

关于第一创业可转债灵活配置 1 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，中国银行股份有限公司深圳市分行作为托管人的第一创业可转债灵活配置 1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2020 年 7 月 29 日成立。管理人决定对《第一创业可转债灵活配置 1 号集合资产管理计划资产管理合同》、《第一创业可转债灵活配置 1 号集合资产管理计划说明书》和《第一创业可转债灵活配置 1 号集合资产管理计划风险揭示书》进行变更。本次合同变更的具体内容详见附件。

本计划变更事宜已经获得托管人中国银行股份有限公司深圳市分行的书面同意确认。委托人不同意本次合同变更的应在 2021 年 9 月 9 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 2021 年 9 月 9 日，若同意上述变更的委托人数量不少于 2 人（含 2 人），则 2021 年 9 月 10 日为合同变更生效日；若同意上述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：第一创业可转债灵活配置 1 号集合资产管理计划资产管理合同变更对照表

附件 2：第一创业可转债灵活配置 1 号集合资产管理计划说明书变更对照表

附件 3：第一创业可转债灵活配置 1 号集合资产管理计划风险揭示书变更对照表

第一创业证券股份有限公司

2021 年 9 月 8 日

附件 1：第一创业可转债灵活配置 1 号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、当事人及权利义务”	(二) 管理人 机构名称：第一创业证券股份有限公司 法定代表人：刘学民 住所地：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 通讯地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 邮政编码：518046 联系人：徐廷怡 联系电话：0755-23838276 (三) 托管人 机构名称：中国银行股份有限公司深圳市分行 法定代表人/负责人：姚华明 住所地：深圳市罗湖区建设路 2022 号国际金融大厦 通讯地址：深圳市罗湖区宝安南路宝丽大厦二楼 邮政编码：518000 联系人：邱俊华 联系电话：22330495/18988764979	(二) 管理人 机构名称：第一创业证券股份有限公司 法定代表人：刘学民 住所地：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼 通讯地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 3B 层 邮政编码：518046 联系人：廖冰洁 联系电话：0755-23838271 (三) 托管人 机构名称：中国银行股份有限公司深圳市分行 法定代表人/负责人：刘信群 住所地：深圳市罗湖区建设路 2022 号国际金融大厦 通讯地址：深圳市罗湖区宝安南路宝丽大厦二楼 邮政编码：518000 联系人：邱俊华 联系电话：22330495/18988764979
2	“四、当事人及权利义务”	(七) 托管人的权利与义务 2、托管人的义务 (1) 安全保管本计划财产； (2) 除依据法律法规规定和本	(七) 托管人的权利与义务 2、托管人的义务 (1) 安全保管本计划财产； (2) 除依据法律法规规定和本

	合同的约定外,不得为托管人及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管本计划财产; (3) 对所托管的不同财产分别设置账户,确保本计划财产的完整与独立; (4) 公平对待所托管的不同财产,不得从事任何有损本计划财产及其他当事人利益的活动; (5) 按规定开立和注销本计划的托管账户及其他投资所需账户; (6) 复核本计划资产净值和份额净值; (7) 办理与本计划托管业务有关的信息披露事项; (8) 根据相关法律法规和本合同约定,复核管理人编制的本计划财产的定期报告,并出具书面意见; (9) 编制托管年度报告,并向基金业协会备案,抄报管理人所在地中国证监会派出机构; (10) 按照法律法规要求和本合同约定,根据管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜; (11) 保守商业秘密,除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外,不得向他人泄露; (12) 根据法律法规和中国证监会的规定保存本计划的会计账册,妥	合同的约定外,不得为托管人及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管本计划财产; (3) 对所托管的不同财产分别设置账户,确保本计划财产的完整与独立; (4) 公平对待所托管的不同财产,不得从事任何有损本计划财产及其他当事人利益的活动; (5) 按规定开立和注销本计划的托管账户及其他投资所需账户; (6) 复核本计划资产净值和份额净值; (7) 办理与本计划托管业务有关的信息披露事项; (8) 根据相关法律法规和本合同约定,复核管理人编制的本计划财产的定期报告,并出具书面意见; (9) 编制托管年度报告,并抄报管理人所在地中国证监会派出机构; (10) 按照法律法规要求和本合同约定,根据管理人的投资指令,及时办理清算、交割事宜; (11) 保守商业秘密,除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外,不得向他人泄露; (12) 根据法律法规和中国证监会的规定保存本计划的会计账册,
--	---	---

