

关于安信证券策略优选1号集合资产管理计划

合同变更的公告

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及《安信证券策略优选1号集合资产管理计划资产管理合同》“第26部分 合同的补充、修改与变更”的规定，经与托管人上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行协商一致，管理人安信证券资产管理有限公司将对《安信证券策略优选1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）中相关内容进行变更（以下简称“本次变更”），现就本次变更相关事项公告如下：

一、合同主要变更内容：

合同主要变更内容详情请详见附件一《安信证券策略优选1号集合资产管理计划资产管理合同修订对照表》。

二、合同变更安排

1、征询意见期

本次变更征询意见期为：2022年1月25日至2022年2月7日15:00。

2、回复意见

请委托人在征询意见期内，书面签署附件二《关于安信证券策略优选1号集合资产管理计划合同变更的回复意见函》（以下简称“《回复函》”）反馈意见，未签署《回复函》的委托人或逾期回复的委托人视为同意合同的变更，同意合同变更的委托人，无需签署新合同。

3、退出安排

(1) 不同意变更或回复意见不明确的委托人，可于征询意见期的最后一个工作日即2022年2月7日退出本集合计划；

(2) 不同意变更或回复意见不明确但未于征询意见期退出的，管理人将在征询意见期最后一个工作日即2022年2月7日日终做强制退出处理。

三、合同变更生效日

本合同满足法律法规要求的集合计划成立要件后，本合同变更生效。合同变更生效日为征询意见期结束次一工作日，即2022年2月8日。

四、其他事项

1、安信证券策略优选1号集合资产管理计划将于2022年2月7日正常开放，委托人可以办理参与或退出业务。办理参与业务的委托人，管理人默认委托人已知悉本次变更的相关内容，并同意本次合同变更。管理人将依据变更生效后新合同进行资产管理业务。

