

## 华泰资产量化对冲二号投资产品份额持有人会议召开公告

因华泰资产量化对冲二号投资产品（以下简称“本产品”）实际运作需要，产品管理人华泰资产管理有限公司（以下简称“本公司”）拟对本产品合同中相关条款进行相应变更，根据《华泰资产量化对冲二号投资产品产品合同》的有关约定，本公司拟召集召开本次产品份额持有人会议。

### （一）会议参会者

华泰资产管理有限公司华泰资产量化对冲二号投资产品份额的份额持有人。

### （二）会议召开方式

#### 1、召开方式：通讯方式

2、书面表决意见的收取方式：产品管理人需于书面表决意见收取截止时间前三个工作日向所有参会者通过传真方式发送《华泰资产量化对冲二号投资产品份额持有人会议表决函》（含《回执》）。在书面表决意见收取截止时间之前，各参会者应通过传真方式发送加盖公章后《华泰资产量化对冲二号投资产品份额持有人会议表决函》的《回执》给产品管理人，并应及时将上述《回执》原件邮寄给产品管理人，《回执》传真件与原件内容不符的，以《回执》传真件内容为准。

#### 3、书面表决意见收取截止时间：2016年8月2日 17:00

#### 4、传真电话：021-60963542

#### 5、联系人：肖祎

华泰资产  
骑

6、联系人电话：021-80299059

7、联系人邮箱：xiaoyi@chuatai.com

8、邮寄地址：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 1102 室

(三) 拟审议事项、议事程序和表决方式

1、审议事项：

修改序号	所在章节	修订前原合同条款表述	修订后新合同条款表述
1	一、绪言	2、订立及修订产品合同的依据包括《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国保险法》、《保险资产管理公司管理暂行规定》、《中国保险监督管理委员会关于保险资产管理公司开展资产管理产品业务试点有关问题的通知》、《保险资金参与金融衍生产品交易暂行办法》、《保险资金参与股指期货交易规定》等相关法律法规及其他有关监管规定。	2、订立及修订产品合同的依据包括《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国保险法》、《保险资产管理公司管理暂行规定》、《中国保险监督管理委员会关于保险资产管理公司开展资产管理产品业务试点有关问题的通知》、 <u>《中国保监会关于加强组合类保险资产管理产品业务监管的通知》</u> 、《保险资金参与金融衍生产品交易暂行办法》、《保险资金参与股指期货交易规定》等相关法律法规及其他有关监管规定。
2	二、释义	开放日：产品存续期间内开放份额申购与赎回的工作日，即 2015 年 12 月 21 日、2016 年 1 月 4 日及 2016 年 4 月 27 日(若遇节假日，则顺延至下一工作日开放)，产品管理人将于开放日前五个工作日进行公告；	开放日：指产品首个 <u>结算期</u> 内开放份额申购与赎回的工作日，即 2015 年 12 月 21 日、2016 年 1 月 4 日及 2016 年 4 月 27 日(若遇节假日，则顺延至下一工作日开放)； <u>作为特殊情形，2016 年 8 月 11 日作为特别开放日</u> ，产品管理人将于特别开放日前五个工作日进行公告；
3	二、释义	无	结算日：指自产品第二个结算期起，产品管理人确认投资人有效申购或赎回申请的交易日，产品结算日分别为每自然年度 1 月、4 月、8 月、12 月第三周的周三(遇法定节假日顺延至下一交易日)； <u>作为特殊情形，2016 年 8 月第三周的周三，取消此结算日</u> ；
4	二、释义	无	结算期：产品首个 <u>结算期</u> 为自产品设立日(含)起满一个投资年度的对应月对应日的前一日(即 2016 年 8 月 11 日)止的期间；产品第二个 <u>结算期</u> 为自 2016 年 8 月 12 日(含)起至下一个 <u>结算日</u> (含)之间的期间；之后的 <u>结算期</u> 为自上一 <u>结算日</u> (不含)至下一 <u>结算日</u> (含)之间的期间；

