

关于第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划 合同变更的公告

尊敬的委托人：

由我司作为管理人，国泰君安证券股份有限公司作为托管人的第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2020 年 6 月 3 日成立。为满足客户需求，拟对《第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》进行变更。详细内容见本公告附件。

为保证委托人的利益，本计划变更事宜已经获得托管人的书面同意确认。委托人不同意本次合同变更的应在 2020 年 9 月 18 日提出退出申请。未提出退出申请的，视同委托人已经同意本次合同变更。截止 2020 年 9 月 18 日，若同意合同变更的委托人数量不少于 2 人（含 2 人），则我司约定 2020 年 9 月 21 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，则本计划将终止。

特此公告。

附件 1：第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同变更明细表

附件 2：第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划说明书变更明细表



附件 3：第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书变更
 明细表



附件 1：第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同变更明细表

序号	位置	原合同	变更后合同
1	“五、资产管理计划的基本情况”	<p>2、本计划的投资方向为：</p> <p>（1）金融品类资产：公募基金证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、信托公司集合资金信托计划、基金公司及其基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金；</p> <p>（2）现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、货币市场基金。</p> <p>3、本计划的投资比例为：本</p>	<p>2、本计划的投资方向为：</p> <p>（1）金融品类资产：公募基金证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、基金公司及其基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金；</p> <p>（2）现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。</p> <p>3、本计划的投资比例为：本计划为混合类产品，投资于金融产</p>

		<p>计划为混合类产品，投资于金融产品类资产的比例不低于 80%；并通过投向金融产品类资产进行以下比例的资产配置：</p> <p>（1）固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%；</p> <p>（2）权益类产品的投资比例为资产总值的 0-80%；</p> <p>（3）商品及金融衍生品类产品的投资比例低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。</p>	<p>品类资产的比例不低于 80%；并通过投向金融产品类资产进行以下比例的资产配置：</p> <p>（1）固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%；</p> <p>（2）权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%；</p> <p>（3）商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值不超过资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。</p>
2	<p>“五、资产管理计划的基本情况”</p>	<p>（十三）预警止损机制</p> <p>本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人于 R 日日终计划份额单位净值核对一致后 2 个工作日（含）内以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：</p> <p>1、本计划预警线为 0.820 元。当本计划份额日终单位净值 <0.820 元时（该交易日称为“R”</p>	<p>（十三）预警止损机制</p> <p>本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当 R 日计划份额净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人于 R 日日终计划份额单位净值核对一致后 2 个工作日（含）内以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：</p> <p>1、本计划预警线为 0.8200 元。当本计划份额日终单位净值 <0.8200 元时（该交易日称为“R”</p>

	<p>日)，则自 R+2 日起，管理人仅可卖出、赎回金融产品和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至 0.820 元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>2、本计划止损线为 0.800 元。本计划份额日终单位净值<0.800 元时（该交易日称为“R”），则自 R+2 日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的当日为本合同提前终止日。</p>	<p>日)，则自 R+2 日起，管理人仅可卖出、赎回金融产品和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至 0.8200 元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>2、本计划止损线为 0.8000 元。本计划份额日终单位净值<0.8000 元时（该交易日称为“R”），则自 R+2 日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的当日为本合同提前终止日。</p>
3	<p>“八、资产管理计划的参与、退出与转让”</p> <p>(2) 巨额退出的处理方式</p> <p>当出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出。巨额退出的价格以注册登记机构受理退出申请当日的本计划单位净值为准。</p> <p>本计划单位净值的计算精确到 0.001 元，但在发生巨额退出的情形下，为避免委托人利益因份额净值的小数点保留精度受到重大影响，管理人可以通过设立</p>	<p>(2) 巨额退出的处理方式</p> <p>当出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出、部分顺延退出。巨额退出的价格以注册登记机构受理退出申请当日的本计划单位净值为准。</p> <p>本计划单位净值的计算精确到 0.0001 元，但在发生巨额退出的情形下，为避免委托人利益因份额净值的小数点保留精度受到重大影响，管理人可以通过设立巨额</p>

