

## 关于华鑫证券鑫欣 1 号集合资产管理计划资产管理合同

### 补充协议一的征询意见函及临时开放期设置公告

尊敬的投资者：

华鑫证券鑫欣 1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由华鑫证券有限责任公司担任管理人、南京银行股份有限公司担任托管人，本集合计划于 2020 年 1 月 8 日成立。

现为投资者利益考虑，对《华鑫证券鑫欣 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：【HXZQXX-2019 第 1 号】）（以下简称“原合同”）中的投资限制条款进行修改，《华鑫证券鑫欣 1 号集合资产管理计划说明书》作为主合同的组成部分同步作变更，并按照合同约定向全体委托人征询意见。

我司确认并承诺更新或修改的内容不违反法律法规和中国证监会的有关规定，不损害投资者利益。我司与托管人（南京银行股份有限公司）协商确认，通过签署《华鑫证券鑫欣 1 号集合资产管理计划资产管理合同补充协议一》（合同编号：【HXZQXX-2019 第 1 号-补 1】）（以下简称《补充协议》）的方式对原合同内容进行更新或修改。

#### 一、主要变更事项的说明

（一）华鑫证券鑫欣 1 号集合资产管理计划资产管理合同（合同编号：【HXZQXX-2019 第 1 号】），本次合同变更主要内容为、“估值方法”、“信息披露与报告”、“资产管理合同的变更、终止与清算”及“投资限制”和新规等相关条款；

详细修订内容详见“第二章、华鑫证券鑫欣 1 号集合资产管理计划资产管理合同修订前后款对照表”，修改后的资产管理合同请参见华鑫证券鑫欣 1 号集合资产管理计划资产管理合同补充协议一（合同编号：【HXZQXX-2019 第 1 号-补 1】）。

（二）华鑫证券鑫欣 1 号集合资产管理计划说明书

《华鑫证券鑫欣 1 号集合资产管理计划说明书》对相应资产管理合同同步变更。

#### 二、华鑫证券鑫欣 1 号集合资产管理计划资产管理合同修订前后款对照表

变更前的条款	变更后的条款
第十一节“资产管理计划的投资”第五条“投资范围和投资组合设计”第（二）点 “本计划的投资比例和投资限制”第 2、3 小点	
2、投资限制（占集合计划资产总值） (1) 投资标准信用债债项评级为 AA（含）以上 (且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考，本条	2、投资限制 (1) 投资标准信用债债项评级为 AA（含）以上（若无债项评级，主体评级或担保机构评级需为 AA（含）以



不适用于无主体评级且无债项评级的债券)；

(2) 本计划不可投资于资产支持证券(票据)的次级, 仅限投资在交易所和银行间挂牌交易的资产支持证券;

(3) 本计划参与债券、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集合计划总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量;

(4) 本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过 200%;

(5) 本计划投资于同一资产的资金, 不得超过计划资产净值的 25%; 资产管理人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%。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;

(6) 本计划开放退出期内, 其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于该计划资产净值的 10%。

(7) 本产品主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。

### 3、投资比例超限的处理方式及流程

因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本集合计划投资不符合法律法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的, 资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的, 资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

上, 资产支持证券(票据)及可转债、可交换债不受此条限制; 短期融资券发行人主体评级不得低于 AA, 或短期融资券债项评级不低于 A-1; 评级数据使用国内评级机构(不包含中债资信, 范围以管理人确定的口径为准)的数据;

(2) 本计划不可投资于资产支持证券(票据)的次级, 仅限投资在交易所和银行间挂牌交易的资产支持证券(票据);

(3) 本计划参与债券、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集合计划总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量;

(4) 本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过 200%;

(5) 本计划投资于同一资产的资金, 不得超过计划资产净值的 25%; 资产管理人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%。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;

(6) 本计划开放退出期内, 其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于该计划资产净值的 10%。

(7) 本产品主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。

(8) 本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产 50%的, 本计划总资产不得超过净资产的 120%。投资于国债、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不受前述规定的限制。

### 3、投资比例超限的处理方式及流程

因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本集合计划投资不符合法律法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的, 资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的, 资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

## 第十一节“资产管理计划的投资”第五条“投资范围和投资组合设计”第(二)点

### “本计划的投资比例和投资限制”第 4 小点以后的序号错误及内容

4、在本集合计划成立之日起六个月内, 可不受上述投资比例限制, 但应当符合本集合计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。因证券市场波动、上市

5、在本集合计划成立之日起六个月内, 可不受上述投资比例限制, 但应当符合本集合计划合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。因证券市场波动、



公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本计划投资比例超标的，管理人应自可交易之日起的 15 个工作日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。

5、本计划存续期间，为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%，管理人应详细列明上述相关特定风险。上述相关特定风险包括但不限于以下内容：

.....

