

关于对私募资产管理产品关联交易及内部管控措施相关事项的公告

尊敬的投资者：

根据《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》）及其实施要求，上海光大证券资产管理有限公司（以下简称“本公司”或“管理人”）现将旗下持续运作的私募资产管理产品（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、资产证券化产品）关联交易有关事项明确并披露如下：

一、关联方范围

本公司依照法律、法规及内部制度对产品开展的关联交易进行管理和控制。本公司内部制度对私募资产管理产品“关联方”的范围明确为：管理人、管理人的控股股东、实际控制人或其他关联方及前述机构管理的产品（包括管理人作为投资顾问的产品）、托管人以及托管人控股股东、实际控制人或者其他关联方，与管理人或托管人有重大利害关系的机构及个人。

管理人的关联方名单如下：

序号	公司名称	关联关系
1	光大证券股份有限公司	母公司

2	光大期货有限公司	母公司的控股子公司
3	光大资本投资有限公司	母公司的控股子公司
4	光大富尊投资有限公司	母公司的控股子公司
5	光大证券金融控股有限公司	母公司的控股子公司
6	光大发展投资有限公司	母公司的控股子公司
7	光大幸福融资租赁有限公司	母公司的控股子公司
8	光大保德信基金管理有限公司	母公司的控股子公司

二、一般关联交易、重大关联交易的认定标准

1、重大关联交易：产品的单笔或单日累计关联交易超过该产品资产净值 10%且不低于人民币 3000 万元的，或产品投资关联方发行证券或承销期内承销的证券的，视为该产品的重大关联方交易。

2、一般关联交易：重大关联交易以外的为一般关联交易，质押券管控等视为产品一般关联交易。

三、关联交易的内部管控措施

本公司制定并实施《上海光大证券资产管理有限公司关联交易管理制度》，规范关联交易禁止及限制、审议决策机制等。管理人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通知审批、披露、报告等程序。

在禁止交易方面：资产管理产品禁止与管理人控股股东的自营账户、管理人管理的其他产品账户发生交易；禁止违规关联交易：包括但不限于利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品

或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、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提供融资。

决策机制方面：资产管理产品从事一般关联交易按照管理人正常的业务审批程序。从事重大关联交易的，事先取得投资者同意，还需通过业务部门、内控职能部门的审批程序。

四、征询投资者意见的方式

1、一般关联交易

资产管理合同约定，管理人可运用本公司管理的私募资产管理计划资产从事一般关联交易，管理人无需就具体的一般关联交易分别取得投资者的个别授权但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与。管理人运用本公司管理的私募资产管理计划资产从事一般关联交易的，事后进行定期统一披露及报告。

2、重大关联交易

管理人运用本公司管理的私募资产管理计划资产从事重大关联交易，应采取逐笔征求意见或说明函确认等方式事先取得投资者的同意，事后告知投资者和托管人，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益，并及时将关联交易结果向中国证监会相关派出机构报告。

五、关联交易的特别风险提示

管理人提示投资者注意：虽然管理人积极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、积极防范利益冲突，但私募资产管理产品仍可能因关联交易而遭受损失，或者被监管部门认

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。交易标的价格可能会出现下跌，从而使收益下降，甚至带来本金损失。部分关联交易的最终结果未必有利于资产管理产品而是有利于关联方。此外，管理人运用本公司管理的私募资产管理产品资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，进而可能影响产品的投资收益。

本公司对以上内容进行调整的，将及时公告披露。若法律法规、监管规定自律规则或中国证监会、行业协会监管意见等对私募资产管理产品关联交易另有规定的，从其规定，本公司届时将按照最新监管规定遵照执行，不再履行合同变更程序。

管理人将恪尽职守，积极维护广大投资者的权益。

上海光大证券资产管理有限公司

2023年7月13日