		<p>巨额退出情形下的净值精度应急调整机制从而提高份额净值的精度。届时，管理人在与托管人协商一致的情况下，发布关于净值精度调整的公告。</p> <p>全额退出：当管理人认为有能力支付委托人的退出申请时，按正常退出程序执行。</p> <p>部分顺延退出：当本计划支付委托人的退出申请可能会对本计划的资产净值造成较大波动或造成本计划存在流动性困难时，管理人在当日正常接受的退出份额不低于上一日本计划总份额的20%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；委托人可在申请退出时选择将当日未获受理部分予以撤销，如委托人不撤销未获处理部分，未受理部分自动延迟至下一个工作日办理。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权，并以该工作日的本计划单位资产净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。</p>	<p>退出情形下的净值精度应急调整机制从而提高份额净值的精度。届时，管理人在与托管人协商一致的情况下，发布关于净值精度调整的公告。</p> <p>全额退出：当管理人认为有能力支付委托人的退出申请时，按正常退出程序执行。</p> <p>部分顺延退出：当本计划支付委托人的退出申请可能会对本计划的资产净值造成较大波动或造成本计划存在流动性困难时，管理人在当日正常接受的退出份额不低于上一日本计划总份额的20%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；委托人可在申请退出时选择将当日未获受理部分予以撤销，如委托人不撤销未获处理部分，未受理部分自动延迟至下一个工作日办理。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权，并以该工作日的本计划单位资产净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。</p>
4	“十一、资产管理计划的投资”	<p>1、投资范围</p> <p>(1) 金融产品类资产：公募</p>	<p>1、投资范围</p> <p>(1) 金融产品类资产：公募</p>

	<p>证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、信托公司集合资金信托计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金；</p> <p>(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、货币市场基金。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划为混合类产品，投资于金融产品类资产的比例不低于80%，并通过投向金融产品类资产进行以下比例的资产配置：</p> <p>(1) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的0-80%；</p> <p>(2) 权益类产品的投资比例为资产总值的0-80%；</p> <p>(3) 商品及金融衍生品类产品的投资比例低于资产总值的80%或衍生品账户权益不超过资产总值的20%。</p> <p>本计划投资于上述资产管理产品的，计算本计划总资产时按</p>	<p>证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金；</p> <p>(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划为混合类产品，投资于金融产品类资产的比例不低于80%，并通过投向金融产品类资产进行以下比例的资产配置：</p> <p>(1) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的0-80%；</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例为资产总值的0-80%；</p> <p>(3) 商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值不超过资产总值的80%或衍生品账户权益不超过资产总值的20%。</p> <p>本计划投资于上述资产管理产品的，计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管</p>
--	---	--

		照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，且按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，并按照所投资资产管理产品的披露频率更新计算计划所投资资产的金额或比例。	理产品的总资产，且按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，并按照所投资资产管理产品的披露频率更新计算计划所投资资产的金额或比例。
5	“十一、资产管理计划的投资”	<p>(十一) 预警止损机制</p> <p>本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当R日计划份额净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人于R日日终计划份额单位净值核对一致后2个工作日(含)内以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：</p> <p>1、本计划预警线为0.820元。当本计划份额日终单位净值<0.820元时(该交易日称为“R”日)，则自R+2日起，管理人仅可卖出、赎回金融产品和进行现金类资产的投资，不得再进行买</p>	<p>(十一) 预警止损机制</p> <p>本计划以资产管理人与资产托管人核对一致的日终计划份额单位净值为基础设置预警线和止损线，管理人负责对本计划预警线和止损线进行监控和采取相关操作。当R日计划份额净值低于或等于预警线或止损线，资产托管人于R日日终计划份额单位净值核对一致后2个工作日(含)内以邮件或其他资产托管人与资产管理人共同认可的方式向资产管理人进行提示。具体安排如下：</p> <p>1、本计划预警线为0.8200元。当本计划份额日终单位净值<0.8200元时(该交易日称为“R”日)，则自R+2日起，管理人仅可卖出、赎回金融产品和进行现金类资产的投资，不得再进行买入或申</p>