上市公司合并、资产管理计划规模变动等客观因素导致本计划投资比例超标的，管理人应自可交易之日起的 20 个工作日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。

6、本计划存续期间，为规避特定风险并经全体投资者同意的，投资于债权类资产的比例可以低于计划总资产 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产 80%，管理人应详细列明上述相关特定风险。上述相关特定风险包括但不限于以下内容：

.....

## 第十九节“资产管理计划财产的估值和会计核算”第七条“估值方法”的内容

### 七、估值方法

估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、《证券公司金融工具估值指引》、《企业会计准则》、《指导意见》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定、资产管理计划净值计价及风险控制要求，确认和计量资产管理计划净值。

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。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

管理人应当定期对本集合计划的估值执行效果进行评估，必要时调整完善，保证公平、合理。

当有充分证据表明本集合计划相关资产的计量方法已不能真实公允反映其价值时，管理人应当与托管人进行协商，即使采用公允价值计量方法对资产管理计划净值进行调整。

#### (一) 债券估值方法

1、在证券交易所市场挂牌实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；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，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

2、在证券交易所市场挂牌未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去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所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最

### 七、估值方法

估值坚持公允价值计量，符合本合同、《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《指导意见》、《资管产品相关会计处理规定》以及中国证监会关于资产管理计划对金融工具进行核算与估值的规定、资产管理计划净值计价及风险控制要求及其他法律、法规、自律组织的规定，应当按照《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》的规定，对以摊余成本计量的金融资产和分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产，以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。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。

估值的基本原则：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值。估值日无市价，但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的，应采用最近交易市价确定公允价值。如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化且证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，应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，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

(2) 对不存在活跃市场的投资品种，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。运用估值技术得出的结果，应反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。采用估值技术确定公允价值时，应尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数，并通过定期校验，确保估值技术的有效性。



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,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。

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。

4、在对银行间市场的固定收益品种估值时,应主要依据中债估值为主,同时参考中证估值、CFETS估值和上清所估值等第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

5、在交易所挂牌转让的资产支持专项计划、资产支持证券(票据),按成本估值,每日计提收益。管理人应持续评估上述估值方法的适当性,并在情况发生变化时进行适宜的调整。

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。

7、商业银行理财计划、信托计划、保险公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、证券公司资产管理计划等按照最近公布的份额净值估值;如未公布产品份额净值,管理人将按照成本价估值。

#### (二) 证券投资基金估值方法

1、持有的交易所基金,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,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。

2、持有的场外基金,估值日证券投资基金管理人提供单位净值的,按证券投资基金管理人提供的估值日单位净值估值;估值日证券投资基金管理人未提供单位净值,且从最近净值提供日到估值日整体市场环境及投资标的未发生重大变化的,可参考最近可获取的单位净值确定公允价值。

3、持有的货币市场基金,按基金公司公布的当日的每万份收益逐日计提收益;估值日无公布的,按最近交易日公布的每万份收益逐日计提收益估值。

#### (三) 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计提利息。如提前支取或利率发生变化,将及时进行账务调整。

(四) 逆回购以成本列示,按照预期收益率逐日计提利息。

(五) 债券计提每日利息,股票红利按税后计算投资收益。

(六) 如有新增事项或变更事项,按国家最新规定估

(3) 有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的,资产管理人应根据具体情况与托管人进行商定,按最能恰当反映公允价值的价格估值。

#### (一) 投资固定收益品种的估值方法

本节所称的固定收益品种,包括在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、可交换债券、私募债、证券公司短期债、资产支持证券、非公开定向债务融资工具、同业存单等债券投资品种,以及同业存款、债券回购等其他在活跃市场中没有报价但回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

1、对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种,选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价,管理人应根据相关法律、法规的规定进行涉税处理(下同)。

2、对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种,选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。

对于含投资者回售权的固定收益品种,行使回售权的,在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价,同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日(含当日)后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

3、对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券,实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价;实行净价交易的债券建议选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