5	二、释义	无	<p><b>开放期：</b>指自第二个结算期起的产品运作期间内，产品管理人开始办理本产品申购、赎回业务的日期，申购开放期为每个结算日（T日）前2个交易日（T-2日）至结算日前1个交易日（T-1日），赎回开放期为结算日前4个交易日（T-4日）至结算日前3个交易日（T-3日）；</p>
6	二、释义	<p><b>封闭期：</b>产品存续期间内，除开放日以外的所有时间；  <b>申购：</b>指在产品设立后的开放日内，投资人根据产品合同的规定及销售机构规定的手续申请购买产品份额的行为；  <b>赎回：</b>指在产品设立后的开放日内，产品份额持有人根据产品合同规定及销售机构规定的手续向产品管理人申请卖出产品份额的行为；  <b>存续期：</b>产品合同生效至终止之间的一年；</p>	<p><b>封闭期：</b>产品存续期间内，除开放日/<u>开放期</u>以外的所有时间；  <b>申购：</b>指在产品设立后的开放日/<u>开放期</u>内，投资人根据产品合同的规定及销售机构规定的手续申请购买产品份额的行为；  <b>赎回：</b>指在产品设立后的开放日/<u>开放期</u>内，产品份额持有人根据产品合同规定及销售机构规定的手续向产品管理人申请卖出产品份额的行为；  <b>存续期：</b>指产品合同生效至终止之间的<u>不定期期限</u>；</p>
7	三、产品的基本情况 (九) 产品投资	<p>本产品具体投资范围和比例如下：  (1) 货币类：包括货币型基金、一年以内（含一年）的大额存单、协议存款、定期存款、期限在一年以内（含一年）的央行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购以及中国保监会、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具，占产品资产净值的 0%-100%；  (2) 债券类：包括可转换债、短期融资券（含超短期融资券）、债券基金以及法律法规和监管机构规定的其他固定收益类投资工具，占产品资产净值的 0%-100%；  (3) 权益类：包括股票（含创业板股票、新股申购）、股票基金、混合基金、ETF、LOF 基金以及法律法规和监管机构规定的其它权益类投资工具，占产品资产净值的 0%-100%；</p>	<p>本产品具体投资范围和比例如下：  (1) 货币类：包括货币型基金、一年以内（含一年）的大额存单、协议存款、定期存款、期限在一年以内（含一年）的央行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购以及中国保监会、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具，占产品资产净值的 0%-<u>90%</u>；  (2) 债券类：包括可转换债、短期融资券（含超短期融资券）、债券基金以及法律法规和监管机构规定的其他固定收益类投资工具，占产品资产净值的 0%-<u>90%</u>；  (3) 权益类：包括股票（含创业板股票、新股申购）、股票基金、混合基金、ETF、LOF 基金以及法律法规和监管机构规定的其它权益类投资工具，占产品资产净值的 0%-<u>90%</u>；</p>

8	三、产品的基本情况 (十二) 管理费率	<p>1、产品投资管理费</p> <p>(2) 产品管理人的绩效管理费</p> <p>产品管理人<u>对确认赎回的份额或终止(含提前终止)时的份额在持有期间内净值增长率超过业绩基准(年化收益率 8%)的收益部分提取 15%作为绩效管理费, 绩效管理费在赎回申请确认日(即 T+1 日)计算并在赎回款中扣收, 或在产品终止日(含提前终止日)计算并计提, 按“二十二、产品合同的变更、终止与产品财产清算”的规定支付。</u></p>	<p>1、产品投资管理费</p> <p>(2) 产品管理人的绩效管理费</p> <p>① <u>产品管理人对特别开放日时持有的份额在其持有期间内净值增长率超过业绩基准(年化收益率 8%)的收益部分提取 15%作为绩效管理费。绩效管理费在特别开放日计算并计提, 在其后 5 个工作日内支付。</u></p> <p>② <u>在特别开放日后的每个结算日及产品终止日, 产品管理人对本结算期产品净值增长率超过业绩基准且满足新高法原则的收益部分提取 15%作为绩效管理费, 具体条件如下:</u></p> <p>a、<u>本结算期年化收益率超过 8%;</u></p> <p>b、<u>特别开放日后的每个结算日及产品终止日提取绩效管理费前的产品份额累计净值必须超过自特别开放日起(含), 之后的每个结算日最高产品份额累计净值和 1 的孰高者。绩效管理费在特别开放日后的每个结算日及产品终止日计算并计提, 在其后 5 个工作日内支付, 或按“二十二、产品合同的变更、终止与产品财产清算”的规定支付。</u></p>
9	三、产品基本情况 (十三) 产品存续期限	(十三) 产品存续期限: 一年。	(十三) 产品存续期限: 无固定期限。
10	六、产品份额的封闭期、开放日、申购和赎回 (一) 申购和赎回的办理时间	<p>本产品于封闭期内封闭运作, 产品管理人将于 2015 年 12 月 21 日、2016 年 1 月 4 日及 2016 年 4 月 27 日开放(若遇节假日, 则顺延至下一工作日开放), 接受投资人的申购与赎回, 产品管理人将于开放日前五个工作日进行公告。</p> <p>因不可抗力或其他情形致使产品无法按时开放申购与赎回的, 开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之日的下一个交易日。</p> <p>若出现新的证券交易市场、证券交易所、中金所交易时间变更或其他特殊情况, 产品管理人将视情况对前述开放日及开</p>	<p>本产品于封闭期内封闭运作, <u>产品管理人将于开放日、开放期内办理本产品申购、赎回业务。其中, 产品首个结算期内特别开放日为 2016 年 8 月 11 日; 自第二个结算期起的产品运作期间内, 申购开放期为每个结算日(T日)前 2 个交易日(T-2 日)至结算日前 1 个交易日(T-1 日), 赎回开放期为结算日前 4 个交易日(T-4 日)至结算日前 3 个交易日(T-3 日), 具体日期以产品管理人在结算日前 5 个交易日(T-5 日)发布的公告为准。</u></p> <p>若出现新的证券交易市场、证券交易所、中金所交易时间变更或其他特殊情况, 产品管理人将视情况对前述开放日/开放期及开放时间进行相应的调整并告知产品份额持有人。</p>

