

关于第一创业中证 500 指数增强 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中证 500 指数增强 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2020 年 12 月 29 日成立。为满足客户需求，拟对《第一创业中证 500 指数增强 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》、《第一创业中证 500 指数增强 FOF1 号集合资产管理计划说明书》及《第一创业中证 500 指数增强 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书》进行变更，详细内容请见本公告附件。

为保护委托人的利益，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 2022 年 7 月 15 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 2022 年 7 月 15 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 2022 年 7 月 20 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：第一创业中证 500 指数增强 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同变更明细表

附件 2：第一创业中证 500 指数增强 FOF1 号集合资产管理计划说明书变更明细表

附件 3：第一创业中证 500 指数增强 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书变更明细表

第一创业证券股份有限公司

2022 年 7 月 11 日



附件 1：第一创业中证 500 指数增强 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 | 四、 当事人及 权利义务 | <p>(二) 管理人</p> <p>机构名称：第一创业证券股份 有限公司</p> <p>法定代表人：刘学民</p> <p>住所地：深圳市福田区福华一 路 115 号投行大厦 20 楼</p> <p>通讯地址：深圳市福田区福华 一路 115 号投行大厦 3B 楼</p> <p>邮政编码：518046</p> <p>联系人：张莫晨</p> <p>联系电话：0755-23838275</p> | <p>(二) 管理人</p> <p>机构名称：第一创业证券股份 有限公司</p> <p>法定代表人：刘学民</p> <p>住所地：深圳市福田区福华一 路 115 号投行大厦 20 楼</p> <p>通讯地址：深圳市福田区福华 一路 115 号投行大厦 3B 楼</p> <p>邮政编码：518046</p> <p>联系人：宋焱</p> <p>联系电话：0755-23838738</p> |
| 2 | 五、 资产 管理 计划 的基 本情 况 | <p>(五) 资产管理计划的投资目 标、主要投资方向、投资比例</p> <p>2、本计划的投资方向为：</p> <p>(1) 资产管理产品：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、 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、银行 非保本理财产品及其他金融监管部 门批准或备案发行的资产管理产 品；</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 计划投资于资产管理产品的比例不</p> | <p>(五) 资产管理计划的投资目 标、主要投资方向、投资比例</p> <p>2、本计划的投资方向为：</p> <p>(1) 资产管理产品：公募证券 投资基金（包含货币市场基金）、 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、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、银行非保 本理财产品及其他金融监管部门 批准或备案发行的资产管理产品；</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) 衍生品类资产：沪深交易 所及期货交易所上市的期权及期</p> |

| | | |
|---|--|--|
| | <p>低于资产总值的 80%；并通过投向资产管理产品进行以下比例的资产配置：</p> <p>（1）权益类资产的投资比例不低于资产总值的 80%；</p> <p>（2）固定收益类资产与现金类资产的投资比例不高于资产总值的 20%；</p> <p>（3）商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。</p> | <p>货。</p> <p>3、本计划的投资比例为：本计划投资于资产管理产品的比例不低于资产总值的 80%；直接或通过投向资产管理产品进行以下比例的资产配置：</p> <p>（1）权益类资产的投资比例不低于资产总值的 80%；</p> <p>（2）固定收益类资产与现金类资产的投资比例不高于资产总值的 20%；</p> <p>（3）商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。</p> |
| 3 | <p>十一、资产管理计划的投资</p> <p>（二）资产管理计划的投资范围及投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>（1）资产管理产品：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、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、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品；</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>（二）资产管理计划的投资范围及投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>（1）资产管理产品：公募证券投资基金（包含货币市场基金）、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、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、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品；</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>本计划投资于资产管理产品的比例不低于资产总值的 80%，并通过投向资产管理产品进行以下比例的资产配置：</p> <p>（1）权益类资产的投资比例不低于资产总值的 80%；</p> <p>（2）固定收益类资产与现金类资产的投资比例不高于资产总值的 20%；</p> <p>（3）商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。</p> | <p>（3）衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划投资于资产管理产品的比例不低于资产总值的 80%，直接或通过投向资产管理产品进行以下比例的资产配置：</p> <p>（1）权益类资产的投资比例不低于资产总值的 80%；</p> <p>（2）固定收益类资产与现金类资产的投资比例不高于资产总值的 20%；</p> <p>（3）商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。</p> |
| 4 | 十八、交易及交收清算安排 | <p>本计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由托管人负责办理。资金清算为场外投资的，托管人凭投资指令和相关投资文件进行资金划拨。本计划证券投资的清算交割，由托管人通过中央结算公司、上清所、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。</p> <p>（一）交易所市场资金清算</p> <p>1、交易所市场交易的资金清算由托管人根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司的清算数据办理。本计划证券投资的清算交割，由托管人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分</p> | <p>本计划投资于证券发生的所有场内、场外交易的资金清算交割，全部由托管人负责办理；本计划投资于场内期权交易的资金清算交割，由管理人负责办理，投资于期货发生的资金交割清算由管理人选定的期货经纪公司负责办理。资金清算为场外投资的，托管人凭投资指令和相关投资文件进行资金划拨。本计划证券投资的清算交割，由托管人通过中央结算公司、上清所、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。</p> <p>（一）交易所市场资金清算</p> <p>1、交易所市场交易的资金清算交割（除场内期货期权交易外）由</p> |