		善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自本计划终止之日起不得少于 20 年； （13）监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会； （14）应当向管理人提供其控股股东、实际控制人及其他关联方的名单，托管人应当保证该名单的真实性、准确性和完整性，若该名单发生变更时，托管人应及时书面通知管理人； （15）国家有关法律法规、监管机构规定的和本合同约定的其他义务。	妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自本计划终止之日起不得少于 20 年； （13）监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权及时报告管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会； （14）应当向管理人提供其关联方的信息（具体以托管人公开渠道披露的年报信息为准）； （15）国家有关法律法规、监管机构规定的和本合同约定的其他义务。
3	“五、资产管理计划的基本情况”	（四）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例 3、投资比例 本计划财产投向固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例为资产总值的 80-100%；其中可转债/可交债的市值比例不低于资产总值 30%；权益类资产的投资比例为资产总值的 0%-20%；参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得	（四）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例 3、投资比例 本计划财产投向固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例为资产总值的 80-100%，其中可转债/可交债的市值比例不低于资产总值 20%；权益类资产的投资比例为资产总值的 0%-20%；参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得

		超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。	超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。
4	“十一、资产管理计划的投资”	(二)资产管理计划的投资范围及投资比例 2、资产配置比例 (1) 固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例为资产总值的 80-100%；其中可转债和可交债的市值比例（合并计算）不低于本计划资产净值 30%； (2) 权益类资产的投资比例为资产总值的 0-20%（不含）； (3) 参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。	(二)资产管理计划的投资范围及投资比例 2、资产配置比例 (1) 固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例为资产总值的 80-100%，其中可转债和可交债的市值比例（合并计算）不低于本计划资产净值 20%； (2) 权益类资产的投资比例为资产总值的 0-20%（不含）； (3) 参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。
5	“十一、资产管理计划的投资”	(七)资产管理计划的投资限制及禁止行为 1、为维护委托人的合法权益，本计划的投资限制为： (1) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%，单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资	(七)资产管理计划的投资限制及禁止行为 1、为维护委托人的合法权益，本计划的投资限制为： (1) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%，单一融资主体及其关联方的非标准化资产，视为同一资产合并计算。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资

	品种除外；全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者不包括募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品）且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划，以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划，不受前述关于投资于同一资产的比例限制； （2）本计划参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外； （3）本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%，计算总资产时，应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，中国证监会另有规定的除外； （4）不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于以下情形： 1）投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录； 2）投资项目违反国家环境保护政策要求； 3）通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。	品种除外；全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者不包括募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品）且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭式集合资产管理计划，以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划，不受前述关于投资于同一资产的比例限制； （2）本计划参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外； （3）本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%，计算总资产时，应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产，中国证监会另有规定的除外； （4）本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本计划的总资产，且所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量； （5）长期信用债（除短期融资券、超短期融资券、可转债、可交债之外）的主体评级和债项评级须在 AA 及以上，对于无债项评级的长期
--	---	--

	(5) 不得将本计划财产用于投资房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款或补充流动资金；前述关于“房地产价格上涨过快热点城市”、“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定，以基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第 4 号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准。 (6) 本计划不得直接投资于商业银行信贷资产； (7) 本计划不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保； (8) 本计划不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域； (9) 本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本计划的总资产，且所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量； (10) 长期信用债（除短期融资券、超短期融资券之外）的主体评级	债券以最近一期的跟踪主体评级或担保方主体评级为准；短期融资券主体评级须在 AA 及以上，且债项评级须为 A-1 及以上；超短期融资券只考虑主体评级，且主体评级须在 AA 及以上；所投资非公开定向债务融资工具，只考虑主体评级，主体评级应为 AA 及以上；资产支持证券、资产支持票据只考虑债项评级，且债项评级在 AA 及以上（含）；同业存单只考虑主体评级，主体评级在 AA 及以上（含）； (6) 单一可转可交债持仓市值不超过本计划资产净值 10%； (7) 本计划持有的债券（排除可转债、可交债）组合加权平均久期（按照债券市值加权计算）不超过 5 年； (8) 在满足本计划其他投资限制的基础上，本计划投资于 AA 级的信用债券（排除可转债、可交债）持仓比例不得高于本计划资产总值的 50%，且投资于 AA-级（含）以下评级的可转债、可交债合计持仓比例不超过 30%，认定方法如下： 1) 对于短期融资券、超短期融资券、同业存单、非公开定向债务融资工具，以主体评级为准； 2) 资产支持证券和资产支持票
--	--	--

