

# 关于第一创业基础设施 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，兴业银行股份有限公司杭州分行作为托管人的第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2022 年 1 月 27 日成立。为满足客户需求，拟对《第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划资产管理合同》、《第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划说明书》、《第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划风险揭示书》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 2022 年 11 月 10 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 11 月 10 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 11 月 14 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：第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划资产管理合同  
变更明细表

附件 2：第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划说明书变更明  
细表

附件 3：第一创业基础设施 1 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  
二〇二二年十一月九日

附件 1：第一创业基础设施 1 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	(三) 托管人 机构名称：兴业银行股 份有限公司杭州分行 负责人：张旻 .....	(三) 托管人 机构名称：兴业银行股份有限公 司杭州分行 负责人：苏军良 .....
2	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 ..... 2、主要投资方向 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以下 资产：	(四) 资产管理计划的投资目标、主要投资方 向、投资比例 ..... 2、主要投资方向 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以下资产： (1) 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

	<p>(1) 固定收益类资产(含现金类资产):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、固定收益类银行理财产品;</p> <p>(2) 权益类资产:公开募集基础设施证券投资基金(REITs)(以下或简称“公募REITs”,如相关法律法规以及监管部门对所属资产类别有相关规定的,本计划将从其规定);</p> <p>(3)本计划可参与国债逆回购交易。</p> <p>3、投资比例</p> <p>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%(含)-100%(不含);投向权益类资产的投资比例为资产总值的 0%(含)-20%(不含);参与证券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。</p>	<p>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)、可交换债(含可交换私募债)、资产支持证券(ABS)(不含劣后级,其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权)、债券型证券投资基金,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、中小企业集合票据、资产支持票据(ABN)(不含劣后级,其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权)、非公开定向债务融资工具(PPN)等,国债逆回购;</p> <p>(2) 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;</p> <p>(3) 权益类资产:公开募集基础设施证券投资基金(REITs)(以下或简称“公募REITs”,如相关法律法规以及监管部门对所属资产类别有相关规定的,本计划将从其规定)。</p> <p>本计划不直接投资于股票,但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的权益资产。因上述原因持有的股票,本计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。</p> <p>3、投资比例</p> <p>本计划财产投向固定收益类资产和现金类资产合计的投资比例为资产总值的 80%(含)-100%(含);投向权益类资产的投资比例为资产总值的 0%(含)-20%(不含);参与证券逆回购资金余额</p>
--	---	---



			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	八、资产管理计划的参与、退出与转让	<p>(一)资产管理计划的参与、退出</p> <p>.....</p> <p>2、参与和退出的开放日和时间</p> <p>通常情况下，本计划自成立日起每周开放一次，具体开放时间为每周三（如遇非工作日则自动顺延至下一个工作日）；本计划拟进行公募 REITs 投资期间，拟投资的公募 REITs 询价公告披露日次一工作日至上市首日次一工作日期间的周三本计划不开放，具体以管理人公告为准。在开放期内的工作日，委托人可办理参与和/或退出业务。</p> <p>.....</p>	<p>(一) 资产管理计划的参与、退出</p> <p>.....</p> <p>2、参与和退出的开放日和时间</p> <p>通常情况下，本计划自成立日起每周一、三、五为开放日（如遇非工作日不顺延）可办理参与和退出业务。</p> <p>如遇本计划进行公募 REITs 投资，自拟投资的公募 REITs 询价公告披露日次一工作日（不含）起至募集期结束日次一工作日（含）期间，本计划的开放日均暂停退出业务；自拟投资的公募 REITs 询价公告披露日次一工作日（含）起至上市首日次一工作日（含）期间，管理人有权根据投资运作情况暂停开放日的参与业务，具体以管理人届时公告为准。</p> <p>.....</p>
4	十一、资产管理计划的投资	<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>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以下资产：</p> <p>(1) 固定收益类资产</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>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以下资产：</p> <p>(1) 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</p>