		放时间进行相应的调整并告知产品份额持有人。	
11	六、产品份额的封闭期、开放日、申购和赎回 (三) 申购和赎回的原则	1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以开放日当日的产品份额净值为基准进行计算。	1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以开放日/ <u>结算日</u> 当日的产品份额净值为基准进行计算。
12	六、产品份额的封闭期、开放日、申购和赎回 (四) 申购和赎回的程序	2、申购和赎回的确认与通知：投资人在开放日内提交的申购或赎回申请，可在 T+2 日到销售网点或以销售人规定的其他方式查询申请的确认情况。	2、申购和赎回的确认与通知：投资人在开放日/ <u>开放期内</u> 提交的申购或赎回申请，可在 T+2 日到销售网点或以销售人规定的其他方式查询申请的确认情况。
13	六、产品份额的封闭期、开放日、申购和赎回 (五) 申购和赎回的数额限定	1、投资人申购的最低金额为人民币 100 万元，超过部分不设最低级差限制；赎回的最低份额为 10 万份产品份额。在开放日内，产品份额持有人可申请将持有的产品份额全部或部分赎回。因某笔赎回导致产品份额余额少于 10 万份时，不受赎回最低份额的限制，产品份额持有人应将产品份额余额全额赎回。	1、投资人申购的最低金额为人民币 100 万元，超过部分不设最低级差限制；赎回的最低份额为 10 万份产品份额。在开放日/ <u>开放期</u> 内，产品份额持有人可申请将持有的产品份额全部或部分赎回。因某笔赎回导致产品份额余额少于 10 万份时，不受赎回最低份额的限制，产品份额持有人应将产品份额余额全额赎回。
14	七、产品合同当事人及权利义务	(一) 产品合同当事人  1、产品管理人  注册地址：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 4308 室  办公地址：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 43 层	(一) 产品合同当事人  1、产品管理人  注册地址： <u>中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号金茂大厦 1102 室</u>  办公地址： <u>中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 88 号金茂大厦 1102 室</u>

一  
章

15	<p>十二、产品资产的投资</p> <p>(五) 投资范围与投资比例</p>	<p>1、货币类：包括货币型基金、一年以内（含一年）的大额存单、协议存款、定期存款、期限在一年以内（含一年）的央行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购以及中国保监会、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具，占产品资产净值的 0%-100%；</p> <p>2、债券类：包括可转换债、短期融资券（含超短期融资券）、债券基金以及法律法规和监管机构规定的其他固定收益类投资工具，占产品资产净值的 0%-100%；</p> <p>3、权益类：包括股票（含创业板股票、新股申购）、股票基金、混合基金、ETF、LOF 基金以及法律法规和监管机构规定的其它权益类投资工具，占产品资产净值的 0%-100%；</p>	<p>1、货币类：包括货币型基金、一年以内（含一年）的大额存单、协议存款、定期存款、期限在一年以内（含一年）的央行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购以及中国保监会、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具，占产品资产净值的 0%-<u>90%</u>；</p> <p>2、债券类：包括可转换债、短期融资券（含超短期融资券）、债券基金以及法律法规和监管机构规定的其他固定收益类投资工具，占产品资产净值的 0%-<u>90%</u>；</p> <p>3、权益类：包括股票（含创业板股票、新股申购）、股票基金、混合基金、ETF、LOF 基金以及法律法规和监管机构规定的其它权益类投资工具，占产品资产净值的 0%-<u>90%</u>；</p>
----	--	--	--