	和债项评级须在 AA 及以上，对于无债项评级的长期债券以最近一期的跟踪主体评级或担保方主体评级为准；短期融资券主体评级须在 AA 及以上，且债项评级须为 A-1 及以上；超短期融资券只考虑主体评级，且主体评级须在 AA 及以上；所投资非公开定向债务融资工具，只考虑主体评级，主体评级应为 AA 及以上；资产支持证券、资产支持票据只考虑债项评级，且债项评级在 AA 及以上（含）；同业存单只考虑主体评级，主体评级在 AA 及以上（含）； （11）单一可转可交债持仓市值不超过本计划资产净值 10%； （12）本计划持有的债券（排除可转债、可交债）组合加权平均久期（按照债券市值加权计算）不超过 5 年； （13）在满足本计划其他投资限制的基础上，本计划投资于 AA 级及以下评级的信用债券持仓比例不得高于本计划资产总值的 40%，认定方法如下： 1）对于短期融资券、超短期融资券、同业存单、非公开定向债务融资工具，以主体评级为准； 2）资产支持证券和资产支持票据，以债项评级为准；	据，以债项评级为准； 3）其他债券，以债项评级为准，无债项评级的，以发行主体评级或担保方评级为准； 4）既无债项评级也无主体评级的债券，认定其为评级 AA 级以下债券； （9）现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。 以上认可的评级机构包括联合资信评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、中诚信证券评估有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、大公国际资信评估有限公司、东方金诚国际信用评估有限公司、鹏元资信评估有限公司等（中债资信评估有限责任公司除外），只要认可的任一评级公司出具的评级意见符合上述评级要求即可投资。 2、禁止行为 本计划的禁止行为包括： （1）违规将本计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担
--	---	---

	3) 其他债券, 以债项评级为准, 无债项评级的, 以发行主体评级或担保方评级为准; 4) 既无债项评级也无主体评级的债券, 认定其为评级 AA 级以下债券; (14) 现行有关法律法规修订变化后, 若上述投资限制与之产生抵触, 应以有关法律法规规定为准, 同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容; 如法律法规或监管部门修改或取消上述限制, 履行适当程序后, 本计划可相应调整投资组合限制的规定。 以上认可的评级机构包括联合资信评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、中诚信证券评估有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、大公国际资信评估有限公司、东方金诚国际信用评估有限公司、鹏元资信评估有限公司等(中债资信评估有限责任公司除外), 只要认可的任一评级公司出具的评级意见符合上述评级要求即可投资。 2、禁止行为 本计划的禁止行为包括: (1) 违规将本计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途;	保等用途; (2) 将本计划资产用于可能承担无限责任的投资; (3) 向委托人做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺; (4) 侵占、挪用本计划资产; (5) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营; (6) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额; (7) 以获取佣金或者其他不当利益为目的, 使用本计划资产进行不必要的交易; (8) 内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为; (9) 为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利; (10) 利用本计划进行商业贿赂; (11) 利用本计划或者职务便利为委托人以外的第三方谋取不正当利益; (12) 直接或者间接向委托人返还管理费; (13) 不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目(证券市场投资除外), 包括但不限于以下
--	--	--

	(2) 将本计划资产用于可能承担无限责任的投资； (3) 向委托人做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺； (4) 侵占、挪用本计划资产； (5) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营； (6) 接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额； (7) 以获取佣金或者其他不当利益为目的，使用本计划资产进行不必要的交易； (8) 内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为； (9) 为违法或者规避监管的证券期货业务活动提供交易便利； (10) 利用本计划进行商业贿赂； (11) 利用本计划或者职务便利为委托人以外的第三方谋取不正当利益； (12) 直接或者间接向委托人返还管理费； (13) 法律法规和中国证监会禁止的其他行为。	情形： 1) 投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录； 2) 投资项目违反国家环境保护政策要求； 3) 通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。 (14) 不得将本计划财产用于投资房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款或补充流动资金；前述关于“房地产价格上涨过快热点城市”、“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定，以基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第 4 号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准。 (15) 本计划不得直接投资于商业银行信贷资产； (16) 本计划不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保； (17) 本计划不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域； (18) 法律法规和中国证监会禁
--	--	--