| | | |
|----------|---|---|
| | <p>公司/深圳分公司及清算代理银行办理。</p> | <p>托管人根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司的清算数据办理。本计划证券投资的清算交割，由托管人通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司及清算代理银行办理。本计划投资于场内期权交易的资金清算交割，由管理人负责办理，投资于期货发生的资金交割清算由管理人选定的期货经纪公司负责办理。</p> |
| <p>5</p> | <p>二十、资产管理计划财产的估值和会计核算</p> <p>(一) 资产管理计划财产的估值</p> <p>3、估值方法</p> <p>估值应符合《企业会计准则》、《指导意见》、本合同及其他相关法律法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。</p> <p>(1) 公募证券投资基金估值方法</p> <p>1) 持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估</p> | <p>(一) 资产管理计划财产的估值</p> <p>3、估值方法</p> <p>估值应符合《企业会计准则》、《指导意见》、本合同及其他相关法律法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。</p> <p>(1) 公募证券投资基金估值方法</p> <p>1) 持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p> <p>2) 持有的场外基金(包括托管</p> |

| | | |
|--|---|--|
| | <p>值。</p> <p>2) 持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日的基金份额净值估值；估值日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。</p> <p>3) 持有的货币市场基金，按成本估值，按估值日基金管理公司的每万份收益计算。</p> <p>4) 持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的，按照前述第 1) 项约定的交易所基金的估值方法估值；不能在交易所交易的，按照前述本款第 2) 项约定的场外基金的估值方法估值。</p> <p>5) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。</p> <p>(2) 银行定期存款或通知存款估值方法</p> <p>银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。</p> <p>(3) 持有的资产管理产品（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、银行非保本理</p> | <p>在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日的基金份额净值估值；估值日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。</p> <p>3) 持有的货币市场基金，按成本估值，按估值日基金管理公司的每万份收益计算。</p> <p>4) 持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的，按照前述第 1) 项约定的交易所基金的估值方法估值；不能在交易所交易的，按照前述本款第 2) 项约定的场外基金的估值方法估值。</p> <p>5) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。</p> <p>(2) 银行定期存款或通知存款估值方法</p> <p>银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。</p> <p>(3) 持有的公募证券投资基金（含货币基金）以外的其他资产管理产品（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、银行非保本理财产品及其他金融监管部门</p> |
|--|---|--|

| | | |
|--|---|---|
| | <p>财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品), 该资产管理产品的管理人或其委托的估值核算机构定期公布份额净值的, 按照最新公布的份额净值估值 (若该资产管理产品的管理人或其委托的估值核算机构公布净值的同时, 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); 不公布份额净值的, 按照成本估值。如所投资资产管理产品公布的净值错误等管理人和托管人之外的原因, 导致本计划估值错误的, 本计划管理人和托管人予以免责。</p> <p>作为本计划的主会计方, 管理人拟采取虚拟净值作为估值依据的, 可以决定采用: (i) 场外投资标的的托管人或其运营服务机构或管理人最近一次提供的场外标的的虚拟单位净值; 或者 (ii) 由本计划之管理人最近一次自行计算的场外标的的虚拟单位净值, 作为本计划之估值依据。管理人应及时向托管人提供前述虚拟单位净值; 如从未获得前述场外投资标的的虚拟单位净值的, 按场外投资标的的最新的份额净值估值, 如从未获得过前述场外投资标的的份额净值的, 按成本估值。</p> <p>由于场外资产管理产品虚拟净值的真实性、准确性、完整性取决于该等资产管理产品的相关基础数据的真实性、准确性、完整性、及时性等因素, 受限于交互因素, 托</p> | <p>批准或备案发行的资产管理产品), 该资产管理产品的管理人或其委托的估值核算机构定期公布份额净值的, 按照最新公布的份额净值估值 (若该资产管理产品的管理人或其委托的估值核算机构公布净值的同时, 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); 不公布份额净值的, 按照成本估值。如所投资资产管理产品公布的净值错误等管理人和托管人之外的原因, 导致本计划估值错误的, 本计划管理人和托管人予以免责。</p> <p>作为本计划的主会计方, 管理人拟采取虚拟净值作为估值依据的, 可以决定采用: (i) 场外投资标的的托管人或其运营服务机构或管理人最近一次提供的场外标的的虚拟单位净值; 或者 (ii) 由本计划之管理人最近一次自行计算的场外标的的虚拟单位净值, 作为本计划之估值依据。管理人应及时向托管人提供前述虚拟单位净值; 如从未获得前述场外投资标的的虚拟单位净值的, 按场外投资标的的最新的份额净值估值, 如从未获得过前述场外投资标的的的份额净值的, 按成本估值。</p> <p>由于场外资产管理产品虚拟净值的真实性、准确性、完整性取决于该等资产管理产品的相关基础数据的真实性、准确性、完整性、及时性等因素, 受限于交互因素, 托管人仅根据收到的虚拟净值对本计</p> |
|--|---|---|

