

## 关于汇金稳健强债 1 期集合资产管理计划 合同变更的确认函

兴业银行股份有限公司：

为维护客户利益，我司拟为托管在贵行的“汇金稳健强债 1 期集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）进行合同变更，主要变更内容体现为以下方面（具体变更内容详见本确认函之附件《汇金稳健强债 1 期集合资产管理计划资产管理合同变更明细表》）：

- 1、修改集合资产管理计划的基本情况中的投资范围；
- 2、修改了集合资产管理计划的基本情况中的资产配置比例；
- 3、修改了集合计划的估值；
- 4、修改了投资限制及禁止行为中托管人对管理人的投资监督；
- 5、修改了风险揭示书。

根据本集合计划资产管理合同的约定，本次合同变更程序安排如下：

- 1、我司与贵行就本次合同变更内容达成书面一致；
- 2、我可以短信或其他方式通知委托人，并在我司网站发布合同变更公告。

委托人不同意合同变更的，应在公告发布之日起至合同变更成立日内的开放日或特别开放日（具体开放日或特别开放日以管理人网站公告为准）提出退出申请。未提出退出申请的，视同委托人已经同意本次合同变更。上述开放日或特别开放日结束后的下一个工作日，若同意合同变更的客户数量不少于 2 人(含)，则我司约定该工作日为合

同变更生效日；若同意合同变更的客户数量少于 2 人，则本次合同变更失败。

3、如合同变更成立，则我司将于合同变更生效日后的 5 个工作日内将合同变更的情况报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送我司住所地中国证监会派出机构。

鉴于贵行为本集合计划的托管人，请贵行对本次变更内容予以确认。

第一创业证券股份有限公司

2019 年 9 月 5 日



附件：汇金稳健强债 1 期集合资产管理计划资产管理合同变更明细表

## 确 认 函 回 执

我行已知悉，并同意你司在《关于汇金稳健强债 1 期集合资产管理计划合同变更的确认函》中所提及的合同相关条款的变更。

兴业银行股份有限公司（盖章）

签署日：二〇一九年九月 日



附件：汇金稳健强债 1 期集合资产管理计划资产管理合同变更对照表

序号	位置	原合同	变更后合同
1	“四、集合资产管理计划的基本情况”	<p>(四) 投资范围和投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的固定收益类资产、权益类资产、金融衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>(1) 现金类资产：现金、各类银行存款、债券回购（包括正回购、逆回购）、货币市场基金等；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所市场交易的品种，包括国债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债（含可分离交易的可转债）、可交换债（含可交换私募债）、资产支持证券（不含劣后级）、债券型基金、分级类证券投资基金 A 份额，经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）以及其他债券；</p> <p>(3) 金融衍生品：国债期货（套期保值）。</p>	<p>(四) 投资范围和投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的固定收益类资产、权益类资产、金融衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>(1) 现金类资产：现金、各类银行存款、债券回购（包括正回购、逆回购）、货币市场基金等；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所市场交易的品种，包括国债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债（含可分离交易的可转债）、可交换债（含可交换私募债）、资产支持证券（不含劣后级）、债券型基金、分级类证券投资基金 A 份额，经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）以及其他债券；</p> <p>(3) 金融衍生品：国债期货（套期保值）。</p>



	<p>(4) 权益类资产：国内依法发行并在证券交易所交易的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的 A 股股票，含且不限于二级市场股票、新股发行、股票增发等）、证券投资基金（含股票型基金、混合型基金，运作方式包括但不限于契约型开放式、契约型封闭式、上市开放式、交易型开放式及分级基金等）、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（“沪港通标的股票”）、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所市场的股票（“深港通标的股票”）等；</p>	<p>(4) 权益类资产：国内依法发行并在证券交易所交易的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的 A 股股票，含且不限于二级市场股票、新股发行、股票增发等）、证券投资基金（含股票型基金、混合型基金，运作方式包括但不限于契约型开放式、契约型封闭式、上市开放式、交易型开放式及分级基金等）、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（“沪港通标的股票”）、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所市场的股票（“深港通标的股票”）等；</p> <p><b>(5) 金融产品：在基金业协会备案发行的私募证券投资基金及其他金融监管部门批准或备案发行的金融产品；</b></p>
2	<p>（四）投资范围和投资比例</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>（1）固定收益类与现金类资产的投资比例为资产总值的 80%-100%；</p> <p>（2）金融衍生品的合约价值投资比例为资产总值的 0%-20%，且衍生品账户权益不超过总资产的 20%；</p> <p>（3）权益类资产的投资比例为资产总值的 0%-20%；</p> <p>（4）参与证券回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过集合计划上一个工作日资产净值的 100%，且总资产不得超过集合计划资产净值的 200%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于</p>	<p>（四）投资范围和投资比例</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>（1）固定收益类与现金类资产的投资比例为资产总值的 80%-100%；</p> <p>（2）金融衍生品的合约价值投资比例为资产总值的 0%-20%，且衍生品账户权益不超过总资产的 20%；</p> <p>（3）权益类资产的投资比例为资产总值的 0%-20%；</p> <p><b>（4）金融产品的投资比例为资产总值的 0%-20%；</b></p> <p>（5）参与证券回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过集合计划上一个工作日资产净值的 100%，且总资产不得超过集合计划资产净值的 200%，中国证监会另有规定的除外。</p>