			止的其他行为。
6	“十七、投资指令的发送、确认和执行”	(四) 托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序 托管人发现管理人发送的指令违反法律法规规定或本合同约定的, 应当要求改正, 未能改正的, 应当拒绝执行, 并应及时以书面形式通知管理人并向管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会报告。托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定或本合同约定的, 应及时以书面形式通知管理人并向管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会报告。	(四) 托管人依法暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序 托管人发现管理人发送的指令违反法律法规规定或本合同约定的, 应当要求改正, 未能改正的, 应当拒绝执行, 并应及时以书面形式通知管理人并有权向管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会报告。托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定或本合同约定的, 应及时以书面形式通知管理人并有权向管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会报告。
7	“十九、越权交易的界定”	(二) 越权交易的处理程序 1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为 托管人对于越权交易, 发现管理人的投资指令违反法律法规的规定, 或者违反本合同约定的, 应当拒绝执行并立即要求管理人改正; 未能改正或者造成本计划财产损失的, 托管人应当及时通知管理人并报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会。 根据交易规则, 托管人只能在事后发现的越权交易, 托管人应当立即通知管理人, 管理人在收到通知后应	(二) 越权交易的处理程序 1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为 托管人对于越权交易, 发现管理人的投资指令违反法律法规的规定, 或者违反本合同约定的, 应当拒绝执行并及时通知管理人; 未能改正或者造成本计划财产损失的, 托管人应当及时通知管理人并有权报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会。 根据交易规则, 托管人只能在事后发现的越权交易, 托管人应当立即通知管理人并有权报告管理人住所

		当及时核对或纠正。 管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会。	地中国证监会派出机构，管理人在收到通知后应当及时核对或纠正。 管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权报告管理人住所地中国证监会派出机构。
8	“十九、越权交易的界定”	(三)托管人对管理人投资运作的监督 1、对本合同约定的投资范围按照如下标准进行监督： 本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、现金类资产、权益类资产及中国证监会认可的其他投资品种： (1) 现金类资产：包括现金、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； (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交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、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	(三)托管人对管理人投资运作的监督 1、对本合同约定的投资范围按照如下标准进行监督： 本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、现金类资产、权益类资产及中国证监会认可的其他投资品种： (1) 现金类资产：包括现金、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； (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交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、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)、同业存单、可转换债(含可分离交易的可转债,可转股)、可交换债(含可交换私募债,可换股)、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)等; (3) 权益类资产:国内依法发行并在证券交易所交易的股票(含可转债/可交债转股、主板、中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票,含且不限于二级市场股票、新股发行、股票增发等)、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; (4)本计划可参与债券回购(含正回购、逆回购)交易。 2、对本计划以下投资比例和投资限制进行监督: (1) 固定收益类资产(含现金类资产)的投资比例为资产总值的	资本债)、同业存单、可转换债(含可分离交易的可转债,可转股)、可交换债(含可交换私募债,可换股)、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)等; (3) 权益类资产:国内依法发行并在证券交易所交易的股票(含可转债/可交债转股、主板、中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票,含且不限于二级市场股票、新股发行、股票增发等)、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; (4)本计划可参与债券回购(含正回购、逆回购)交易。 2、对本计划以下投资比例和投资限制进行监督: (1) 固定收益类资产(含现金类资产)的投资比例为资产总值的
--	---	---