<p>16</p>	<p>十六、产品的费用与税收 (二) 产品费用计提方法、计提标准和支付方式</p>	<p>(2) 产品绩效管理费 产品管理人<u>对确认赎回的份额或终止(含提前终止)时的份额在持有期间内净值增长率超过业绩基准(年化收益率8%)的收益部分提取15%作为绩效管理费。绩效管理费在赎回申请确认日(即T+1日)计算并在赎回款中扣收,或在产品终止日(含提前终止日)计算并计提,按“二十二、产品合同的变更、终止与产品财产清算”的规定支付。</u> 绩效管理费计算方法如下: <math display="block">F2 = \sum \{ [NAV_t - NAV_i \times (1 + \frac{B}{365} \times T_i)] \times S_i \} \times 15\%</math> F2为应计提的产品绩效管理费; NAV<sub>t</sub>为赎回申请日或本产品终止日(含提前终止日)的产品份额净值; NAV<sub>i</sub>为赎回申请份额或本产品终止(含提前终止)时份额对应的认购或申购价格; B为业绩基准,年化收益率8%; T<sub>i</sub>为赎回申请份额或本产品终止(含提前终止)时份额持有的自然天数; S<sub>i</sub>为赎回申请的份额或本产品终止(含提前终止)时的份额。</p>	<p>(2) 产品绩效管理费 <u>①产品管理人</u>对特别开放日时持有的份额在其持有期间内净值增长率超过业绩基准(年化收益率8%)的收益部分提取15%作为绩效管理费。绩效管理费在特别开放日计算并计提,在其后5个工作日内支付。 绩效管理费计算方法如下: <math display="block">F2 = \sum \{ [NAV_t - NAV_i \times (1 + \frac{B}{365} \times T_i)] \times S_i \} \times 15\%</math> F2为特别开放日应计提的产品绩效管理费; NAV<sub>t</sub>为特别开放日提取绩效费前的产品份额净值; NAV<sub>i</sub>为特别开放日时持有的份额对应的认购或申购价格; B为业绩基准,年化收益率8%; T<sub>i</sub>为特别开放日时份额持有的自然天数; S<sub>i</sub>为特别开放日时的份额。 <u>②在特别开放日后的每个结算日及产品终止日,产品管理人</u>对本结算期产品净值增长率超过业绩基准且满足新高法原则的收益部分提取15%作为绩效管理费,具体条件如下: a、本结算期年化收益率超过8%; b、特别开放日后的每个结算日及产品终止日提取绩效管理费前的产品份额累计净值必须超过自特别开放日起(含),之后的每个结算日最高产品份额累计净值和1的孰高者。 绩效管理费在特别开放日后的每个结算日及产品终止日计算并计提,在其后5个工作日内支付,或按“二十二、产品合同的变更、终止与产品财产清算”的规定支付。 绩效管理费计算方法如下: <math display="block">\text{Max} [\text{Min} (NAV_b + M_1 - NAV_a \times (1 + B/365 \times T), NAV_b + M_1 - NAV_{a+1}) \times 15\% \times Q, 0]</math> 其中: NAV<sub>a</sub>为特别开放日或上个结算日的产品份额净值;</p>
-----------	---	--	--

			<p><u>NAV<sub>t</sub> 为当个结算日提取绩效管理费前的产品份额净值;</u></p> <p><u>NAV<sub>max</sub> 为自特别开放日起(含), 之后的每个结算日最高产品份额累计净值和 1 的孰高者;</u></p> <p><u>M<sub>i</sub> 为本结算期内每份产品份额分红金额之和;</u></p> <p><u>B 为业绩基准, 年化收益率 8%;</u></p> <p><u>T 为本结算期的自然天数;</u></p> <p><u>Q 为当个结算日产品总份额。</u></p>
17	十八、产品的收益	<p>(二) 产品收益的分配原则 本产品在存续期内不进行收益分配。</p>	<p>(二) 产品收益的分配原则 <u>产品收益分配方案由产品管理人拟定, 在方案确定后 5 个工作日内实施。收益分配方案须载明收益的构成、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</u></p>

(具体事项以产品管理人发送的《华泰资产量化对冲二号投资产品份额持有人会议表决函》内容为准)。

2、议事程序和表决方式:《华泰资产量化对冲二号投资产品产品合同》中约定的关于通讯方式召开份额持有人会议议事程序和表决方式(另特别说明,若参会者未按照上述“书面表决意见的收取方式”



向产品管理人发送《回执》的，视为弃权表决，但计入出具有效书面意见的产品份额持有人所代表的产品份额总数)。

特此公告。



司