		<p>管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。但管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，避免利益冲突，禁止利益输送。交易完成后，管理人应及时书面通知托管人，通过电子邮件、传真、纸质文件或管理人网站等方式告知委托人，并向证券交易所报告。</p> <p>管理人将在集合计划成立之日起 6 个月内，使集合计划的投资组合比例符合上述约定。建仓期的投资活动，应当符合资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 15 个交易日内将投资比例降至许可范围内。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>	<p>委托人同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。但管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，避免利益冲突，禁止利益输送。交易完成后，管理人应及时书面通知托管人，通过电子邮件、传真、纸质文件或管理人网站等方式告知委托人，并向证券交易所报告。</p> <p>管理人将在集合计划成立之日起 6 个月内，使集合计划的投资组合比例符合上述约定。建仓期的投资活动，应当符合资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 15 个交易日内将投资比例降至许可范围内。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>
3	“十二、集合计划的估	(三) 单位净值	(三) 单位净值

	值”	<p>集合计划单位净值是指：集合计划资产净值除以当日集合计划份额总数计算得到的每一集合计划份额的价值。</p> <p>单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p>	<p>集合计划单位净值是指：集合计划资产净值除以当日集合计划份额总数计算得到的每一集合计划份额的价值。</p> <p>单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入。管理人可以设立巨额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。</p>
4	“十二、集合计划的估值”	<p>(七) 估值方法</p> <p>无</p>	<p>6、持有的在基金业协会备案发行的私募证券投资基金及其他金融监管部门批准或备案发行的金融产品等，公布净值的，按照最新公布的净值估值（若公布净值的同时，也提供扣除掉业绩报酬后的虚拟净值，优先选择按虚拟净值估值）；不公布净值的，按照成本估值。如所投金融产品公布的净值错误等管理人和托管人之外的原因，导致本集合计划估值错误的，本计划管理人和托管人予以免责。管理人、托管人根据所投金融产品管理人所公布提供的产品净值进行估值，如相关金融产品未按时同步提供净值给托管人，托管人根据管理人转发的数据进行估值。</p>
5	“十五、投资理念与投资策略”	<p>(三) 投资策略</p> <p>无</p>	<p>(三) 投资策略</p> <p>4、私募基金投资管理策略</p> <p>本集合计划根据宏观经济运行情况及投资风格表现制定资产配置策略，选聘市场上投资管理能力强、投资风格清晰、投资收益稳定的私募基金管理人，投资于上述私募基金管理人成立的私募证券投资基金，并对私募基金管理人的投资业绩进行评估及管理。</p>
6	“十七、投资限制及禁	<p>(三) 托管人对管理人的投资监督</p> <p>①对投资范围的监督：</p>	<p>(三) 托管人对管理人的投资监督</p> <p>①对投资范围的监督：</p>