	80-100%；其中可转债和可交债的市值比例（合并计算）不低于本计划资产净值 30%； （2）权益类资产的投资比例为资产总值的 0-20%（不含）； （3）本集合计划参与证券正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%，中国证监会另有规定的除外； （3）长期信用债（除短期融资券、超短期融资券之外）的主体评级和债项评级须在 AA 及以上，对于无债项评级的长期债券以最近一期的跟踪主体评级或担保方主体评级为准；短期融资券主体评级须在 AA 及以上，且债项评级须为 A-1 及以上；超短期融资券只考虑主体评级，且主体评级须在 AA 及以上；所投资非公开定向债务融资工具，只考虑主体评级，主体评级应为 AA 及以上；资产支持证券、资产支持票据只考虑债项评级，且债项评级在 AA 及以上（含）；同业存单只考虑主体评级，主体评级在 AA 及以上（含）； 以上认可的评级机构包括联合资信评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、中诚信证券评估有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、东方金诚国际信用评估有限	80-100%，其中可转债和可交债的市值比例（合并计算）不低于本计划资产净值 20%； （2）权益类资产的投资比例为资产总值的 0-20%（不含）； （3）本集合计划参与证券正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%，中国证监会另有规定的除外； （4）长期信用债（除短期融资券、超短期融资券、可转债、可交债之外）的主体评级和债项评级须在 AA 及以上；短期融资券主体评级须在 AA 及以上，且债项评级须为 A-1 及以上；超短期融资券只考虑主体评级，且主体评级须在 AA 及以上；所投资非公开定向债务融资工具，只考虑主体评级，主体评级应为 AA 及以上；资产支持证券、资产支持票据只考虑债项评级，且债项评级在 AA 及以上（含）；同业存单只考虑主体评级，主体评级在 AA 及以上（含）； 以上认可的评级机构包括联合资信评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、中诚信证券评估有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、大公国际资信评估有限公司、东方金诚国际信用评估有限
--	--	--

		服务有限公司、大公国际资信评估有限公司、东方金诚国际信用评估有限公司、鹏元资信评估有限公司等（中债资信评估有限责任公司除外），只要认可的任一评级公司出具的评级意见符合上述评级要求即可投资。 （4）单一可转可交债持仓市值不超过本计划资产净值 10%； （5）在满足本计划其他投资限制条款的基础上，本计划投资于 AA 级及以下评级的信用债券持仓比例不得高于本计划资产总值的 40%，认定方法如下： 1）对于短期融资券、超短期融资券、同业存单、非公开定向债务融资工具，以主体评级为准； 2）资产支持证券和资产支持票据，以债项评级为准； 3）其他债券，以债项评级为准，无债项评级的，以发行主体评级或担保方评级为准； 4）既无债项评级也无主体评级的债券，认定其为评级 AA 级以下债券。	公司、鹏元资信评估有限公司等（中债资信评估有限责任公司除外），只要认可的任一评级公司出具的评级意见符合上述评级要求即可投资。 （5）单一可转可交债持仓市值不超过本计划资产净值 10%； （6）在满足本计划其他投资限制条款的基础上，本计划投资于 AA 级的信用债券（排除可转债、可交债）持仓比例不得高于本计划资产总值的 50%，且投资于 AA-级（含）以下评级的可转债、可交债合计持仓比例不超过 30%，认定方法如下： 1）对于短期融资券、超短期融资券、同业存单、非公开定向债务融资工具，以主体评级为准； 2）资产支持证券和资产支持票据，以债项评级为准； 3）其他债券，以债项评级为准，无债项评级的，以发行主体评级或担保方评级为准； 4）既无债项评级也无主体评级的债券，认定其为评级 AA 级以下债券。
9	“二十四、风险揭示”	（一） 特殊风险揭示 5、其他特殊风险 （5）管理人灵活配置可转债（或可交换债）的风险 本计划投资于可转债和可交换	（二） 特殊风险揭示 5、其他特殊风险 （5）管理人灵活配置可转债（或可交换债）的风险 本计划投资于可转债和可交换