| | | | |
|---|----------------|---|---|
| | | <p>管人仅根据收到的虚拟净值对本计划进行估值。</p> <p>委托人签署本合同，即表明其已经知晓并认可本计划可采用上述虚拟净值的估值方式。委托人不得因本计划采用虚拟估值方式引起产品净值差异情况，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。</p> <p>(4) 如有新增事项或变更事项，按法律法规、监管规定有关最新规定估值。</p> | <p>划进行估值。</p> <p>委托人签署本合同，即表明其已经知晓并认可本计划可采用上述虚拟净值的估值方式。委托人不得因本计划采用虚拟估值方式引起产品净值差异情况，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。</p> <p>(4) 金融衍生品的估值方法</p> <p>交易所交易的金融衍生品（具体为以下品种：股票期权、股指期货、国债期货、商品期货）按估值日交易所公布的当日结算价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的结算价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>(5) 如有新增事项或变更事项，按法律法规、监管规定有关最新规定估值。</p> |
| 6 | 附件一：托管人投资监督事项表 | <p>1、投资范围</p> <p>(1) 资产管理产品：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、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、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产</p> | <p>1、投资范围</p> <p>(1) 资产管理产品：公募证券投资基金（包含货币市场基金）、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、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、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备</p> |

| | | | |
|---|-------------|---|---|
| | | <p>品；</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、投资比例</p> <p>本计划投资于资产管理产品的比例不低于资产总值的 80%，并通过投向资产管理产品进行以下比例的资产配置：</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例不低于资产总值的 80%；</p> <p>(2) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例不高于资产总值的 20%；</p> <p>(3) 商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。</p> | <p>案发行的资产管理产品；</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) 衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货。</p> <p>2、投资比例</p> <p>本计划投资于资产管理产品的比例不低于资产总值的 80%，直接或通过投向资产管理产品进行以下比例的资产配置：</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例不低于资产总值的 80%；</p> <p>(2) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例不高于资产总值的 20%；</p> <p>(3) 商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%或衍生品账户权益不超过资产总值的 20%。</p> |
| 7 | 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 个工作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</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</p> |

| | | |
|---|--|---|
| | <p>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> | <p>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> |
| 8 | <p>二十四、风险揭示</p> <p>（一）特殊风险揭示</p> <p>7、其他特殊风险</p> <p>（1）投资资产管理产品的风险</p> <p>本集合计划部分资产将配置于以中证 500 指数增强策略等量化策略为主的金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品（包括公募证券投资基金、证券公司集合资产管理</p> | <p>（一）特殊风险揭示</p> <p>7、其他特殊风险</p> <p>（1）投资资产管理产品的风险</p> <p>本集合计划部分资产将配置于以中证 500 指数增强策略等量化策略为主的金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品（包括公募证券投资基金、证券公司集合资产管理</p> |