2、本公告发布同时向委托人就合同变更事宜征求意见，不再另行征询，敬请各位委托人根据公告要求予以函复。

如有疑问，可咨询电话：95517。



安信证券资产管理有限公司

2022年1月25日

附件一：安信证券策略优选1号集合资产管理计划合同修订对照表

变更前	变更后
管理人：安信证券股份有限公司	管理人：安信证券资产管理有限公司
第1部分 前言	
为规范安信证券策略优选1号集合资产管理计划的运作，明确《安信证券策略优选1号集合资产管理计划资产管理合同》当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国合同法》……	为规范安信证券策略优选1号集合资产管理计划的运作，明确《安信证券策略优选1号集合资产管理计划资产管理合同》当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国民法典》……
第2部分 释义	
管理人：指安信证券股份有限公司，简称“安信证券”；	管理人：指安信证券资产管理有限公司，简称“安信资管”；
销售机构：安信证券股份有限公司及其他符合条件的销售机构（以管理人公告为准）；	销售机构：安信证券股份有限公司、安信证券资产管理有限公司及其他符合条件的销售机构（以管理人公告为准）；
注册登记机构：指办理本集合计划注册登记业务的机构，本集合计划的注册登记机构为安信证券股份有限公司或接受安信证券股份有限公司委托代为办理登记结算业务的机构；	注册登记机构：指办理本集合计划注册登记业务的机构，本集合计划的注册登记机构为安信证券资产管理有限公司或接受安信证券资产管理有限公司委托代为办理登记结算业务的机构；
管理人指定网站：指 www.essence.com.cn ，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。	管理人指定网站：指 www.axzqzg.com ，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。
第3部分 合同当事人	
二、管理人 机构名称：安信证券股份有限公司 法定代表人：王连志 注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元	二、管理人 机构名称：安信证券资产管理有限公司 法定代表人：李力 注册地址：深圳市福田区莲花街道福中社区金田路4018号安联大厦27A02、27B02
三、托管人 机构名称：上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行 负责人：刘凌 注册地址：深圳市福田区福华三路168号国际商会中心26楼 联系地址：深圳市福田区福华三路168号国际商会中心26楼 联系电话：0755-88691606	三、托管人 机构名称：上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行 法定代表人：李荣军 注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道田心社区浦诚路88号 联系地址：深圳市罗湖区笋岗街道田心社区浦诚路88号 联系电话：0755-81117910
第4部分 集合资产管理计划的基本情况	
四、投资范围和投资比例 1、投资范围 (2)交易所、银行间债券市场公开发行的债券或非公开发行的债券，包括但不限于国债、地方政府债、金融债、央行票据、企业/公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、非公开发行私募债、资产支持证券、资产支持票据、同业存单、金融机构次级债、可转换公司债券、可交换债券、债券正逆回购、银行存款以及符合《指导意见》规定的其他标准化债权类资产； ……	四、投资范围和投资比例 1、投资范围 (2)交易所、银行间债券市场公开发行的债券或非公开发行的债券，包括但不限于国债、地方政府债、金融债、央行票据、企业/公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、非公开发行私募债、资产支持证券（ABS）优先级、资产支持票据（ABN）优先级、同业存单、金融机构次级债、可转换公司债券、可交换债券、债券正逆回购、银行存款以及符合《指导意见》规定的其他标准化债权类资产； ……
九、本集合计划的风险收益特征及适合销售对象 本集合计划属于R5（高风险）等级品种。 本集合计划适合向专业投资者及风险承受能力为C5（激进型）的普通投资者销售。……	九、本集合计划的风险收益特征及适合销售对象 本集合计划属于R4（中高风险）等级品种。 本集合计划适合向专业投资者及风险承受能力为C4（积极型）、C5（激进型）的普通投资者销售。……
十、本集合计划的销售 1、销售机构 本集合计划的销售机构包括安信证券股份有限公司及其他符合条件的销售机构（以管理人公告为准）。 ……	十、本集合计划的销售 1、销售机构 本集合计划的销售机构包括安信证券股份有限公司、安信证券资产管理有限公司及其他符合条件的销售机构（以管理人公告为准）。 ……
第10部分 集合计划账户与资产	
一、集合计划账户的开立 2、集合计划募集账户的开立 …… 本集合计划的注册登记机构为安信证券股份有限公司。注册登记机构为委托人开立集合计划账户，用于记录委托人持有的本集合资产管理计划份额。……	一、集合计划账户的开立 2、集合计划募集账户的开立 …… 本集合计划的注册登记机构为安信证券资产管理有限公司。注册登记机构为委托人开立集合计划账户，用于记录委托人持有的本集合资产管理计划份额。……
第12部分 集合计划估值	
七、估值方法 1、基金产品估值方法 (1) 场外公募基金（包括托管在场外的交易型指数基金ETF、上市型开放式基金LOF、货币ETF）产品定期披露单位净值的，以估值日基金产品单位净值估值（以公开披露的净值或管理	七、估值方法 1、基金产品估值方法 (1) 场外公募基金（包括托管在场外的交易型指数基金ETF、上市型开放式基金LOF、货币ETF）产品定期披露单位净值的，以估值日前一日基金产品单位净值估值（以公开披露的净值或管理人盖