		债的市值比例不低于资产总值的30%，管理人可根据市场的情况灵活选择可转债和可交换债的投资比例。 因经济运行周期性波动及债券品种收益水平变化，以及管理人对于国家货币政策、财政政策、产业政策等的认知导致本计划投向可转债(或可交换债)仓位的变化可能对本计划收益水平产生影响。	债的市值比例不低于资产总值的20%，管理人可根据市场的情况灵活选择可转债和可交换债的投资比例。 因经济运行周期性波动及债券品种收益水平变化，以及管理人对于国家货币政策、财政政策、产业政策等的认知导致本计划投向可转债(或可交换债)仓位的变化可能对本计划收益水平产生影响。
10	“二十四、风险揭示”	(二) 一般风险揭示 9、本计划提前终止的风险 本计划运作期间，当本计划委托人少于 2 人或者其他本计划约定的提前终止情形出现时，导致集合计划提前终止的风险。	(二) 一般风险揭示 9、本计划提前终止的风险 本计划运作期间，当本计划委托人少于 2 人或者其他本计划约定的提前终止情形出现时，导致集合计划提前终止的风险。 此外，根据产品的运作情况，管理人有权提前终止本计划，从而导致本计划委托人本金和收益损失的风险。
11	“二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算”	(四) 资产管理计划的终止 有下列情形之一的，本计划应当终止： 1、本计划存续期届满且不展期； 2、经全体委托人、管理人和托管人协商一致决定终止的； 3、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；	(四) 资产管理计划的终止 有下列情形之一的，本计划应当终止： 1、本计划存续期届满且不展期； 2、经全体委托人、管理人和托管人协商一致决定终止的； 3、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；

	4、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,且在六个月内没有新的托管人承接; 5、本计划存续期间,持续5个工作日委托人少于2人; 6、本计划成立后,未在基金业协会完成备案或未通过基金业协会的产品备案或未取得产品的备案确认函的,则管理人有权终止本计划,且不承担任何责任; 7、不可抗力力的发生导致本计划不能存续; 8、因监管政策或监管规则的变化导致本产品违反相关监管政策或监管规则要求的,或监管机构通知(无论是口头或书面形式的通知)管理人停止开展此类资产管理产品的,则管理人有权停止开放本计划份额的参与并终止本计划,且不承担任何责任; 9、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。 管理人应当自本计划终止之日起5个工作日内报基金业协会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出机构,前述第7项约定的情形除外。	4、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产,且在六个月内没有新的托管人承接; 5、本计划存续期间,持续5个工作日委托人少于2人; 6、本计划成立后,未在基金业协会完成备案或未通过基金业协会的产品备案或未取得产品的备案确认函的,则管理人有权终止本计划,且不承担任何责任; 7、不可抗力力的发生导致本计划不能存续; 8、因监管政策或监管规则的变化导致本产品违反相关监管政策或监管规则要求的,或监管机构通知(无论是口头或书面形式的通知)管理人停止开展此类资产管理产品的,则管理人有权停止开放本计划份额的参与并终止本计划,且不承担任何责任; 9、管理人有权根据产品的运作情况决定提前终止本计划; 10、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。 管理人应当自本计划终止之日起5个工作日内报基金业协会备案并抄报管理人住所地中国证监会派出机构,前述第7项约定的情形除
--	--	---

			外。
--	--	--	----

附件 2：第一创业可转债灵活配置 1 号集合资产管理计划说明书变更对照表

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
1	“投资范围及比例”	1、投资范围 本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、现金类资产、权益类资产及中国证监会认可的其他投资品种： （1）现金类资产：包括现金、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； （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交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、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）、同业存单、可转换债（含可分离交易的可转债，可转股）、可交换债（含可交换私募债，可换股）、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	1、投资范围 本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、现金类资产、权益类资产及中国证监会认可的其他投资品种： （1）现金类资产：包括现金、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； （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交易的国债、中央银行票据、政策性金融债、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）、同业存单、可转换债（含可分离交易的可转债，可转股）、可交换债（含可交换私募债，可换股）、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）等； （3）权益类资产：国内依法发行并在证券交易所交易的股票（含可转债/可交债转股、主板、中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票，含且不限于二级市场股票、新股发行、股票增发等）、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； （4）本计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）交易。 2、资产配置比例 （1）固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例为资产总值的 80-100%；其中可转债和可交债的市值比例（合并计算）不低于本计划资产净值 30%； （2）权益类资产的投资比例为资产总值的 0-20%（不含）； （3）参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。 如因证券期货市场波动、证券发	务融资工具（PPN）等； （3）权益类资产：国内依法发行并在证券交易所交易的股票（含可转债/可交债转股、主板、中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准/注册上市的 A 股股票，含且不限于二级市场股票、新股发行、股票增发等）、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； （4）本计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）交易。 2、资产配置比例 （1）固定收益类资产（含现金类资产）的投资比例为资产总值的 80-100%，其中可转债和可交债的市值比例（合并计算）不低于本计划资产净值 20%； （2）权益类资产的投资比例为资产总值的 0-20%（不含）； （3）参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%，中国证监会另有规定的除外。 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。	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。
2	“投资限制”	为维护委托人的合法权益,本计划的投资限制为: (1) 本计划投资于同一资产的资金,不得超过本计划资产净值的 25%; 管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金,不得超过该资产的 25%, 单一融资主体及其关联方的非标准化资产,视为同一资产合并计算。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外; 全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者(专业投资者不包括募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品)且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封	为维护委托人的合法权益, 本计划的投资限制为: (1) 本计划投资于同一资产的资金,不得超过本计划资产净值的 25%; 管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金,不得超过该资产的 25%, 单一融资主体及其关联方的非标准化资产,视为同一资产合并计算。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外; 全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者(专业投资者不包括募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品)且单个投资者投资金额不低于 1000 万元的封闭