	<p>入或申（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至 0.820 元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>2、本计划止损线为 0.800 元。本计划份额日终单位净值<0.800 元时（该交易日称为“R”），则自 R+2 日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的当日为本合同提前终止日。</p>	<p>（认）购的投资操作，直至本计划的份额单位净值恢复至 0.8200 元（含）及以上时，自下一个交易日起，方可恢复买入、申（认）购操作；</p> <p>2、本计划止损线为 0.8000 元。本计划份额日终单位净值<0.8000 元时（该交易日称为“R”），则自 R+2 日起，管理人应对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，直至计划资产全部变现为止。本计划资产全部变现的当日为本合同提前终止日。</p>
6	<p>“二十、 资产管理计划 财产的估值和 会计核算”</p> <p>5、估值程序</p> <p>本计划单位净值的计算精确到 0.001 元，小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>本计划资产的日常估值由管理人进行。管理人应于每个估值日后的第一个工作日计算估值日的总资产净值并以双方认可的方式与托管人核对。</p> <p>当管理人与托管人的估值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错</p>	<p>5、估值程序</p> <p>本计划单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>本计划资产的日常估值由管理人进行。管理人应于每个估值日后的第一个工作日计算估值日的总资产净值并以双方认可的方式与托管人核对。</p> <p>当管理人与托管人的估值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误，由此</p>

		误，由此给本计划财产或委托人造成损失的，由管理人承担责任。	给本计划财产或委托人造成损失的，由管理人承担责任。
7	“二十、资产管理计划财产的估值和会计核算”	<p>6、估值错误的处理</p> <p>(1) 当资产估值导致本计划单位净值小数点后三位以内发生差错时，视为本计划单位净值错误。管理人计算的本计划单位资产净值由托管人复核确认后公告。当发生净值计算错误时，由管理人负责处理。</p>	<p>6、估值错误的处理</p> <p>(1) 当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本计划单位净值错误。管理人计算的本计划单位资产净值由托管人复核确认后公告。当发生净值计算错误时，由管理人负责处理。</p>
8	“二十三、信息披露与报告”	<p>(二) 临时报告</p> <p>本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起5日内以管理人指定网站或其他途径和方式及时向委托人披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>1、管理人或托管人变更；</p> <p>2、本计划运作过程中，负责本计划的投资经理发生变更，或出现其他可能对本计划的持续运作产生重大影响的事项；</p> <p>3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>4、本计划终止和清算；</p> <p>5、本合同的补充、修改与变更；</p> <p>6、与本计划有关的重大诉</p>	<p>(二) 临时报告</p> <p>本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起5日内以管理人指定网站或其他途径和方式及时向委托人披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>1、管理人或托管人变更；</p> <p>2、本计划运作过程中，负责本计划的投资经理发生变更，或出现其他可能对本计划的持续运作产生重大影响的事项；</p> <p>3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>4、本计划终止和清算；</p> <p>5、本合同的补充、修改与变更；</p> <p>6、与本计划有关的重大诉讼、</p>