<p>人盖章版净值函为准)；估值日基金净值未公布的，则按基金产品最近披露的净值估值。</p> <p>.....</p> <p>(3) 货币市场基金按成本估值，每天按公布的估值日万份收益计提收益。</p>	<p>章版净值函为准)；估值日前一日基金净值未公布的，则按基金产品最近披露的净值估值。</p> <p>.....</p> <p>(3) 摊余成本法货币市场基金按成本估值，每天按公布的估值日前一日万份收益计提收益。</p>
<p>3、债券估值方法</p> <p>(1) 在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：.....</p> <p>对于在交易所市场上市交易的公募可转换债券、公募可交换债，选取每日收盘价作为估值全价。</p> <p>对于在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券采用成本估值。</p> <p>对于在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值按成本估值。</p>	<p>3、债券估值方法</p> <p>(1) 在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：.....</p> <p>对于在交易所上市的公募类实行全价交易的可转债、可交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。</p> <p>对于在交易所市场上市净价交易的公募可转换债券、公募可交换债，选取每日收盘价作为估值全价。</p> <p>对于在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和非公开发行债券，采用第三方机构（此处指中证指数有限公司）提供的估值价格确定公允价值；第三方机构无法提供估值价格时，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>对于在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。</p>
<p>九、估值错误与遗漏的处理</p> <p>管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性和及时性。当份额计价出现错误时，管理人和托管人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。</p>	<p>九、估值错误与遗漏的处理</p> <p>管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性和及时性。当份额计价出现错误时，管理人和托管人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。如双方经平等协商，仍无法对会计核算估值结果达成一致意见的情况下，以资产管理人的意见为准。由此给资产委托人和本计划财产造成的损失，由资产管理人负责全部赔付。</p>
<p>第13部分 集合计划的费用、业绩报酬</p>	
<p>二、不列入集合计划费用的项目</p> <p>集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与销售有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务、处置资产管理计划事务不当导致费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。</p>	<p>二、不列入集合计划费用的项目</p> <p>集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与销售有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务、处置资产管理计划事务不当导致费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用。</p>
<p>第14部分 投资收益与分配</p>	
<p>二、可供分配收益</p> <p>.....</p> <p>收益分配原则：</p> <p>2、本计划收益分配方式为现金分红；</p>	<p>二、可供分配收益</p> <p>.....</p> <p>收益分配原则：</p> <p>2、本计划收益分配方式为现金分红或红利再投资，投资者未做选择默认现金分红，投资者可以在权益登记日前修改分红方式。选择红利再投资方式的，分红资金按除息日的单位净值转换成相应的集合计划份额；</p>
<p>第15部分 投资理念与投资策略</p>	
<p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本集合计划利用安信证券的宏观经济分析框架和内部信用评级系统，结合宏观经济研究和信用研究，分析影响宏观经济、资本市场和行业发展前景的关键因素，选择基本面较强、较高等级的主体，在有效控制风险并确保流动性的基础上，实现收益最大化。</p>	<p>三、投资策略</p> <p>.....</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本集合计划利用安信资管宏观经济分析框架和内部信用评级系统，结合宏观经济研究和信用研究，分析影响宏观经济、资本市场和行业发展前景的关键因素，选择基本面较强、较高等级的主体，在有效控制风险并确保流动性的基础上，实现收益最大化。</p>
<p>第16部分 投资决策与风险控制</p>	
<p>二、集合计划的投资程序</p> <p>严格的投资管理制度和程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。本计划采取公司资产管理业务投资决策委员会和资产管理部投资决策小组领导下的投资主办负责制。管理人另设立风险控制小组，对集合资产管理计划进行绩效分析和风险评估。</p> <p>1、研究分析</p> <p>宏观策略分析师和行业分析师在借鉴外部研究成果的基础上，开展宏观经济及政策分析、债券市场分析、行业及上市公司</p>	<p>二、集合计划的投资程序</p> <p>严格的投资管理制度和程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。本计划采取投资决策委员会领导下的投资经理负责制。管理人另设立风控部，对集合资产管理计划进行绩效分析和风险评估。</p> <p>1、研究分析</p> <p>宏观策略分析师和行业分析师在借鉴外部研究成果的基础上，开展宏观经济及政策分析、债券市场分析、行业及上市公司分析；定量分析师负责量化策略的研究、模型的构建、检验、维护和运行</p>