	闭式集合资产管理计划,以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划,不受前述关于投资于同一资产的比例限制。 (2) 本计划参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%, 中国证监会另有规定的除外; (3) 本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%, 计算总资产时,应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产,中国证监会另有规定的除外; (4) 不得投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目(证券市场投资除外),包括但不限于以下情形: 1) 投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录; 2) 投资项目违反国家环境保护政策要求; 3) 通过穿透核查,资产管理计划最终投向上述投资项目。 (5) 不得将本计划财产用于投资房地产价格上涨过快热点城市普通住宅地产项目或用于支付土地出让价款或补充流动资金;前述关于“房地产价格上涨过快热点城市”、	式集合资产管理计划,以及完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的资产管理计划等中国证监会认可的其他集合资产管理计划,不受前述关于投资于同一资产的比例限制; (2) 本计划参与证券正回购融入资金余额或逆回购资金余额不得超过本计划上一日资产净值的 100%, 中国证监会另有规定的除外; (3) 本计划总资产不得超过本计划资产净值的 200%, 计算总资产时,应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产,中国证监会另有规定的除外; (4) 本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时,所申报的金额不得超过本计划的总资产,且所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量; (5) 长期信用债(除短期融资券、超短期融资券、可转债、可交债之外)的主体评级和债项评级须在 AA 及以上,对于无债项评级的长期债券以最近一期的跟踪主体评级或担保方主体评级为准;短期融资券主体评级须在 AA 及以上,且债项评级须为 A-1 及以上;超短期融资券只考虑主体评级,且主体评级须在 AA 及以上;所
--	---	---

	“普通住宅地产项目”、“房地产开发企业”之认定，以基金业协会《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理规范第4号——私募资产管理计划投资房地产开发企业、项目》及其不时做出的修订和补充之规定为准。 (6) 本计划不得直接投资于商业银行信贷资产； (7) 本计划不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保； (8) 本计划不得直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资的行业和领域； (9) 本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本计划的总资产，且所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量； (10) 长期信用债（除短期融资券、超短期融资券之外）的主体评级和债项评级须在 AA 及以上，对于无债项评级的长期债券以最近一期的跟踪主体评级或担保方主体评级为准；短期融资券主体评级须在 AA 及以上，且债项评级须为 A-1 及以上；	投资非公开定向债务融资工具，只考虑主体评级，主体评级应为 AA 及以上；资产支持证券、资产支持票据只考虑债项评级，且债项评级在 AA 及以上（含）；同业存单只考虑主体评级，主体评级在 AA 及以上（含）； (6) 单一可转可交债持仓市值不超过本计划资产净值 10%； (7) 本计划持有的债券（排除可转债、可交债）组合加权平均久期（按照债券市值加权计算）不超过 5 年； (8) 在满足本计划其他投资限制的基础上，本计划投资于 AA 级的信用债券（排除可转债、可交债）持仓比例不得高于本计划资产总值的 50%，且投资于 AA-级（含）以下评级的可转债、可交债合计持仓比例不超过 30%，认定方法如下： 1) 对于短期融资券、超短期融资券、同业存单、非公开定向债务融资工具，以主体评级为准； 2) 资产支持证券和资产支持票据，以债项评级为准； 3) 其他债券，以债项评级为准，无债项评级的，以发行主体评级或担保方评级为准； 4) 既无债项评级也无主体评级的债券，认定其为评级 AA 级以下债券； (9) 现行有关法律法规修订变化
--	---	--