		<p>讼、仲裁事项；</p> <p>7、负责本计划的代理销售机构发生变更；</p> <p>8、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>9、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>10、资产计价出现错误（当资产估值导致本计划单位净值小数点后三位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；</p> <p>11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；</p> <p>12、其他发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件。</p>	<p>仲裁事项；</p> <p>7、负责本计划的代理销售机构发生变更；</p> <p>8、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>9、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>10、资产计价出现错误（当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；</p> <p>11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；</p> <p>12、其他发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件。</p>
9	<p>“二十四、风险揭示”</p>	<p>(5) 本计划单位净值低于止损线的风险</p> <p>当本计划份额单位净值在 R 日日终低于 0.800 时，管理人自 R+2 日起将进行强制止损，对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，本计划终止并根据本合同的约定进入清算流程。因触发止损线到产品实际变现完毕之间存在时间差，产品净值存在进一步下滑的风险，投资</p>	<p>(5) 本计划单位净值低于止损线的风险</p> <p>当本计划份额单位净值在 R 日日终低于 0.8000 时，管理人自 R+2 日起将进行强制止损，对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，本计划终止并根据本合同的约定进入清算流程。因触发止损线到产品实际变现完毕之间存在时间差，产品净值存在进一步下滑的风险，投资者实际取得的</p>

		者实际取得的净值收益可能低于本计划止损线。	净值收益可能低于本计划止损线。
10	“二十四、风险揭示”	<p>14、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险</p> <p>当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，届时赎回净值可能发生变动，委托人退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异，将直接影响到委托人的投资收益。举例如下：</p> <p>假设本计划退出申请日单位净值为A（净值精度调整前），委托人退出份额为X，则退出申请日单位净值精度误差最高为±0.0005元（即四舍五入小数点后第4位最大误差），由此计算的单位净值A调整精度后对委托人退出总金额的最大影响为±X*0.0005元。</p>	<p>14、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险</p> <p>当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，届时赎回净值可能发生变动，委托人退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异，将直接影响到委托人的投资收益。举例如下：</p> <p>假设本计划退出申请日单位净值为A（净值精度调整前），委托人退出份额为X，则退出申请日单位净值精度误差最高为±0.00005元（即四舍五入小数点后第5位最大误差），由此计算的单位净值A调整精度后对委托人退出总金额的最大影响为±X*0.00005元。</p>
11	“附件一：托管人投资监督事项表”	<p>1、投资范围</p> <p>（1）金融产品类资产：公募证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、信托公司集合资金信托计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金；</p> <p>（2）现金类资产：现金、各</p>	<p>1、投资范围</p> <p>（1）金融产品类资产：公募证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金；</p> <p>（2）现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、</p>

	类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、货币市场基金。	银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。
--	---	--

附件 2：第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划说明书变更明细表

序号	位置	原合同	变更后合同
1	“投资范围及比例”	<p>1、投资范围</p> <p>(1) 金融产品类资产：公募证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、信托公司集合资金信托计划、基金公司及其子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金；</p> <p>(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款）、货币市场基金。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划为混合类产品，投资于金融产品类资产的比例不低于 80%；并通过投向金融产品类资产进行以下比例的资产配置：</p> <p>(1) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%；</p> <p>(2) 权益类产品的投资比例为资产总值的 0-80%；</p> <p>(3) 商品及金融衍生品类产品的投资比</p>	<p>1、投资范围</p> <p>(1) 金融产品类资产：公募证券投资基金、证券公司集合资产管理计划、基金公司及其子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金；</p> <p>(2) 现金类资产：现金、各类银行存款（包括银行活期存款、银行同业存款、银行定期存款和银行协议存款等各类存款，不含结构性存款）、货币市场基金。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划为混合类产品，投资于金融产品类资产的比例不低于 80%，并通过投向金融产品类资产进行以下比例的资产配置：</p> <p>(1) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例为资产总值的 0-80%；</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例为资产总值的 0-80%；</p> <p>(3) 商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值不超过资产总值的 80%或衍生品账户</p>