<p>分析；定量分析师负责量化策略的研究、模型的构建、检验、维护和运行结果的报告。通过以上研究工作，为投资决策委员会、投资决策小组以及投资主办提供独立、统一的投资决策支持。</p> <p>2、投资决策</p> <p>资产管理部投资决策小组定期和不定期召开会议，对宏观经济形势、利率趋势、证券市场走势等进行综合分析，确定集合计划下一阶段的资产配置；审核投资主办提交的投资计划以及审核其他涉及计划投资管理的重大问题。</p> <p>3、组合构建</p> <p>投资主办在投资决策小组给定的资产配置比例范围内，结合集合计划有关投资品种、投资限制等规定完成投资组合的构建。</p> <p>4、交易执行</p> <p>管理人设置独立的中央交易室，交易员负责在合法合规的前提下，执行投资主办的投资指令，并实施一线风险监控。</p> <p>5、风险与绩效评估</p> <p>风险控制小组对集合计划的投资行为进行合规性监控，对投资过程中存在的风险隐患进行风险提示，并就投资组合提出风险管理建议；定期和不定期对集合计划进行风险和绩效评估，对投资组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略提供相关报告。</p> <p>6、组合监控与调整</p> <p>投资主办将跟踪经济状况、证券市场 and 上市公司的发展变化，结合集合计划参与和退出的现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，使之不断得到优化。</p>	<p>结果的报告。通过以上研究工作，为投资决策委员会以及投资经理提供独立、统一的投资决策支持。</p> <p>2、投资决策</p> <p>投资决策委员会不定期召开会议，对宏观经济形势、利率趋势、证券市场走势等进行综合分析，确定集合计划下一阶段的资产配置；审核投资经理提交的投资计划以及审核其他涉及计划投资管理的重大问题。</p> <p>3、组合构建</p> <p>投资经理在投资决策委员会给定的资产配置比例范围内，结合集合计划有关投资品种、投资限制等规定完成投资组合的构建。</p> <p>4、交易执行</p> <p>管理人设置独立的中央交易室，交易员负责在合法合规的前提下，执行投资经理的投资指令，并实施一线风险监控。</p> <p>5、风险与绩效评估</p> <p>风控部对集合计划的投资行为进行合规性监控，对投资过程中存在的风险隐患进行风险提示，并就投资组合提出风险管理建议；定期和不定期对集合计划进行风险和绩效评估，对投资组合承担的风险水平以及是否符合既定的投资策略提供相关报告。</p> <p>6、组合监控与调整</p> <p>投资经理将跟踪经济状况、证券市场 and 上市公司的发展变化，结合集合计划参与和退出的现金流量情况，以及组合风险与绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，使之不断得到优化。</p>
<p>三、风险控制</p> <p>2、风险控制组织架构</p> <p>有效的风险管理工作是金融企业的安身立命之本。本计划的管理人建立了董事会及董事会风险控制委员会——经理层及经理层风险管理委员会——各风险管理职能部门——各风险管理单元的四级风险管理体系。</p> <p>本集合计划的管理人在资产管理业务与自营业务、经纪业务、投行业务之间建立隔离墙制度，从人员、资金、账户、交易、清算等方面严格分开，以保护客户的合法利益。对资产管理业务，管理人采取前后台分离的运作模式，由营运部门对资产管理业务进行后台支持，部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。资产管理业务的风险控制采用自上而下的风险政策执行与自下而上的风险信息报告相结合的核心架构。</p>	<p>三、风险控制</p> <p>2、风险控制组织架构</p> <p>有效的风险管理工作是金融企业的安身立命之本。管理人采取前后台分离的运作模式，由营运部门对资产管理业务进行后台支持，部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。资产管理业务的风险控制采用自上而下的风险政策执行与自下而上的风险信息报告相结合的核心架构。</p>
第 17 部分 投资限制及禁止行为	
<p>一、投资限制</p>	<p>一、投资限制</p> <p>新增：</p> <p>7、本集合计划所投资的资产支持证券和资产支持票据的优先级，须为银行间或沪深交易所挂牌交易，且基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权。</p>
第 18 部分 集合计划的信息披露	
<p>二、临时报告</p> <p>2、集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资主办人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；</p>	<p>二、临时报告</p> <p>2、集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资经理人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；</p>
第 24 部分 风险揭示	
<p>本集合计划面临包括但不限于以下风险：</p>	<p>本集合计划面临包括但不限于以下风险：</p> <p>新增：</p> <p>一、一般风险揭示</p> <p>（一）本金损失风险</p> <p>管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。</p> <p>本计划属于 R4（中高风险）投资品种，适合专业投资者及风险识别、评估、承受能力为 C4（积极型）、C5（激进型）的普通投资者。</p>
<p>（一）市场风险</p>	<p>（二）市场风险</p> <p>新增：</p> <p>7、衍生品风险</p> <p>（1）无论管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资，由于金融衍生品的高杠杆性等特征，对金融衍生品的投资无论在任何情况下均具有较高的风险。</p>

