

民生加银资管慧选 54 号之赤子之心价值专项资产管理计划所投资的信托计划
扩大投资范围的公告

尊敬的委托人：

根据《民生加银资管慧选 54 号之赤子之心价值专项资产管理计划资产管理合同》的约定，计划主要投资于“华润信托·赤子之心价值集合资金信托计划”，我司作为上述信托计划的委托人，于近期收到《华润信托·赤子之心价值集合资金信托计划扩大投资范围公告》，根据《公告》内容：

一、信托计划拟投资港股通

根据信托合同第 12 条约定，“在不违反国家相关法律法规的前提下，受托人有权与投资顾问协商决定本信托计划投资范围的扩大，并应向委托人披露。”

根据投资顾问申请和信托合同上述约定，华润深国投信托有限公司作为受托人与投资顾问共同协商决定，信托计划拟投资“港股通”。

二、信托计划参与港股通的投资比例如下：

1、投资于一家上市公司所发行的股票(联交所、上交所和深交所合并计算)，不得超过该上市公司总股本的 5%；

2、投资于一家上市公司所发行的股票(联交所、上交所和深交所合并计算)的投资额，不得超过信托计划资产总值的 15%（以成本与市价孰低法计）；

3、持有的全部港股通股票不得超过信托计划资产总值的 50%（以

成本与市价孰低法计）。

目前民生加银资管慧选 ~~54~~ 号之赤子之心价值专项资产管理计划运行情况良好，但信托计划投资范围的变化将影响民生加银资管慧选 ~~54~~ 号之赤子之心价值专项资产管理计划的间接投资范围（即间接投资范围亦扩大到港股通交易），信托计划参与港股通交易可能面临相关投资风险（具体风险详见附件一），若资产委托人对上述信托计划的投资范围的调整有异议，可选择于计划份额的封闭期届满后的下一个开放日申请退出本计划。若委托人未在前述期间向我司申请退出的，均被视作充分了解并愿意承担相关投资风险。

特此公告！

民生加银资产管理有限公司

2016 年 1 月 27 日

附件一：

华润信托·赤子之心价值集合资金信托计划

参与港股通交易特别风险提示

委托人应详阅并理解如下关于信托计划参与港股通交易的风险揭示条款：

1、 香港证券市场与内地证券市场存在诸多差异，信托计划参与港股通交易需遵守内地与香港相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件 and 业务规则；通过港股通参与香港证券市场交易与通过其他方式参与香港证券市场交易，也存在一定的差异。

2、 信托计划可以通过港股通买卖的股票存在一定的范围限制，且港股通股票名单会动态调整。对于被调出的港股通股票，自调整之日起，信托计划将不得再行买入。

3、 港股通业务试点期间存在每日额度和总额度限制。总额度余额少于一个每日额度的，上交所证券交易服务公司自下一港股通交易日起停止接受买入申报，信托计划将面临不能通过港股通进行买入交易的风险；在香港联合交易所有限公司（以下简称“联交所”）开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，该当日信托计划将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

4、 由于沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，具体以上交所证券交易服务公司在其指定网站公布

的日期为准。所以存在即使联交所开市，信托计划也无法进行港股通交易的风险。

5、 每个港股通交易日的交易时间包括开市前时段和持续交易时段，具体按联交所的规定执行。

6、 圣诞前夕（12 月 24 日）、元旦前夕（12 月 31 日）或除夕日为港股通交易日的，港股通仅有半天交易，且当日为非交收日。

7、 香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能停市，信托计划将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现上交所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，上交所证券交易服务公司将可能暂停提供部分或者全部港股通服务，信托计划将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。上交所证券交易服务公司及上交所对于发生交易异常情况及采取相应处置措施造成的损失，不承担责任。

8、 信托计划在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。

9、 信托计划参与联交所自动对盘系统交易，在联交所开始前时段应当采取竞价限价盘委托，在联交所持续交易时段应当采取增强限价盘委托。其中，竞价限价盘指联交所《交易所规则》规定的一种适用于联交所开市前时段的可以指定价格或者更优价格成交的买卖