	<p>(含现金类资产):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、固定收益类银行理财产品;</p> <p>(2) 权益类资产:公开募集基础设施证券投资基金(REITs)(如相关法律法规以及监管部门对所属资产类别有相关规定的,本计划将从其规定);</p> <p>(3) 本计划可参与国债逆回购交易。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>(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%(含)-100%(含);</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例为资产总值的0%(含)-20%(不含);</p> <p>(3) 参与证券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。</p>	<p>(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)、可交换债(含可交换私募债)、资产支持证券(ABS)(不含劣后级,其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权)、债券型证券投资基金,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、中小企业集合票据、资产支持票据(ABN)(不含劣后级,其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权)、非公开定向债务融资工具(PPN)等,国债逆回购;</p> <p>(2) 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;</p> <p>(3) 权益类资产:公开募集基础设施证券投资基金(REITs)(如相关法律法规以及监管部门对所属资产类别有相关规定的,本计划将从其规定)。</p> <p>本计划不直接投资于股票,但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的权益资产。因上述原因持有的股票,本计划将在其可交易之日起的10个交易日内卖出。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 固定收益类资产和现金类资产合计的投资比例为资产总值的80%(含)-100%(含);</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例为资产总值的0%(含)-20%(不含);</p> <p>(3) 参与证券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</p>
--	---	--



			的除外。
5	十 一、资产 管理计划 的投资	<p>(七)资产管理计划的投资限制及禁止行为</p> <p>1、为维护委托人的合法权益,本计划的投资限制为:</p> <p>.....</p> <p>(3) 本计划参与公募 REITs 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;</p> <p>(4)本计划投资除公募基金证券投资基金以外的其他资产管理产品的,该等资产管理产品不得再投资除公募基金证券投资基金以外的其他资产管理产品,金融监管机构另有规定的除外;</p> <p>(5)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。</p>	<p>(七) 资产管理计划的投资限制及禁止行为</p> <p>1、为维护委托人的合法权益,本计划的投资限制为:</p> <p>.....</p> <p>(3) 本计划参与公募 REITs、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;</p> <p>(4) 本计划投向的资产支持证券及资产支持票据仅限于在证券交易所与银行间市场挂牌转让或交易流通的资产支持证券及资产支持票据的优先级份额,不投向以信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权为底层基础资产的资产支持证券及资产支持票据。</p>

6	十 一、资产 管理计划 的投资	<p>(十)本计划投资的资产组合的流动性与本计划参与、退出的安排相匹配,具体为:</p> <p>1、本计划通常情况下每周三开放,投资的现金类资产、固定收益类银行理财产品、公募 REITs 及参与的国债逆回购流动性较高,可以满足本计划参与、退出安排。</p> <p>.....</p>	<p>(十)本计划投资的资产组合的流动性与本计划参与、退出的安排相匹配,具体为:</p> <p>1、本计划通常情况下每周一、三、五开放,投资的现金类资产、固定收益类资产、公募 REITs 流动性较高,可以满足本计划参与、退出安排。</p> <p>.....</p>
7	二 十、资产 管理计划 财产的估 值和会计 核算	<p>3、估值方法</p> <p>估值应符合《企业会计准则》、其他相关法律法规的规定和本合同的约定,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)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</p>	<p>3、估值方法</p> <p>估值应符合《企业会计准则》、其他相关法律法规的规定和本合同的约定,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)股票的估值方法</p> <p>1) 上市流通的股票,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,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件,以最近交易日的收盘价估值;估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使投资品种潜在估值调整对前一估值日的资产净值的影响在 0.5%以上的,可参考停牌股票的估值方法,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。</p> <p>2) 首次发行未上市股票,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的</p>



	<p>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) 持有的资产管理产品的管理人或其委托的运营服务机构定期公布份额净值的，按照最新公布的份额净值估值（若资产管理产品的管理人或其委托的运营服务机构公布净值的同时也提供</p>	<p>情况下，按成本价估值。</p> <p>3) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值。</p> <p>4) 流通受限股票（包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等）按以下公式进行估值：</p> $FV=S \times (1-LoMD)$ <p>其中：</p> <p>FV：估值日该流通受限股票的价值</p> <p>S：估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值</p> <p>LoMD：该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣，该流动性折扣一般由第三方估值机构提供，具体估值机构由管理人和托管人协商约定。</p> <p>(2) 债券估值方法</p> <p>1) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本合同另有约定的除外），选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，具体估值机构由管理人和托管人协商约定。</p> <p>2) 交易所上市交易的可转换债券，按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考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</p>
--	--	--