	<p>(2) 管理人并非期货交易所会员,以期货交易所会员(即期货经纪人)之客户的身份参与期货交易,可能存在因期货经纪人违规经营、管理疏忽、资金能力出现问题等原因而导致本资产管理计划蒙受损失。</p> <p>(3) 期货交易所实行保证金制度、当日无负债结算制度、涨跌停板制度、持仓限额和大户持仓报告制度、风险准备金制度以及国务院期货监督管理机构规定的其他风险管理制度。本资产管理计划可能因保证金不足而被采取限制开仓、强制平仓,进而可能给本资产管理计划造成重大损失;本资产管理计划所委托的交易所会员除接受本资产管理计划委托外,还可能同时接受其他主体的委托,本资产管理计划所委托的交易所会员发生保证金不足时将被采取限制开仓、强制平仓等措施,而这种不足不一定是本资产管理计划的保证金不足造成的,还可能是上述交易所会员进行其他主体的委托操作所造成的,但即便如此本资产管理计划也可能因此受到重大损失;为及时缴纳保证金,本资产管理计划可能紧急变现部分资产管理计划财产,在上述情况下,该部分资产管理计划财产的变现可能并非以最优价格进行,从而造成本资产管理计划的损失。本资产管理计划及本资产管理计划所委托的交易所会员可能被实行强制结算,一旦本资产管理计划或本资产管理计划所委托的交易所会员被强制结算、可能给本资产管理计划财产造成损失。</p> <p>(4) 金融衍生品具有高杠杆性的特征,当出现不利行情时,本资产管理计划所投资期货合约品种微小的变动就可能使本资产管理计划遭受较大损失。</p> <p>(5) 在市场剧烈变化的情况下,管理人可能难以或无法将持有的未平仓合约平仓。这类情况将导致保证金有可能无法弥补全部损失,本资产管理计划必须承担由此导致的全部损失。同时本资产管理计划将面临期货合约无法当天平仓而价格变动的风险。</p> <p>(6) 相关交易所可能对交易品种的套期保值或套利实行额度管理,本资产管理计划如拟进行某交易品种的套期保值或套利交易的,可能因无法申请额度或无法及时获得额度而不能开展相关交易。相比于其他交易品种,金融衍生品的投资交易可能更加频繁,频繁操作将可能增加管理人、期货经纪人等相关方操作失误的可能性,存在操作风险。</p>
<p>(八) 本集合计划特有风险</p>	<p>(九) 本集合计划特有风险增加:</p> <p>3、集合计划运营事项涉及风险</p> <p>本计划由安信证券股份有限公司提供投资运营管理、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务和支持,因安信证券股份有限公司经营风险、技术系统故障、操作失误等,可能使资产管理计划运营事项发生差错,从而为本集合资产管理计划的运营带来风险。</p> <p>4、委托募集和参与涉及风险</p> <p>管理人可委托在中国证监会取得基金销售业务资格的基金业协会会员机构代销本集合资产管理计划,代销机构可能存在违法违规地向不特定对象宣传、商业贿赂、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作等行为,导致投资者合法权益受损。</p>
<p>(八) 本集合计划特有风险</p> <p>4、本集合计划合同变更时,部分委托人可能因为未关注管理人网站公告或因为未能提供有效的联系方法或者未能将变动后的联系方式通知管理人,而无法及时获知合同变更事项。如果委托人因为上述原因未能按时退出本计划,可能会被视为同意合同变更,从而存在风险。</p>	<p>(九) 本集合计划特有风险</p> <p>6、合同变更风险</p> <p>本集合计划合同变更时,部分委托人可能因为未关注管理人网站公告或因为未能提供有效的联系方法或者未能将变动后的联系方式通知管理人,而无法及时获知合同变更事项。如果委托人因为上述原因未能按时退出本计划,可能会被视为同意合同变更,从而存在风险。</p>
<p>(八) 本集合计划特有风险</p> <p>15、资产支持证券的投资风险</p> <p>(1) 主体和信用风险</p> <p>.....</p> <p>3) 保证人信用风险:若保证人未按相关担保协议的规定提供相应担保,则可能对优先级资产支持证券的本金和预期收益支付带来不利影响。</p> <p>(2) 与资产支持证券相关的风险</p> <p>1) 评级风险</p> <p>评级机构对资产支持证券的评级不是购买、出售或持有资产支持证券的建议,而仅是对资产支持证券预期收益和/或本金偿付的可能性作出的判断,不能保证资产支持证券的评级将一直保</p>	<p>(九) 本集合计划特有风险</p> <p>17、资产支持证券/资产支持票据的投资风险</p> <p>(1) 主体和信用风险</p> <p>.....</p> <p>3) 保证人信用风险:若保证人未按相关担保协议的规定提供相应担保,则可能对优先级资产支持证券/资产支持票据的本金和预期收益支付带来不利影响。</p> <p>(2) 与资产支持证券/资产支持票据相关的风险</p> <p>1) 评级风险</p> <p>评级机构对资产支持证券/资产支持票据的评级不是购买、出售或持有资产支持证券/资产支持票据的建议,而仅是对资产支持证券/资产支持票据预期收益和/或本金偿付的可能性作出的判断,不能</p>