止行为”	<p>(1) 现金类资产：现金、各类银行存款、债券回购（包括正回购、逆回购）、货币市场基金等；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所市场交易的品种，包括国债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债（含可分离交易的可转债）、可交换债（含可交换私募债）、资产支持证券、债券型基金、分级类证券投资基金 A 份额，经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）以及其他债券；</p> <p>(3) 金融衍生品：国债期货（不含实物交割）。</p> <p>(4) 权益类资产：国内依法发行并在证券交易所交易的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的 A 股股票，含且不限于二级市场股票、新股发行、股票增发等）、证券投资基金（含股票型基金、混合型基金，运作方式包括但不限于契约型开放式、契约型封闭式、上市开放式、交易型开放式及分级基金等）、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（“沪股通标的股票”）、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联</p>	<p>(1) 现金类资产：现金、各类银行存款、债券回购（包括正回购、逆回购）、货币市场基金等；</p> <p>(2) 固定收益类资产：国内依法发行并在银行间市场和交易所市场交易的品种，包括国债、地方政府债、政府支持机构债、企业债、公司债（含公开发行和非公开发行）、金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债（含可分离交易的可转债）、可交换债（含可交换私募债）、资产支持证券、债券型基金、分级类证券投资基金 A 份额，经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具，包括短期融资券、超短期融资券、中期票据、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）以及其他债券；</p> <p>(3) 金融衍生品：国债期货（不含实物交割）。</p> <p>(4) 权益类资产：国内依法发行并在证券交易所交易的股票（含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的 A 股股票，含且不限于二级市场股票、新股发行、股票增发等）、证券投资基金（含股票型基金、混合型基金，运作方式包括但不限于契约型开放式、契约型封闭式、上市开放式、交易型开放式及分级基金等）、沪港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（“沪股通标的股票”）、深港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联</p>
------	--	--



		合交易所市场的股票（“深港通标的股票”）等；	合交易所市场的股票（“深港通标的股票”）等；
7	“十七、投资限制及禁止行为”	<p>（三）托管人对管理人的投资监督</p> <p>②对资产配置比例的监督：</p> <p>（1）固定收益类与现金类资产的投资比例为资产总值的80%-100%；</p> <p>（2）金融衍生品的合约价值投资比例为资产总值的0-20%，且衍生品账户权益不超过总资产的20%；</p> <p>（3）权益类资产的投资比例为资产总值的0%-20%；</p> <p>（4）参与证券回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过集合计划上一工作日资产净值的100%。</p>	<p><b>（5）金融产品：在基金业协会备案发行的私募证券投资基金及其他金融监管部门批准或备案发行的金融产品；</b></p> <p>（三）托管人对管理人的投资监督</p> <p>②对资产配置比例的监督：</p> <p>（1）固定收益类与现金类资产的投资比例为资产总值的80%-100%；</p> <p>（2）金融衍生品的合约价值投资比例为资产总值的0-20%，且衍生品账户权益不超过总资产的20%；</p> <p>（3）权益类资产的投资比例为资产总值的0%-20%；</p> <p><b>（4）金融产品投资比例为资产总值的0%-20%；</b></p> <p>（5）参与证券回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过集合计划上一工作日资产净值的100%。</p>
8	“二十四、风险揭示”	<p>（八）本集合计划特有风险</p> <p>无</p>	<p>（八）本集合计划特有风险</p> <p><b>6、投资金融产品的风险</b></p> <p>本集合计划部分资产将配置于以量化套利、量化对冲、CTA、量化多空等量化策略为主的金融监管部门批准或备案发行的金融产品（包括经备案的投资于证券的私募基金），投资上述金融产品可能因下列特定风险因素给本计划造成不利影响，请委托人知悉。</p> <p><b>1) 金融产品管理人风险</b></p> <p>金融产品管理人风险包括管理人经营风险和操作风险。经营风险是指因管理能力、财务状况、行业竞争、人员素质、内控等因素</p>



			<p>导致公司经营不善，极端情况下甚至破产倒闭，可能对其管理人的产品业绩造成不利影响。另外，对于约定了止损条款的金融产品，可能因管理人未及时操作导致产品损失扩大的风险。</p> <p>2) 量化策略模型失效风险 本计划拟配置的量化套利、量化对冲、CTA、量化多空等量化策略主要依赖于量化模型，因为模型不能有效的、完全的刻画市场运行中的真实状况，模型在测算、评估时存在误差（历史表现不保证未来表现），模型中的参数估计存在误差，或者市场条件突然发生改变等因素，量化模型的可靠性将对本资产管理计划的收益产生影响，可能最终导致模型失效的风险。</p> <p>3) 量化策略模型风格偏离风险 在实际运作中，因金融产品的投资经理变更导致模型无法有效运作，或者在运作过程中与产品期初投资策略和投资风格发生偏离，进而影响产品投资业绩。</p> <p>4) 赎回金融产品面临的流动性风险 因本计划委托人赎回或管理人进行资产配置调整需要，管理人赎回金融产品时，可能触发金融产品大额赎回或巨额赎回条款，导致赎回资金延迟到账的风险。</p>
--	--	--	--