理人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，管理人仅需要事后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、自有资金相关事项**

管理人可以以自有资金参与集合计划。

#### **（一）自有资金参与条件**

管理人以自有资金参与集合计划，应符合《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》及中国证监会等监管机构的相关规定。

#### **（二）自有资金的参与方式和金额**

管理人可在每个开放期、集合计划募集期，选择参与集合计划，参与金额不得低于资产管理计划最低参与金额。

#### **（三）自有资金参与比例**

管理人自有资金参与单个集合计划的份额不超过该集合计划总份额的20%。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与单个集合计划的份额合计不得超过集合计划总份额的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。因资产管理计划规模变动等客观因素导致自有资金投资比例被动超限的，证券期货经营机构将依照中国证监会规定及资产管理合同的约定及时完成调整。

#### **（四）自有资金的收益分配**

管理人自有资金参与份额与投资者持有计划份额享有同等参与收益分配的权利。

#### **（五）自有资金责任承担方式和金额**

管理人自有资金参与份额与其他投资者持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任，不承担附加责任。

#### **（六）自有资金退出的条件**

每个开放日，管理人可以在开放期退出集合计划份额。

#### **（七）自有资金参与、退出程序**

投资者及托管人在此同意证券期货经营机构及其子公司自有资金可在集合计划募集期参与，管理人在成立后公告参与情况；集合计划存续期间，参与、退出时，应当提前五个工作日告知投资者和托管人并征询意见，投资者不同意的应当在最近的开放日选择退出或不参与集合计划，未退出或选择参与的视为同意，托管人不同意的应当在最近的开放日前以书面形式向管理人反馈意见，未反馈意见即视为同意；在开放期内因投资者退出份额导致自有资金参与比例“被动超限”的（即管理人自有资金超过集合计划总份额的20%或证券期货经营机构及其子公司自有资金合计超过集合计划总份额的50%），应及时调整，无需提前五个工作日告知投资者和托管人并取得其同意，但需事后及时告知。证券期货经营机构自有资金参与集合计划的，持有期限不得低于6个月。

为应对巨额退出，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参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，但需事后及时告知投资者和托管人。

#### **（八）风险揭示**

管理人以自有资金参与集合计划并不代表管理人对集合计划的风险和收益水平作出任何形式的判断。管理人自有资金参与份额与其他投资者持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任，并不对同类份额本金或收益提供任何形式的保障。

本部分“证券期货经营机构”是指管理人或其母公司(若为证券期货经营机构的)。

本公司对以上关联交易及自有资金相关事项进行调整的，将公告披露。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计划关联交易和自有资金另有新增规定或要求的，本公司将另行公告，并遵照执行。

中信建投证券股份有限公司

2023年5月23日