<p>持在该等级，评级机构可能会根据未来具体情况撤销资产支持证券的评级。评级机构撤销或降低资产支持证券的评级可能对其价值带来负面影响。</p> <p>2) 专项计划提前终止的风险</p> <p>交易文件规定，专项计划进入加速清偿程序或发生违约事件的，资产支持证券提前到期的，原始权益人应按照《资产买卖协议》的约定回购剩余基础资产。专项计划的提前终止可能导致投资者所持有的优先级资产支持证券提前到期，给投资者带来风险。</p> <p>3) 流动性风险</p> <p>资产支持证券将在深交所综合协议交易平台的技术支持下进行转让，若该交易系统不能满足投资者的活跃交易要求、或资产支持证券交易本身不够活跃，则资产支持证券存在因流动性不足而导致投资者无法在合理的时间以公允价格出售资产支持证券的风险。</p> <p>4) 现金流分配机制风险</p> <p>专项计划如果采用了优先级/次级产品结构化分层的增信措施，在每期偿付的资金确认日，如果当期从监管账户收到的现金款项未能全额兑付优先级资产支持证券预期应付本金和收益时，由计划管理人使用专项计划账户中次级资产支持证券占有的现金流进行分级支持，如该支持无法成功实现，可能会对优先级资产支持证券预期应付本金和收益的兑付造成风险。</p> <p>(3) 与专项计划管理相关的风险</p> <p>1) 计划管理人违规风险</p> <p>在专项计划存续期间，计划管理人如出现严重违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的情形，计划管理人可能会被取消资格，监管部门也可能对资产支持证券采取暂停和终止转让服务等处理措施，从而可能给投资者带来风险。</p> <p>2) 监管人、托管人违规风险</p> <p>在专项计划存续期间，监管人对监管账户进行监督管理，并根据专项计划文件的约定负责将监管账户中的资金向专项计划账户中进行划转。若监管银行出现违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的情形，可能会影响资产支持证券投资者按时、足额获得本金和预期收益。</p> <p>专项计划存续期内的托管、分配等所有现金收支活动均涉及托管人。若托管人出现严重违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的情形，亦可能会影响资产支持证券持有人按时、足额获得本金和预期收益。</p> <p>.....</p>	<p>保证资产支持证券/资产支持票据的评级将一直保持在该等级，评级机构可能会根据未来具体情况撤销资产支持证券/资产支持票据的评级。评级机构撤销或降低资产支持证券/资产支持票据的评级可能对其价值带来负面影响。</p> <p>2) 专项计划提前终止的风险</p> <p>交易文件规定，专项计划进入加速清偿程序或发生违约事件的，资产支持证券/资产支持票据提前到期的，原始权益人应按照《资产买卖协议》的约定回购剩余基础资产。专项计划的提前终止可能导致投资者所持有的优先级资产支持证券/资产支持票据提前到期，给投资者带来风险。</p> <p>3) 流动性风险</p> <p>资产支持证券/资产支持票据将在各自所属的交易平台的技术支持下进行转让，若该交易系统不能满足投资者的活跃交易要求、或资产支持证券/资产支持票据交易本身不够活跃，则资产支持证券/资产支持票据存在因流动性不足而导致投资者无法在合理的时间以公允价格出售资产支持证券/资产支持票据的风险。</p> <p>4) 现金流分配机制风险</p> <p>专项计划如果采用了优先级/次级产品结构化分层的增信措施，在每期偿付的资金确认日，如果当期从监管账户收到的现金款项未能全额兑付优先级资产支持证券/资产支持票据预期应付本金和收益时，由计划管理人使用专项计划账户中次级资产支持证券/资产支持票据占有的现金流进行分级支持，如该支持无法成功实现，可能会对优先级资产支持证券/资产支持票据预期应付本金和收益的兑付造成风险。