	<p>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>(3) 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>(4) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，管理人可根据具体情况制定估值方法，并将估值方法提供给托管人进行估值。</p> <p>(5) 如有新增事项或变更事项，按法律法规、监管规定的有关最新规定估值。</p>	<p>格。</p> <p>3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>4) 交易所挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>5) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。</p> <p>6) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p> <p>(3) 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场所的收盘价估值;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</p>
--	---	--

			<p>估值。</p> <p>(4) 银行定期存款或通知存款估值方法 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>(5) 托管账户存款和证券资金账户内的资金按约定利率在实际持有期间内逐日计提利息,在利息到账日以实收利息入账,并冲减已计提部分。</p> <p>(6) 持有回购以成本列示,按商定利率在回购期间内逐日计提应收利息。</p> <p>(7) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种,管理人可根据具体情况制定估值方法,并将估值方法提供给托管人进行估值。</p> <p>(8) 如有新增事项或变更事项,按法律法规、监管规定的有关最新规定估值。</p>
8	<p>二十 四、风险 揭示</p>	<p>(一) 特殊风险揭示 5、其他特殊风险 .....</p>	<p>(一) 特殊风险揭示 5、其他特殊风险 .....</p> <p>(3) 投资可转换债券、可交换债券的风险 可转换债券、可交换债券是兼具股性和债性双重特征的债券衍生投资品种,其风险收益特征介于股票和债券之间。</p> <p>1) 正股价格波动的风险。可转债、可交换债价格与股票市场价格呈正方向变化,当股票市场价格下跌时,一定期间内可转债、可交换债的价格同向变化;</p> <p>2) 信用风险。投资于可转债、可交换债,存在着发行人不能按时足额还本付息的风险;此外,当发行人信用评级降低时,本产品所投资的债券可</p>



能面临价格下跌风险。

#### (4) 投资于非公开发行公司债的风险

##### 1) 信用风险

由于非公开发行公司债主体或债项信用评级可能较弱，信用风险更高。极端情况下会给投资组合带来较大的损失，继而对本计划的资产净值造成较大不利影响。

##### 2) 流动性风险

与股票、国债、金融债等交易活跃的金融工具相比，非公开发行公司债流动性比较差，可能出现无法按计划买入或者卖出债券，或者即便找到交易对手也很难以合理的成本进行交易等情况，进而给投资者带来一定的损失。

#### (5) 投资资产支持证券的风险

##### 1) 与基础资产相关的风险

主要包括原始权益人破产风险、现金流预测风险、基础资产相关风险、附属担保权益相关风险、资金混同及执行风险等与基础资产相关的风险，可能给投资者带来投资损失。

##### 2) 与资产支持证券相关的风险

主要包括资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、资产支持证券的流动性风险、评级风险等与资产支持证券相关的风险，可能给资产支持证券价值带来负面影响，以至于无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而给投资者带来损失。

##### 3) 与资产支持证券发行人相关的风险

主要包括管理人/发行人违约违规风险、托管人/资产保管机构违约违规风险、资产支持证券账

			<p>户管理风险、资产服务机构违规风险等，从而可能给投资者带来损失。</p> <p>4) 其他风险</p> <p>主要包括政策风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险，可能对资产支持证券产生不利影响，从而给投资者带来损失。</p> <p>(6) 无法预警止损的风险</p> <p>本计划未设置预警线和平仓线，由于投资品种价格可能持续向不利方向变动、投资品种市场剧烈波动等原因，委托财产存在全部亏损的风险。</p>
<p>9</p>	<p>附件一：投资运作监督事项表</p> <p>一、投资范围及资产配置比例</p>	<p>1、投资范围</p> <p>(1) 固定收益类资产（含现金类资产）：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、固定收益类银行理财产品；</p> <p>(2) 权益类资产：公开募集基础设施证券投资基金（REITs）（以下或简称“公募REITs”，如相关法律法规以及监管部门对所属资产类别有相关规定的，本计划将从其规定）；</p> <p>(3) 本计划可参与国债逆回购交易。</p> <p>2、资产配置比例</p>	<p>1、投资范围</p> <p>(1) 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）、可交换债（含可交换私募债）、资产支持证券（ABS）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、债券型证券投资基金，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、中小企业集合票据、资产支持票据（ABN）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、非公开定向债务融资工具（PPN）等，国债逆回购；</p> <p>(2) 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）、</p>