	超短期融资券只考虑主体评级,且主体评级须在 AA 及以上;所投资非公开定向债务融资工具,只考虑主体评级,主体评级应为 AA 及以上;资产支持证券、资产支持票据只考虑债项评级,且债项评级在 AA 及以上(含);同业存单只考虑主体评级,主体评级在 AA 及以上(含); (11) 单一可转可交债持仓市值不超过本计划资产净值 10%; (12) 本计划持有的债券(排除可转债、可交债)组合加权平均久期(按照债券市值加权计算)不超过 5 年; (13) 在满足本计划其他投资限制的基础上,本计划投资于 AA 级及以下评级的信用债券持仓比例不得高于本计划资产总值的 40%,认定方法如下: 1) 对于短期融资券、超短期融资券、同业存单、非公开定向债务融资工具,以主体评级为准; 2) 资产支持证券和资产支持票据,以债项评级为准; 3) 其他债券,以债项评级为准,无债项评级的,以发行主体评级或担保方评级为准; 4) 既无债项评级也无主体评级的债券,认定其为评级 AA 级以下债	后,若上述投资限制与之产生抵触,应以有关法律法规规定为准,同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容;如法律法规或监管部门修改或取消上述限制,履行适当程序后,本计划可相应调整投资组合限制的规定。 以上认可的评级机构包括联合资信评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、中诚信证券评估有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、大公国际资信评估有限公司、东方金诚国际信用评级有限公司、鹏元资信评估有限公司等(中债资信评估有限责任公司除外),只要认可的任一评级公司出具的评级意见符合上述评级要求即可投资。
--	---	---

		券； (14) 现行有关法律法规修订变化后，若上述投资限制与之产生抵触，应以有关法律法规规定为准，同时管理人应通过合同变更的形式明确相应修订内容；如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本计划可相应调整投资组合限制的规定。 以上认可的评级机构包括联合资信评估有限公司、中诚信国际信用评级有限责任公司、中诚信证券评估有限公司、上海新世纪资信评估投资服务有限公司、大公国际资信评估有限公司、东方金诚国际信用评估有限公司、鹏元资信评估有限公司等（中债资信评估有限责任公司除外），只要认可的任一评级公司出具的评级意见符合上述评级要求即可投资。	
--	--	--	--

附件 3：第一创业可转债灵活配置 1 号集合资产管理计划风险揭示书变更对照表

序号	位置	原风险揭示书	变更后风险揭示书
1	“(一)”	5、其他特殊风险	5、其他特殊风险

	特殊风险揭示”	(5)管理人灵活配置可转债(或可交换债)的风险 本计划投资于可转债和可交换债的市值比例不低于资产总值的30%，管理人可根据市场的情况灵活选择可转债和可交换债的投资比例。因经济运行周期性波动及债券品种收益水平变化，以及管理人对于国家货币政策、财政政策、产业政策等的认知导致本计划投向可转债(或可交换债)仓位的变化可能对本计划收益水平产生影响。	(5)管理人灵活配置可转债(或可交换债)的风险 本计划投资于可转债和可交换债的市值比例不低于资产总值的20%，管理人可根据市场的情况灵活选择可转债和可交换债的投资比例。因经济运行周期性波动及债券品种收益水平变化，以及管理人对于国家货币政策、财政政策、产业政策等的认知导致本计划投向可转债(或可交换债)仓位的变化可能对本计划收益水平产生影响。
2	“(二)一般风险揭示”	9、本计划提前终止的风险 本计划运作期间，当本计划委托人少于 2 人或者其他本计划约定的提前终止情形出现时，导致集合计划提前终止的风险。	9、本计划提前终止的风险 本计划运作期间，当本计划委托人少于 2 人或者其他本计划约定的提前终止情形出现时，导致集合计划提前终止的风险。 此外，根据产品的运作情况，管理人有权提前终止本计划，从而导致本计划委托人本金和收益损失的风险。