

关于中信期货信安1号集合资产管理计划 合同变更的公告

尊敬的委托人：

根据《中信期货信安1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）关于合同变更的约定，经管理人、托管人协商一致，决定变更《合同》的部分条款。本次变更方案如下：

一、合同变更依据

根据《合同》第二十四节“资产管理合同的变更、终止与财产清算”关于合同变更的方式及程序的规定，对《合同》相关条款进行变更。

二、合同变更内容

1、对《合同》第十七条“资产管理计划的基本情况”第四项“资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级”第（二）点“主要投资方向及投资比例”作出修改：

原合同约定为：

“1、投资方向：本集合计划主要投资于沪深交易所发行、上市的股票（包含上市公司非公开发行股票、新股申购、股票定增）、港股通标的范围内的股票、沪深交易所发行及上市的存托凭证、证券交易所发行及上市的优先股、沪深交易所发行及交易的债券和资产支持证券、银行间市场发行及交易的债券和资产支持证券、可交换债、可转债、银行间市场发行及交易的资产支持票据、央行票据、短期融资券、中期票据、非金融企业债务融资工具、债券正回购、债券逆回购、现金、银行存款（包括定期存款、协议存款、结构性存款和其他银行存款）、同业存单、公募基金、货币基金、银行及其理财子公司发行的理财产品、证券期货经营机构发行的资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募基金。

2、投资比例

(1) 本计划投资于固定收益类资产的比例为资产管理计划资产总值的 80~100%；

(2) 本计划的总资产占净资产的比例不超过 200%。”

现变更为：



“1、投资方向：本集合计划主要投资于沪深交易所发行、上市的股票（包含上市公司非公开发行股票、新股申购、股票定增）、港股通标的范围内的股票、沪深交易所发行及上市的存托凭证、融资融券、证券交易所发行及上市的优先股、沪深交易所发行及交易的债券和资产支持证券、银行间市场发行及交易的债券和资产支持证券、可交换债、可转债、银行间市场发行及交易的资产支持票据、央行票据、短期融资券、中期票据、非金融企业债务融资工具、债券正回购、债券逆回购、现金、银行存款（包括定期存款、协议存款、结构性存款和其他银行存款）、同业存单、公募基金、货币基金、银行及其理财子公司发行的理财产品、证券期货经营机构发行的资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募基金。

特别提示：本计划可参与融资融券业务。此类业务具有高杠杆等特点，在放大投资收益的同时也放大了投资风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

2、投资比例

(1)本计划投资于固定收益类资产的比例为资产管理计划资产总值的 80~100%;

(2)本计划的总资产占净资产的比例不超过 200%。”

2、对《合同》第三十三条“资产管理计划财产投资的有关事项”第二项“投资范围及比例”第（一）点“投资范围”作出修改：

原合同约定为：

“1. 本计划的投资范围包括沪深交易所发行、上市的股票（包含上市公司非公开发行股票、新股申购、股票定增）、港股通标的范围内的股票、沪深交易所发行及上市的存托凭证、证券交易所发行及上市的优先股、沪深交易所发行及交易的债券和资产支持证券、银行间市场发行及交易的债券和资产支持证券、可交换债、可转债、银行间市场发行及交易的资产支持票据、央行票据、短期融资券、中期票据、非金融企业债务融资工具、债券正回购、债券逆回购、现金、银行存款（包括定期存款、协议存款、结构性存款和其他银行存款）、同业存单、公募基金、货币基金、银行及其理财子公司发行的理财产品、证券期货经营机构发行的资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募基金。

2. 法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的,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。在履行合同变更程序后,可以变更本合同约定的投资范围。”

现变更为:

“1. 本计划的投资范围包括沪深交易所发行、上市的股票(包含上市公司非公开发行股票、新股申购、股票定增)、港股通标的范围内的股票、沪深交易所发行及上市的存托凭证、融资融券、证券交易所发行及上市的优先股、沪深交易所发行及交易的债券和资产支持证券、银行间市场发行及交易的债券和资产支持证券、可交换债、可转债、银行间市场发行及交易的资产支持票据、央行票据、短期融资券、中期票据、非金融企业债务融资工具、债券正回购、债券逆回购、现金、银行存款(包括定期存款、协议存款、结构性存款和其他银行存款)、同业存单、公募基金、货币基金、银行及其理财子公司发行的理财产品、证券期货经营机构发行的资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募基金。

特别提示: 本计划可参与融资融券业务。此类业务具有高杠杆等特点,在放大投资收益的同时也放大了投资风险,同时还须支付相应的利息和费用,由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

2. 法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的,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。在履行合同变更程序后,可以变更本合同约定的投资范围。”

3、对《合同》第三十九条“资产管理计划的投资经理”作出修改:

原合同约定为:

“一、本合同全体当事人一致同意,本计划投资经理由管理人负责指定。

二、管理人指定本计划投资经理为邹学文、孙逸,详细情况如下:

邹学文,中信期货有限公司投资经理,历任东吴证券债券投资总部投资助理、信用研究员、天风证券上海证券资产管理分公司投资经理、中信期货资产管理中心投资经理。邹学文时具备交易与信用研究经验,长于信用债研究、宏观走势分析,完整的投资训练和投资经验,擅长开发多种固收策略赚取超额收益。

孙逸,复旦大学工商管理硕士,澳洲阿德莱德大学法学会计学学士,澳大利

亚注册会计师。曾任上海立信会计学院讲师，易方达基金行业研究员、投资经理，上海玖歌投资管理有限公司基金经理，上海小鳄资产投资总监、总经理。擅长消费品、医药、传媒以及军工行业研究与投资，2016至2019年连续为客户赚取稳定绝对收益。

本计划投资经理已经取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。”

现变更为：

“一、本合同全体当事人一致同意，本计划投资经理由管理人负责指定。

二、管理人指定本计划投资经理为邹学文、蒋兴达，详细情况如下：

邹学文，中信期货有限公司投资经理，历任东吴证券债券投资总部投资助理、信用研究员、天风证券上海证券资产管理分公司投资经理、中信期货资产管理中心投资经理。邹学文时具备交易与信用研究经验，长于信用债研究、宏观走势分析，完整的投资训练和投资经验，擅长开发多种固收策略赚取超额收益。

蒋兴达，CFA，美国凯斯西储大学财务管理硕士，上海财经大学英语语言学士，曾任东方财富证券股份有限公司资产管理总部投资经理、中信盈时资产管理有限公司投研管理中心投资经理，具有十余年A股及美股、港股投资经验，对投资有较为深刻的理解，投资风格稳健，擅长仓位控制和风险管理，以宏观多空的视角上下结合，寻找确定性投资机会。

本计划投资经理已经取得基金从业资格，专职于中信期货有限公司，除在中信期货有限公司任职之外，不存在其他兼职情形。最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

三、委托人退出方案的安排

根据《合同》约定，本计划将于2020年11月09日设立临时开放日接受委托人的赎回申请，如委托人不同意本次合同变更可在临时开放日申请退出本资产管理计划，管理人将受理委托人的退出申请，并为委托人办理退出业务。委托人没有办理退出申请的，视为委托人同意变更。

四、合同变更的效力

本次合同变更于2020年11月10日生效。根据《合同》的约定，合同变更生效后，变更内容自动成为《合同》的组成部分，具有同等法律效力，委托人、管理人和托管人应当按照变更后的《合同》行使相关权利，履行相应义务。

中信期货有限公司

2020年11月05日