盘。增强限价盘指联交所《交易所规则》规定的一种适用于联交所持续交易时段的可以指定价格或者更优价格成交的买卖盘。

10、信托计划持有的碎股只能通过联交所半自动对盘碎股交易系统卖出。其中，碎股指不足一个买卖单位的证券。

11、信托计划当日买入的港股通股票，经确认成交后，在交收前即可卖出，信托计划将承担因此可能产生的风险。

12、与内地证券市场相比，联交所在订单申报的最小交易价差、每手股数、申报最大限制等方面存在一定的差异，信托计划将承担因此可能产生的风险。

13、港股通交易中若联交所与上交所证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报，信托计划将承担因此可能产生的风险。

14、港股通股票不设置涨跌幅限制，信托计划将承担因此可能产生的风险。

15、信托计划通过港股通业务获得的香港证券市场免费一档行情，与付费方式获得行情相比，在刷新频率、档位显示等方面存在差异，信托计划将承担依此进行投资决策的风险。

16、在香港证券市场，股票价格上涨时，股票报价屏幕上显示的颜色为绿色，下跌时则为红色，与内地证券市场存在差异。

17、信托计划因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，上交所另有规定的除外；因港股通

股票权益分派或转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享受相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

18、香港证券市场与内地证券市场在证券资金的交收期安排上存在差异，港股通交易的交收期为 T+2 日。若信托计划卖出证券，在交收完成前仍享有该证券的权益。若信托计划买入证券，在交收完成后才能享有该证券的权益。

19、信托计划通过港股通业务暂不能参与新股发行认购。信托计划能否及以何种方式参与供股和公开配售业务，将按照有关法规、规章或规范性文件的规定执行。

20、对于在联交所上市公司派发的现金红利，由于中国结算需要在收到香港中央结算有限公司（以下简称“香港结算”）派发的外币红利资金后进行换汇、清算、发放等业务处理，信托计划通过港股通业务获得的现金红利将会较香港市场有所延后。

21、对于在联交所上市公司派发的红股，中国结算在收到香港结算派发红股到账当日或次日进行业务处理，相应红股可于处理日下一港股通交易日上市交易。红股可卖首日均较香港市场晚一个港股通交易日。

22、由于中国结算是在汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿，中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；

投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。

23、对于在联交所上市公司派发的红股以及股份分拆及合并业务产生的零碎股，中国结算对信托计划账户中小于 1 股的零碎股进行舍尾处理。当香港结算发放的红股总数或分拆、合并股票数额大于信托计划账户舍尾取整后的总数的，中国结算按照精确算法分配差额部分。

24、香港结算因极端情况下无法交收证券对中国结算实施现金结算的，中国结算将参照香港结算的处理原则进行相应业务处理。

25、港股通境内结算实施分级结算原则。信托计划可能面临如下风险：（一）因结算参与人未完成与中国结算的集中交收，导致信托计划应收资金或证券被暂不交付或处置；（二）结算参与人对投资者出现交收违约导致信托计划未能取得应收证券或资金；（三）结算参与人向中国结算发送的有关投资者的证券划付指令有误的导致信托计划权益受损；（四）其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致信托计划利益受到损害的情况。

26、香港市场收费标准与内地市场收费标准不同，香港地区与内地在税收安排方面也存在差异，信托计划买卖港股通股票，应当按照香港市场有关规定交纳相关费用，并按照香港地区相关规定缴纳税款。

27、对于因上交所、中国结算制定、修改业务规则，或者根据业务规则履行自律监管职责等造成的损失，上交所和中国结算不承担责任。

28、因不可抗力、意外事件、技术故障等异常交易情况，导致或者可能导致部分或者全部港股通交易不能正常进行的，上交所证券交

易服务公司有权采取暂停部分或者全部港股通服务等措施，上交所证券交易服务公司、上交所对由此造成的损失不承担责任。