		<p>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% (含)-100%(不含);投向权益类资产的投资比例为资产总值的 0%(含)-20%(不含);参与证券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。</p>	<p>货币市场基金;</p> <p>(3) 权益类资产: 公开募集基础设施证券投资基金(REITs)(以下或简称“公募 REITs”,如相关法律法规以及监管部门对所属资产类别有相关规定的,本计划将从其规定)。</p> <p>本计划不直接投资于股票,但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的权益资产。因上述原因持有的股票,本计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本计划财产投向固定收益类资产和现金类资产合计的投资比例为资产总值的 80% (含)-100% (含);投向权益类资产的投资比例为资产总值的 0% (含)-20% (不含);参与证券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。</p>
10	<p>附件一: 投资运作监督事项表</p> <p>二、投资限制</p>	<p>1、为维护委托人的合法权益,本计划的投资限制为:</p> <p>.....</p> <p>(3) 本计划参与公募 REITs 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;</p> <p>(4) 本计划投资除公募基金证券投资基金以外的其他资产管理产品的,该等资产管理产品不得再投资除公募证</p>	<p>1、为维护委托人的合法权益,本计划的投资限制为:</p> <p>.....</p> <p>(3) 本计划参与公募 REITs、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;</p> <p>(4) 本计划投向的资产支持证券及资产支持票据仅限于在证券交易所与银行间市场挂牌转让或交易流通的资产支持证券及资产支持票据的优先级份额,不投向以信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权为底层基础资产的资产支持证券及资产支持票据。</p>

	<p>券投资基金以外的其他资产管理产品，金融监管机构另有规定的除外；</p> <p>(5) 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。</p>	
--	---	--

附件 2：第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划说明书变更明细表

序号	位置	原说明书	变更后说明书
1	基本信息	<p>投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>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以下资产：</p> <p>(1) 固定收益类资产（含现金类资产）：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、固定收益类银行理财产品；</p>	<p>投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>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以下资产：</p> <p>(1) 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）、可交换债（含可交换私募债）、资产支持证券（ABS）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、债券</p>



		<p>(2) 权益类资产：公开募集基础设施证券投资基金（REITs）（如相关法律法规以及监管部门对所属资产类别有相关规定的，本计划将从其规定）；</p> <p>(3) 本计划可参与国债逆回购交易。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>(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%（含）-100%（含）；</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例为资产总值的 0%（含）-20%（不含）；</p> <p>(3) 参与证券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。</p>	<p>型证券投资基金，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、中小企业集合票据、资产支持票据（ABN）（不含劣后级，其基础资产不涉及嵌套信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权）、非公开定向债务融资工具（PPN）等，国债逆回购；</p> <p>(2) 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；</p> <p>(3) 权益类资产：公开募集基础设施证券投资基金（REITs）（以下或简称“公募 REITs”，如相关法律法规以及监管部门对所属资产类别有相关规定的，本计划将从其规定）。</p> <p>本计划不直接投资于股票，但可持有因可转换债券和可交换债券转股所形成的权益资产。因上述原因持有的股票，本计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 固定收益类资产和现金类资产合计的投资比例为资产总值的 80%（含）-100%（含）；</p> <p>(2) 权益类资产的投资比例为资产总值的 0%（含）-20%（不含）；</p> <p>(3) 参与证券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。</p>
2	基本信息	<p>投资限制</p> <p>1、为维护委托人的合法权益，本计划的投资限制为：</p>	<p>投资限制</p> <p>1、为维护委托人的合法权益，本计划的投资限制为：</p>