| | | |
|--|--|---|
| | <p>理计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品), 投资上述资产管理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>1) 资产管理产品管理人风险</p> <p>资产管理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资产管理产品, 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</p> <p>本计划拟配置的子基金主要使用中证 500 指数增强策略等量化策略, 该等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>计划、基金公司及基金公司子公司集合资产管理计划、期货公司及期货子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品), 投资上述资产管理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>1) 资产管理产品管理人风险</p> <p>资产管理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资产管理产品, 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</p> <p>本计划拟配置的子基金主要使用中证 500 指数增强策略等量化策略, 该等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, 因资产管理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) 赎回资产管理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, 管理人赎回资产管理产品时, 可能触发资产管理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> <p>(2) 净值波动风险 本计划主要投资于公募证券投资基金、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、期货公司及期货子公司集合资产管理计划以及在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品等资产管理产品, 投资上述产品出现如下情形之一时, 将可能导致本计划出现净值波动风险:</p> <p>1) 估值日后的第一个交易日仍无法及时获取上述投资品种的最新估值价格;</p> <p>2) 投资上述品种后无法及时确认, 上述投资品种在投资确认前估值价格波动;</p> <p>3) 估值日后的第一个交易日取</p> | <p>3) 量化策略模型风格偏离风险 在实际运作中, 因资产管理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) 赎回资产管理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, 管理人赎回资产管理产品时, 可能触发资产管理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> <p>(2) 投资金融衍生品的风险 本计划投资沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货, 将可能导致本计划出现如下风险, 请委托人知悉:</p> <p>1) 期货投资风险 (如有)</p> <p>① 流动性风险 本计划在期货市场成交不活跃时, 可能在建仓和平仓期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。</p> <p>② 基差风险 基差是指现货价格与期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况, 则可能对本计划投资产生影响。</p> <p>③ 合约展期风险 本计划所投资的期货合约主要包括期货当月和近月合约。当计划所持有的合约临近交割期限, 即需</p> |
|--|--|--|

| | | |
|--|--|--|
| | <p>得的上述投资品种的最新估值价格仍没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响）。</p> | <p>要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。</p> <p>④ 期货保证金不足风险</p> <p>由于期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于期货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，直接影响本基金收益水平，从而产生风险。</p> <p>⑤ 杠杆风险</p> <p>期货作为金融衍生品，其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本计划可能承受超出保证金甚至计划资产本金的损失。</p> <p>2) 期权的投资风险（如有）</p> <p>① 期权买方风险</p> <p>由于期权标的价格波动导致期权不具行权价值，期权买方将损失付出的所有权利金。</p> <p>② 期权卖方风险</p> <p>卖出期权交易的风险一般高于买入期权交易的风险，卖出期权虽然能获得权利金，但也因承担行权履约义务而面临由于合约标的价格波动，而承受远高于该笔权利金的损失的风险。</p> <p>③ 流动性风险</p> <p>持有的期权合约存在可能难以或无法平仓的风险，当市场交易量</p> |
|--|--|--|

不足或者连续出现单边涨跌停价格时，期权合约持有者可能无法在市场上找到平仓机会。

(3) 净值波动风险

本计划主要投资于公募证券投资基金、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、期货公司及期货子公司集合资产管理计划以及在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品等资产管理产品，投资上述产品出现如下情形之一时，将可能导致本计划出现净值波动风险：

1) 估值日后的第一个交易日仍无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；

2) 投资上述品种后无法及时确认，上述投资品种在投资确认前估值价格波动；

3) 估值日后的第一个交易日取得的上述投资品种的最新估值价格仍没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响）。

附件 2：第一创业中证 500 指数增强 FOF1 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 | “基本信息” | <p>1、投资范围</p> <p>(1) 资产管理产品：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、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、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品；</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) 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>本计划投资于资产管理产品的比例不低于资产总值的 80%，并通过投向资产管理产品进行以下比例的资产配置：</p> <p>(1) 权益类资产的投资比例不低于资产总值的 80%；</p> <p>(2) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例不高于资产总值的 20%；</p> | <p>1、投资范围</p> <p>(1) 资产管理产品：公募证券投资基金（包含货币市场基金）、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、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、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品；</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) 衍生品类资产：沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货。</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>本计划投资于资产管理产品的比例不低于资产总值的 80%，直接或通过投向资产管理产品进行以下比例的资产配置：</p> <p>(1) 权益类资产的投资比例不低于资产总值的 80%；</p> <p>(2) 固定收益类资产与现金类资产的投资比例不高于资产总值的 20%；</p> |
| 2 | “临时报告” | <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</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</p> |

| | | | |
|--|--|--|--|
| | | <p>项发生之日起 5 个工作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； 3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请； 4、本计划终止和清算； 5、本合同的补充、修改与变更； 6、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项； 7、负责本计划的代理销售机构发生变更； 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； 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； 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）； 11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更； 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>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； 3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请； 4、本计划终止和清算； 5、本合同的补充、修改与变更； 6、与本计划有关的重大诉讼、仲裁事项； 7、负责本计划的代理销售机构发生变更； 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； 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； 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）； 11、管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更； 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。 |
|--|--|--|--|