4、对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

#### (二) 证券投资基金估值方法

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>值。</p> <p>(七) 如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的, 管理人可根据具体情况, 在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上, 在与托管人商议后, 按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。</p> <p>(八) 当市场发生极端的流动性不足或者证券被停牌, 合同终止无法变现的资产处理由合同各方根据相关法律法规, 视具体情况就资产变现、估值等事宜协商解决。</p> <p>(九) 如管理人或托管人发现计划估值违反资产管理合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益时, 应立即通知对方, 共同查明原因, 双方协商解决。</p> <p>(十) 根据有关法律法规, 资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任。</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)), 按估值日前一交易日的基金份额净值估值; 估值日前一交易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>持有的货币市场基金, 按基金管理人公布的估值日的每万份收益计算; 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><b>(三)、银行存款以成本列示, 按商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, 如有差额, 不做追溯调整;</b></p> <p>相关法律法规以及监管部门有强制规定, 从其规定, 如有新增事项, 按国家最新规定估值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的, 管理人可根据具体情况, 在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上, 在与托管人商议后, 按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。当市场发生极端的流动性不足或者证券被停牌, 合同终止无法变现的资产处理由合同各方根据相关法律法规, 视具体情况就资产变现、估值等事宜协商解决。</p> <p>如管理人或托管人发现集合估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益的时候, 应立即通知对方, 共同查明原因, 双方协商解决。</p> <p>暂停估值的情形: 集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其他原因暂停营业时, 或因其他任何不可抗力致使管理人无法准确评估集合计划资产价值时, 可暂停估值。但估值条件恢复时, 管理人必须按规定完成估值工作。</p>
---	--

**第二十二节 “信息披露与报告” 第二条 “临时报告” 的内容**

<p>集合计划存续期间, 发生对集合计划持续运营、客户利益、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五个工作日内以管理人网站公告方式及时向投资者披露(其中第七条重大违法违规发生之日起两个工作日内), 并报中国证券投资基金业协会备案, 同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。临时报告的情形包括但不限于:</p> <p>(一) 集合计划运作过程中, 负责集合资产管理业务的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、投资者利益、资产净值产生重大影响的事项。</p>	<p>集合计划存续期间, 发生对集合计划持续运营、客户利益、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五个工作日内以管理人网站公告方式及时向投资者披露(其中第七条重大违法违规发生之日起两个工作日内)。临时报告的情形包括但不限于:</p> <p>(一) 集合计划运作过程中, 负责集合资产管理业务的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、投资者利益、资产净值产生重大影响的事项。</p> <p>(二) 发生巨额退出并延期支付。</p> <p>(三) 集合计划终止和清算。</p>
---	---



<p>(二) 发生巨额退出并延期支付。</p> <p>(三) 集合计划终止和清算。</p> <p>(四) 合同的补充、修改与变更。</p> <p>(五) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁、财产纠纷事项。</p> <p>(六) 集合计划投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券。</p> <p>(七) 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>(八) 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>(九) 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划, 应向投资者充分披露。</p> <p>(十) 管理人因私募资产管理业务被中国证监会及相关派出机构、其他金融监督管理机构采取行政监管措施或行政处罚, 或被中国证券业协会、中国期货业协会、交易场所和登记结算机构采取自律管理措施或纪律处分的, 应在收到相关措施或处理决定后二个工作日内向证券投资基金业协会报告。</p> <p>(十一) 其他管理人认为的重大事项。</p>	<p>(四) 合同的补充、修改与变更。</p> <p>(五) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁、财产纠纷事项。</p> <p>(六) 集合计划投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券。</p> <p>(七) 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>(八) 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>(九) 管理人因私募资产管理业务被中国证监会及相关派出机构、其他金融监督管理机构采取行政监管措施或行政处罚, 或被中国证券业协会、中国期货业协会、交易场所和登记结算机构采取自律管理措施或纪律处分的, 应在收到相关措施或处理决定后二个工作日内向证券投资基金业协会报告。</p> <p>(十) 其他管理人认为的重大事项。</p> <p>管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划, 应向投资者充分披露。</p> <p>管理人向投资者提供的信息披露文件, 应当及时报送中国证监会相关派出机构或证券投资基金业协会, 具体的报送时间、方式及途径以中国证监会相关派出机构或证券投资基金业协会等监管机构规定的为准。若中国证券投资基金业协会等金融监管部门对资产管理计划信息披露规定进行修订或/和更新, 则本集合计划的信息披露事项约定以金融监管部门修订或/和更新后的规定为准。</p>
<p><b>第二十四节 “资产管理合同的变更、终止与清算” 第三条 “集合计划的清算” 第</b></p> <p><b>(一) 点的内容</b></p>	
<p>(一) 自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组, 集合计划清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师组成。清算小组可以聘请必要的工作人员。集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算。</p> <p>集合计划清算小组负责本集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划清算小组可以依法以集合计划的名义进行必要的民事活动。</p>	<p>(一) 自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组, 集合计划清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人组成, 清算小组可以聘请必要的工作人员。集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算。</p> <p>集合计划清算小组负责本集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配。集合计划清算小组可以依法以集合计划的名义进行必要的民事活动。</p>
<p><b>附件五 “投资监督事项表” 序号二 “投资比例及投资限制”</b></p>	
<p>1、本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例如</p>	<p>1、本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例</p>



