

# 中山证券有限责任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》），并自 2023 年 3 月 1 日起施行。《管理办法》《运作管理规定》对于私募资产管理计划的关联交易、管理人的自有资金投资调整了监管要求。

鉴于此，结合《管理办法》《运作管理规定》的监管要求，中山证券有限责任公司（以下简称“本公司”或“管理人”）现将旗下成立于 2023 年 3 月 1 日前并持续管理、运作的私募资产管理计划（以下简称“资管产品”，包括本公司作为管理人的集合资产管理计划及单一资产管理计划，但不包括本公司作为管理人的资产支持专项计划）关于关联交易、自有资金的有关事项明确如下：

## 一、关联交易

自公告日起，本公司承诺依照法律、法规及内部制度对资管产品开展的关联交易进行管理和控制。

### （一）关联方范围

本公司资管产品执行的“关联方”的范围为：

- 1、本公司；
- 2、依据《企业会计准则第36号——关联方披露》等企业会计准则要求认定的本公司关联方范围；
- 3、资管产品的托管人及该托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；
- 4、资管产品的投资顾问（如有）及该投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方。

上述第1、2项为本公司全部资管产品的关联方；第3、4项为单个资管产品的关联方。

## (二) 一般关联交易、重大关联交易的区分标准

- 本公司资管产品执行的重大关联交易包括：

1、资管产品资产投资于本公司及本公司的控股股东、实际控制人或者其他关联方（含本公司的一级全资子公司及控股子公司）发行的证券或者承销期内承销的证券；

2、资管产品资产投资于其托管人及该托管人的控股股东、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；

3、资管产品投资于其投资顾问及该投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；

4、资管产品投资于关联产品，但符合下列条件之一的除外：

(1) 关联产品为货币基金；

(2) 关联产品为公募基金，且投资金额不超过该资管产品净值10%且不超过公募基金份额10%的；

(3) 资管产品为符合《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》规定的基金中基金资产管理计划。

5、资管产品以资管产品关联方或者以关联产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产交易；

6、资管产品以资管产品关联方或者以关联产品为交易对手，通过交易所及银行间等市场询价交易方式进行的关联交易，固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值20%或金额超过2亿元的，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值10%或金额超过3000万元的；

7、若本公司自有资金参与资管产品时，发生资管产品关联交易的，无论金额大小，应视为重大关联交易；

8、经本公司资产管理委员会认定的其他重大关联交易。

- 除前述重大关联交易外，其余关联交易为一般关联交易。

- 前述所称“关联产品”是指：



1、资管产品资产投资于本公司及本公司的控股股东、实际控制人及其他关联方（含本公司的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资管产品（含公募基金、私募投资基金）；

2、资管产品资产投资于本公司对外作为投资顾问管理的资管产品；

3、资管产品资产投资于其投资顾问（如有）担任管理人的资管产品（含公募基金、私募投资基金）。

如相关法律法规、监管规定、协会自律规则或本公司制度对上述关联方、重大关联范围进行调整的，则本公司将按照调整后的规定执行。

若具体资产管理合同对重大关联交易有更严格的约定的，按照具体资产管理合同的约定执行。

### **（三）本公司对关联方交易的内部管控机制**

本公司将遵循公平公正、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。本公司将依据资管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，并履行对关联交易的意见征询、披露、报告等程序。

对于资产管理合同已事先统一授权同意管理人开展关联交易的资产管理计划，一般关联交易仍按照资产管理合同约定进行关联交易管理，无需就具体关联交易分别、逐笔提前取得投资者、托管人的同意，管理人仅需要事后以定期统一披露或报告的方式告知投资者和托管人，并向监管机构报告，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。

自公告日起，本公司旗下私募资产管理计划新增重大关联交易的，将在开展前逐笔以书面方式（包括管理人网站公告、函件、邮件等资产管理合同约定的其他与投资者联系的方式）或公告确认等方式征询投资者意见。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；投资者不同意的，管理人将提供退出安排，届时具体征询意见、退出安排事宜以管理人公告为准，请投资者及时关注。关联交易事后将进行单独披露、报告。如具体资产管理合同有特殊约定的，按照具体资产管理合同的约定执行。



#### **(四) 关联方交易的特别风险提示**

本公司遵循投资者利益优先和审慎经营原则，根据资管产品合同的约定，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，或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，但仍可能因管理人运用资产管理计划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，进而可能影响投资者的利益。关联交易涉及的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。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。

投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉、了解资管产品相关的投资信息等披露内容。

### **二、集合计划的自有资金参与及退出**

#### **(一) 自有资金参与的比例**

自公告日起，管理人及其子公司以自有资金参与其自身或其子公司管理的单个集合计划的份额合计不得超过该集合计划总份额的50%。中国证监会对管理人自有资金投资比例另有规定的，从其规定。

中国证监会、基金业协会等监管机构对合并计算口径另有规定的，从其规定。

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，管理人及其子公司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管理人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**

自公告日起，若资产管理合同约定投资者签署资产管理合同即视为知悉并同意管理人及其子公司可以以自有资金参与集合资产管理计划的，即表示管理人及其子公司在初始募集期内可以以自有资金参与集合资产管理计划且无需提前告知投资者、托管人并另行取得投资者、托管人同意，管理人仅需事后告知投资者、托管人关于管理人及其子公司自有资金参与情况。

自公告日起，管理人及其子公司在存续期内新增以自有资金参与、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，管理人将提供退出安排，届时具体征询意见、退出安排事宜以管理人公告为准，请投资者及时关注。具体资产管理合同对提前告知及征询意见方式等有特殊约定的，按照具体资产管理合同的约定执行。

为应对集合资产管理计划巨额退出以解决流动性风险，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资产管理合同约定的前提下，管理人及其子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“二、集合计划的自有资金参与及退出”（一）（二）款的相关限制，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，并根据监管要求履行报告义务。

### 三、特别说明

本公告所列的内容系根据法律、法规、行业监管要求等规定结合公司实际情况而制定，作为本公司旗下私募资产管理产品的重要补充内容，管理人不另行单独基于本公告内容启动资产管理合同变更程序。后续若中国证监会、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，请投资者及时密切关注。