</p> <p>(3) 与专项计划管理相关的风险</p> <p>1) 计划管理人违规风险</p> <p>在专项计划存续期间，计划管理人如出现严重违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的情形，计划管理人可能会被取消资格，监管部门也可能对资产支持证券/资产支持票据采取暂停和终止转让服务等处理措施，从而可能给投资者带来风险。</p> <p>2) 监管人、托管人违规风险</p> <p>在专项计划存续期间，监管人对监管账户进行监督管理，并根据专项计划文件的约定负责将监管账户中的资金向专项计划账户中进行划转。若监管银行出现违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的情形，可能会影响资产支持证券/资产支持票据投资者按时、足额获得本金和预期收益。</p> <p>专项计划存续期内的托管、分配等所有现金收支活动均涉及托管人。若托管人出现严重违反相关法律、法规和专项计划文件有关规定的情形，亦可能会影响资产支持证券/资产支持票据持有人按时、足额获得本金和预期收益。</p> <p>.....</p>
<p>(十一) 其他风险</p> <p>1、突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。</p> <p>其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：</p> <p>.....</p> <p>4、对主要业务人员如投资主办人的依赖而可能产生的风险；</p> <p>.....</p>	<p>(十二) 其他风险</p> <p>1、突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。</p> <p>其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：</p> <p>.....</p> <p>4、对主要业务人员如投资经理人的依赖而可能产生的风险；</p> <p>.....</p>
<p>第 25 部分 合同的成立与生效</p>	
<p>一、合同的成立与生效</p> <p>本合同由管理人、托管人法定代表人/负责人或授权签字人签字并加盖公章或资产托管业务合同专用章，委托人签署（如果委托人是自然人则应签字，如果委托人是非自然人则应加盖公章，并由法定代表人或其授权签字人签字）/以电子合同、电子签名签署后成立。管理人、托管人和委托人作为本合同当事人，以约定的签名方式签署本合同，即表明管理人、托管人和委托人完全接受本合同项下的全部条款。</p> <p>本合同成立后，满足以下条件时生效：委托人参与资金实际交付并经注册登记机构确认。</p> <p>本集合计划终止，本合同终止。但合同项下有关清算、违约责任、争议解决的条款仍然有效。</p> <p>二、合同的组成</p> <p>《安信证券策略优选 1 号集合资产管理计划说明书》、经管理人确认有效的委托人参与、退出本集合计划的申请材料或数据电文和各销售机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证或</p>	<p>本合同由管理人、托管人法定代表人/负责人或授权签字人签字并加盖公章或资产托管业务合同专用章，委托人签署（如果委托人是自然人则应签字，如果委托人是非自然人则应加盖公章，并由法定代表人或其授权签字人签字）/以电子合同、电子签名签署后成立。管理人、托管人和委托人作为本合同当事人，以约定的签名方式签署本合同，即表明管理人、托管人和委托人完全接受本合同项下的全部条款。</p> <p>本合同成立后，满足以下条件时生效：委托人参与资金实际交付并经注册登记机构确认。</p> <p>本集合计划终止，本合同终止。但合同项下有关清算、违约责任、争议解决的条款仍然有效。</p>