	<p>.....</p> <p>(3) 本计划参与公募 REITs 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;</p> <p>(4) 本计划投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品的, 该等资产管理产品不得再投资除公募证券投资基金以外的其他资产管理产品, 金融监管机构另有规定的除外;</p> <p>(5) 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。</p>	<p>.....</p> <p>(3) 本计划参与公募 REITs、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;</p> <p>(4) 本计划投向的资产支持证券及资产支持票据仅限于在证券交易所与银行间市场挂牌转让或交易流通的资产支持证券及资产支持票据的优先级份额, 不投向以信托计划、私募基金、资管产品及其收(受)益权为底层基础资产的资产支持证券及资产支持票据。</p>
3	<p>办理时间</p> <p>通常情况下, 本计划自成立日起每周开放一次, 具体开放时间为每周三 (如遇非工作日则自动顺延至下一个工作日); 本计划拟进行公募 REITs 投资期间, 拟投资的公募 REITs 询价公告披露日次一工作日至上市首日次一工作</p>	<p>办理时间</p> <p>通常情况下, 本计划自成立日起每周一、三、五为开放日 (如遇非工作日不顺延) 可办理参与和退出业务。</p> <p>如遇本计划进行公募 REITs 投资, 自拟投资的公募 REITs 询价公告披露日次一工作日 (不含) 起至募集期结束日次一工作日 (含) 期间, 本计划的开放日均暂停退出业务; 自拟投资的公募 REITs 询价公告披</p>



	<p>日期期间的周三本计划不开放，具体以管理人公告为准。在开放期内的工作日，委托人可办理参与和/或退出业务。</p>	<p>露日次一工作日(含)起至上市首日次一工作日(含)期间，管理人有权根据投资运作情况暂停开放日的参与业务，具体以管理人届时公告为准。</p>
--	--	---

附件 3：第一创业基础设施 1 号集合资产管理计划风险揭示书变更明细表

序号	位置	原风险揭示书	变更后风险揭示书
1	二、 风险揭示	<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>5、其他特殊风险</p> <p>.....</p>	<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>5、其他特殊风险</p> <p>.....</p> <p>(3) 投资可转换债券、可交换债券的风险</p> <p>可转换债券、可交换债券是兼具股性和债性双重特征的债券衍生投资品种，其风险收益特征介于股票和债券之间。</p> <p>1) 正股价格波动的风险。可转债、可交换债价格与股票市场价格呈正方向变化，当股票市场价格下跌时，一定期间内可转债、可交换债的价格同向变化；</p> <p>2) 信用风险。投资于可转债、可交换债，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，本产品所投资的债券可能面临价格下跌风险。</p> <p>(4) 投资于非公开发行公司债的风险</p> <p>1) 信用风险</p> <p>由于非公开发行公司债主体或债项信用评级可能较弱，信用风险更高。极端情况下会给投资组合带来较大的损失，继而对本计划的资产净值造成较大不利影响。</p> <p>2) 流动性风险</p>

与股票、国债、金融债等交易活跃的金融工具相比，非公开发行公司债流动性比较差，可能出现无法按计划买入或者卖出债券，或者即便找到交易对手也很难以合理的成本进行交易等情况，进而给投资者带来一定的损失。

#### (5) 投资资产支持证券的风险

##### 1) 与基础资产相关的风险

主要包括原始权益人破产风险、现金流预测风险、基础资产相关风险、附属担保权益相关风险、资金混同及执行风险等与基础资产相关的风险，可能给投资者带来投资损失。

##### 2) 与资产支持证券相关的风险

主要包括资产支持证券信用增级措施相关风险、资产支持证券的利率风险、资产支持证券的流动性风险、评级风险等与资产支持证券相关的风险，可能给资产支持证券价值带来负面影响，以至于无法在合理的时间内以公允价格出售资产支持证券而给投资者带来损失。

##### 3) 与资产支持证券发行人相关的风险

主要包括管理人/发行人违约违规风险、托管人/资产保管机构违约违规风险、资产支持证券账户管理风险、资产服务机构违规风险等，从而可能给投资者带来损失。

##### 4) 其他风险

主要包括政策风险、税收风险、发生不可抗力事件的风险、技术风险和操作风险，可能对资产支持证券产生不利影响，从而给投资者带来损失。

#### (6) 无法预警止损的风险

本计划未设置预警线和平仓线，由于投资品种价



			格可能持续向不利方向变动、投资品种市场剧烈波动等原因，委托财产存在全部亏损的风险。
--	--	--	---