	<p>例低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。</p> <p>本计划投资于上述资产管理产品的，计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，且按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金額需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，并按照所投资资产管理产品的披露频率更新计算计划所投资资产的金額或比例。</p> <p>如因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应自超标发生之日起在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的 15 个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p>	<p>权益不超过资产总值的 20%；</p> <p>本计划投资于上述资产管理产品的，计算本计划总资产时按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，且按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金額需符合本计划资产配置比例的要求。本计划按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，并按照所投资资产管理产品的披露频率更新计算计划所投资资产的金額或比例。</p> <p>如因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人主观因素之外的因素，造成本计划投资比例不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者本合同约定的投资比例的，管理人应自超标发生之日起在流动性受限资产可出售、恢复交易或者具备交易条件的 15 个工作日内将投资比例调整至符合相关要求的范围内。确有特殊事由未能在前述约定时间内完成调整的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。</p>
2	<p>“信息披露”</p> <p>本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起 5 日内以管理人指定网站或其他途径和方式及时向委托人披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人或托管人变更； 2、本计划运作过程中，负责本计划的投 	<p>本计划存续期间，发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当在事项发生之日起 5 日内以管理人指定网站或其他途径和方式及时向委托人披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人或托管人变更； 2、本计划运作过程中，负责本计划的投

	<p>资经理发生变更，或出现其他可能对本计划的持续运作产生重大影响的事项；</p> <p>3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>4、本计划终止和清算；</p> <p>5、本合同的补充、修改与变更；</p> <p>6、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>7、负责本计划的代理销售机构发生变更；</p> <p>8、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>9、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>10、资产计价出现错误（当资产估值导致本计划单位净值小数点后三位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；</p> <p>11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；</p> <p>12、其他发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件。</p>	<p>资经理发生变更，或出现其他可能对本计划的持续运作产生重大影响的事项；</p> <p>3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>4、本计划终止和清算；</p> <p>5、本合同的补充、修改与变更；</p> <p>6、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>7、负责本计划的代理销售机构发生变更；</p> <p>8、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>9、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>10、资产计价出现错误（当资产估值导致本计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；</p> <p>11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；</p> <p>12、其他发生对本计划持续运营、委托人利益、资产净值产生重大影响的事件。</p>
--	--	--

附件 3：第一创业智选 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书变更明细表

序号	位置	原合同	变更后合同
1	“二、 风险揭示”	(5) 本计划单位净值低于止损线的风险	(5) 本计划单位净值低于止损线的风险

		<p>当本计划份额单位净值在 R 日日终低于 0.800 时，管理人自 R+2 日起将进行强制止损，对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，本计划终止并根据本合同的约定进入清算流程。因触发止损线到产品实际变现完毕之间存在时间差，产品净值存在进一步下滑的风险，投资者实际取得的净值收益可能低于本计划止损线。</p>	<p>当本计划份额单位净值在 R 日日终低于 0.8000 时，管理人自 R+2 日起将进行强制止损，对本计划持有的全部非现金类资产进行不可逆的变现操作，本计划终止并根据本合同的约定进入清算流程。因触发止损线到产品实际变现完毕之间存在时间差，产品净值存在进一步下滑的风险，投资者实际取得的净值收益可能低于本计划止损线。</p>
2	“二、 风险揭示”	<p>14、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险</p> <p>当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，届时赎回净值可能发生变动，委托人退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异，将直接影响到委托人的投资收益。举例如下：</p> <p>假设本计划退出申请日单位净值为 A（净值精度调整前），委托人退出份额为 X，则退出申请日单位净值精度误差最高为 ±0.0005 元（即四舍五入小数点后第 4 位最大误差），由此计算的单位净值 A 调整精度后对委托人退出总金额的最大影响为 ±X*0.0005 元。</p>	<p>14、巨额赎回情形下净值精度应急调整机制的风险</p> <p>当本计划发生巨额赎回情形且管理人决定采取净值精度应急调整机制，届时赎回净值可能发生变动，委托人退出金额可能会由于净值精度提高而产生差异，将直接影响到委托人的投资收益。举例如下：</p> <p>假设本计划退出申请日单位净值为 A（净值精度调整前），委托人退出份额为 X，则退出申请日单位净值精度误差最高为 ±0.00005 元（即四舍五入小数点后第 5 位最大误差），由此计算的单位净值 A 调整精度后对委托人退出总金额的最大影响为 ±X*0.00005 元。</p>