下所列:

固定收益类资产占集合计划资产总值的比例为 80-100%;债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的 0-100%。

2、投资限制 (占集合计划资产总值)

(1) 投资标准信用债债项评级为 AA (含) 以上 (且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考, 本条不适用于无主体评级且无债项评级的债券);

(2) 本计划不可投资于资产支持证券 (票据) 的次级, 仅限投资在交易所和银行间挂牌交易的资产支持证券;

(3) 本计划参与债券、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集合计划总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量;

(4) 本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过 200%;

(5) 本计划投资于同一资产的资金, 不得超过计划资产净值的 25%; 资产管理人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%。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;

(6) 本计划开放退出期内, 其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于该计划资产净值的 10%;

(7) 本产品主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。

如下所列:

固定收益类资产占集合计划资产总值的比例为 80-100%;债券正回购融入的资金余额占集合计划资产净值的 0-100%。

2、投资限制

(1) 投资标准信用债债项评级为 AA (含) 以上 (若无债项评级, 主体评级或担保机构评级需为 AA (含) 以上, 资产支持证券 (票据) 及可转债、可交换债不受此条限制; 短期融资券发行人主体评级不得低于 AA, 或短期融资券债项评级不低于 A-1; 评级数据使用国内评级机构 (不包含中债资信, 范围以管理人确定的口径为准) 的数据;

(2) 本计划不可投资于资产支持证券 (票据) 的次级, 仅限投资在交易所和银行间挂牌交易的资产支持证券 (票据);

(3) 本计划参与债券、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集合计划总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量;

(4) 本计划的计划资产总值占计划资产净值的比例不得超过 200%;

(5) 本计划投资于同一资产的资金, 不得超过计划资产净值的 25%; 资产管理人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%。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;

(6) 本计划开放退出期内, 其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于该计划资产净值的 10%。

(7) 本产品主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。

(8) 本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产 50%的, 本计划总资产不得超过净资产的 120%。投资于国债、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不受前述规定的限制。

原合同中, 封面上的“(券商结算模式)”更正为“托管行结算模式”

### 三、本计划托管人对本次合同变更的意见

托管人南京银行股份有限公司通过签署补充协议同意本次合同变更事宜, 请参见“《关于华鑫证券鑫



欣1号集合资产管理计划资产管理合同补充协议一的征询函》的回函”。

#### 四、向全体投资者征询意见及后续安排

根据《华鑫证券鑫欣1号集合资产管理计划资产管理合同》第二十四节、第一条、第(二)款“除上述(一)所述情形外需要变更合同的,管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以邮件或者管理人网站公告方式(由管理人决定)向投资者发送合同变更征询意见函(或通知)。投资者应在征询意见函(或通知)指定的日期内(不得多于5个工作日)按指定形式回复意见。投资者不同意变更的,应在征询意见函(或通知)指定的日期内即临时开放期内提出退出本集合计划的申请;投资者未在指定日期内即临时开放期内回复意见或未在指定日期内提出退出本集合计划申请的,视为投资者同意合同变更。如投资者同意变更,则变更事项自征询意见函(或通知)约定的日期开始生效,对合同各方均具有法律效力。”之约定。

本征询意见函及临时开放期设置公告将通过管理人网站公告向各投资者征询意见。我司将设置临时开放期合理保障投资者选择退出资产管理计划的权利,临时开放期为2023年3月28日,共1个工作日。

投资者应在临时开放期内以邮件形式回复意见并发送至我司邮箱:zcglb@cfsc.com.cn

投资者不同意变更的,可在临时开放期内提出退出本集合计划的申请;对于投资者在临时开放期内提出的退出申请,管理人将于临时开放日当日为投资者办理退出;投资者未在临时开放期内回复意见或未在临时开放期内提出退出本集合计划申请的,视为投资者同意合同变更。如投资者同意变更,则变更事项自征询意见函(或通知)指定的日期届满的最后一工作日开始生效,对合同各方均具有法律效力。

#### 五、合同变更的效力及生效时间

本征询意见函及临时开放期设置公告构成变更后合同的组成部分,变更后的合同将于2023年3月29日(含)正式生效。

如有疑问,请拨打客服热线:95323。

特此公告。