<p>委托人通过电子签名方式产生的数据电文等为本合同的附件,是合同的组成部分,与合同具有同等法律效力。</p>	
<p>第 26 部分 合同的补充、修改与变更</p>	
	<p>新增: 2、经管理人与托管人协商一致,可通过公告的方式调低管理费费率、调低托管费率、调高业绩报酬计提基准(若有)、调低业绩报酬计提比例(若有)。</p>
<p>2、除上述 1 所述情形外,管理人和托管人经书面达成一致后可以变更本合同,并在管理人网站公告。……</p>	<p>3、除上述 1、2 所述情形外,管理人和托管人经书面达成一致后可以变更本合同,并在管理人网站公告。……</p>
<p>第 27 部分 或有事件</p>	
	<p>删除: 1、根据相关法律法规的规定,管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司。 委托人、托管人在此同意,如果或有事件发生,管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司,并无须就此项变更和委托人、托管人另行签订专项协议。但管理人应及时将此项变更书面通知托管人,并以管理人网站公告的形式通告委托人。 管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格,并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。 管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。</p>
<p>第 27 部分 其他事项</p>	
<p>本合同如有未尽事宜,由各方按有关法律法规和规定协商解决。 管理人、托管人确认,已向委托人明确说明集合计划的风险,不保证委托人资产本金不受损失或取得最低收益;委托人确认,已充分理解本合同的内容,自行承担投资风险和损失。 本合同应由委托人本人签署,当委托人为机构时,应由法定代表人或其授权签字人签署。</p>	<p>本合同如有未尽事宜,由各方按有关法律法规和规定协商解决。 管理人、托管人确认,已向委托人明确说明集合计划的风险,不保证委托人资产本金不受损失或取得最低收益;委托人确认,已充分理解本合同的内容,自行承担投资风险和损失。 除本合同明确约定外,如托管协议与本合同不一致之处,以本合同为准。 本合同应由委托人本人签署,当委托人为机构时,应由法定代表人或其授权签字人签署。</p>



附件二

关于安信证券策略优选 1 号集合资产管理计划合同变更的
回复意见函

本委托人 同意 / 不同意安信证券资产管理有限公司于 2022 年 1 月 25 日发布的《关于安信证券策略优选 1 号集合资产管理计划合同变更的公告》中有关安信证券策略优选 1 号集合资产管理计划合同变更相关事项。

特此函复。

委托人：

证件号码：

手机号码：

日期：



注：委托人在签署完毕后，请拍照或扫描发送至邮箱：axzg@essence.com.cn。