附件 3：第一创业中证 500 指数增强 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书变更对照表

| 序号 | 位置 | 原计划说明书 | 变更后计划说明书 |
|----|-------------|---|---|
| 1 | “（一）特殊风险揭示” | <p>7、其他特殊风险</p> <p>（1）投资资产管理产品的风险</p> <p>本集合计划部分资产将配置于以中证 500 指数增强策略等量化策略为主的金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品（包括公募证券投资基金、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、期货公司及期货子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品），投资上述资产管理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>1）资产管理产品管理人风险</p> <p>资产管理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资产管理产品，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</p> <p>本计划拟配置的子基金主要使用中证 500 指数增强策略等量化策略，该等策略主要依赖于量化模型，因为模型不能有效的、</p> | <p>7、其他特殊风险</p> <p>（1）投资资产管理产品的风险</p> <p>本集合计划部分资产将配置于以中证 500 指数增强策略等量化策略为主的金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品（包括公募证券投资基金、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、期货公司及期货子公司集合资产管理计划和在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品），投资上述资产管理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>1）资产管理产品管理人风险</p> <p>资产管理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资产管理产品，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</p> <p>本计划拟配置的子基金主要使用中证 500 指数增强策略等量化策略，该等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</p> |

| | | | |
|--|--|---|---|
| | | <p>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</p> <p>在实际运作中，因资产管理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) 赎回资产管理产品面临的流动性风险</p> <p>因本计划委托人赎回或管理人进行资产配置调整需要，管理人赎回资产管理产品时，可能触发资产管理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> <p>(2) 净值波动风险</p> <p>本计划主要投资于公募证券投资基金、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、期货公司及期货子公司集合资产管理计划以及在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品等资产管理产品，投资上述产品出现如下情形之一时，将可能导致本计划出现净值波动风险：</p> <p>1) 估值日后的第一个交易日</p> | <p>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</p> <p>在实际运作中，因资产管理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) 赎回资产管理产品面临的流动性风险</p> <p>因本计划委托人赎回或管理人进行资产配置调整需要，管理人赎回资产管理产品时，可能触发资产管理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> <p>(2) 投资金融衍生品的风险</p> <p>本计划投资沪深交易所及期货交易所上市的期权及期货，将可能导致本计划出现如下风险，请委托人知悉：</p> <p>1) 期货投资风险（如有）</p> <p>① 流动性风险</p> <p>本计划在期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。</p> <p>② 基差风险</p> <p>基差是指现货价格与期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本计划投资产生影响。</p> <p>③ 合约展期风险</p> <p>本计划所投资的期货合约主要包括期货当月和近月合约。当计划所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。</p> <p>④ 期货保证金不足风险</p> |
|--|--|---|---|

| | | | |
|--|--|--|--|
| | | <p>仍无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；</p> <p>2) 投资上述品种后无法及时确认，上述投资品种在投资确认前估值价格波动；</p> <p>3) 估值日后的第一个交易日取得的上述投资品种的最新估值价格仍没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响）。</p> | <p>由于期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于期货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，直接影响本基金收益水平，从而产生风险。</p> <p>⑤ 杠杆风险</p> <p>期货作为金融衍生品，其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本计划可能承受超出保证金甚至计划资产本金的损失。</p> <p>2) 期权的投资风险（如有）</p> <p>① 期权买方风险</p> <p>由于期权标的价格波动导致期权不具行权价值，期权买方将损失付出的所有权利金。</p> <p>② 期权卖方风险</p> <p>卖出期权交易的风险一般高于买入期权交易的风险，卖出期权虽然能获得权利金，但也因承担行权履约义务而面临由于合约标的价格波动，而承受远高于该笔权利金的损失的风险。</p> <p>③ 流动性风险</p> <p>持有的期权合约存在可能难以或无法平仓的风险，当市场交易量不足或者连续出现单边涨跌停价格时，期权合约持有者可能无法在市场上找到平仓机会。</p> <p>(3) 净值波动风险</p> <p>本计划主要投资于公募证券投资基金、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、期货公司及期货子公司集合资产管理计划以及在基金业协会备案的私募证券投资基金管理人发行的私募证券投资基金、银行非保本理财产品及其他金融监管部门批准或备案</p> |
|--|--|--|--|

| | | | |
|--|--|--|--|
| | | | <p>发行的资产管理产品等资产管理产品，投资上述产品出现如下情形之一时，将可能导致本计划出现净值波动风险：</p> <p>1) 估值日后的第一个交易日仍无法及时获取上述投资品种的最新估值价格；</p> <p>2) 投资上述品种后无法及时确认，上述投资品种在投资确认前估值价格波动；</p> <p>3) 估值日后的第一个交易日取得的上述投资品种的最新估值价格仍没有或无法排除影响估值价格的因素（例如在估值日无法排除业绩报酬对估值价格的影响）。</p> |
|--|--|--|--|