

关于安信资管策略优选2号集合资产管理计划

合同变更的公告

根据《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》，及合同“第25部分、资产管理合同的变更、终止与财产清算”的规定，经与托管人平安银行股份有限公司协商一致，管理人安信证券资产管理有限公司将对《安信资管策略优选2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：

主要变更内容详情请详见附件1《安信资管策略优选2号集合资产管理计划合同修订对照表》。

二、合同变更安排

1、征询意见期

本次变更征询意见期为：2023年3月10日至2023年3月16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2《关于安信资管策略优选2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2023年3月14



日至2023年3月16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2023年3月16日日终做强制退出处理。

三、合同变更生效日

合同变更生效日为征询意见期结束次一工作日，即2023年3月17日。

四、其他事项

1、安信资管策略优选2号集合资产管理计划将于征询意见期内周一、周三、周五正常办理参与业务，于2023年3月14日以及2023年3月16日正常办理退出业务，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

2023年3月9日



附件1：安信资管策略优选2号集合资产管理计划合同修订对照表

| 变更前 | 变更后 |
|---|---|
| 第1部分 前言 | |
| 一、订立本资产管理合同（以下简称“本合同”）的依据包括但不限于《中华人民共和国证券投资基金法》…… | 一、订立本资产管理合同（以下简称“本合同”）的依据包括但不限于《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》…… |
| 四、管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。 | 四、管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会进行备案。 |
| 第2部分 释义 | |
| 删除： 托管协议：指《安信资管策略优选2号集合资产管理计划托管协议》及其的任何修订和补充； | |
| 《管理办法》：指2018年10月22日经中国证券监督管理委员会公布并自公布之日起实施的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第151号）； | 《管理办法》：指2023年1月12日经中国证券监督管理委员会公布并自2023年3月1日起实施的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第203号）及其修订； |
| 《运作管理规定》：指2018年10月22日经中国证券监督管理委员会公布并自公布之日起实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2018]31号）； | 《运作管理规定》：指2023年1月12日经中国证券监督管理委员会公布并自2023年3月1日起实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2023]2号）及其修订； |
| 合格投资者： …… (4) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构； | 合格投资者： …… (4) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、商业保理子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构； |
| 第4部分 当事人及权利义务 | |
| (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 住所：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 通讯地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦A座27层 邮政编码：518026 联系人：马志茹 联系电话：0755-88027228 | (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 住所：深圳市福田区福田街道福安社区福华一路119号安信金融大厦21楼、22楼 通讯地址：深圳市福田区福田街道福安社区福华一路119号安信金融大厦21楼、22楼 邮政编码：518046 联系人：马志茹 联系电话：0755-81681509 |
| (四) 管理人的义务 21、根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构 | (四) 管理人的义务 21、根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，并报送中国证监会相关派出机构； |
| 第5部分 资产管理计划的基本情况 | |
| 四、资产管理计划的投资 (二) 主要投资方向 1、符合《指导意见》规定的标准化债权类资产、标准化股权类资产、标准化商品及金融衍生品，公开募集证券投资基金（公募基金）； …… | 四、资产管理计划的投资 (二) 主要投资方向 1、符合《指导意见》规定的标准化债权类资产、标准化股权类资产、标准化期货和衍生品类资产，公开募集证券投资基金（公募基金）； …… |
| 四、资产管理计划的投资 (三) 投资比例 3、本资产管理计划投资商品及金融衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过80%或衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的20%； | 四、资产管理计划的投资 (三) 投资比例 3、本资产管理计划投资期货和衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过80%或期货和衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的20%； |
| 第6部分 资产管理计划的募集 | |
| 一、资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限 (一) 募集对象 …… 合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于本资产管理计划不低于40万元（不含认购费/参与费）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织： …… 3、依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构； | 一、资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限 (一) 募集对象 …… 合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于本资产管理计划不低于40万元（不含认购费/参与费）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织： …… 3、依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业保理子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构； |

| | |
|---|--|
| <p>.....</p> <p>参与本资产管理计划的投资者如属于上述第4类“接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品”的，该资产管理产品的投资者中不得存在其他私募资产管理产品。该资产管理产品的管理人如有义务如实配合向本资产管理计划的销售机构、管理人提供投资者明细，否则，销售机构、管理人有权拒绝其参与本资产管理计划。该资产管理产品的投资者提供信息有误、造成本资产管理计划的销售机构、管理人损失的，应向销售机构、管理人赔偿损失。若前述投资者信息发生实质性变更，该资产管理产品的管理人承诺将及时告知本资管计划的管理人，并承诺不会出现导致本资管计划发生多层嵌套的情形。</p> | <p>.....</p> <p>参与本资产管理计划的投资者如属于上述第4类“接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品”的，该资产管理产品的投资者中不得存在其他私募资产管理产品。该资产管理产品的管理人如有义务如实配合向本资产管理计划的销售机构、管理人提供投资者明细，否则，销售机构、管理人有权拒绝其参与本资产管理计划。该资产管理产品的管理人提供信息有误、造成本资产管理计划的销售机构、管理人损失的，应向销售机构、管理人赔偿损失。若前述投资者信息发生实质性变更，该资产管理产品的管理人承诺将及时告知本资管计划的管理人，并承诺不会出现导致本资管计划发生多层嵌套的情形。</p> |
| <p>第8部分 资产管理计划的参与、退出与转让</p> | |
| <p>二、参与和退出的开放日和时间</p> <p>本资产管理计划自成立之日起，封闭运作满3个月开放，开放期为每周一、周三、周五（如遇非工作日不开放、不顺延）。</p> <p>本资产管理计划对每份份额设置6个月的最短持有期，每份份额自参与申请日（募集期认购的，为本资产管理计划成立之日）起6个月后的月度对应日（含该日）可以申请退出，若该月度对应日为非开放期，则顺延至最近一个开放日（即周一/周三/周五），此后可以在开放期（即每周一、周三、周五）申请退出。</p> <p>红利再投资所形成的资产管理计划份额，其最短持有期起始日与享受该红利的对应原资产管理计划份额相同。</p> <p>除法律法规、监管规定、开放期、本资产管理合同另有约定外，本资产管理计划不允许投资者参与或退出。</p> <p>特别风险提示：初始募集期认购的份额，自本资产管理计划成立之日起至6个月后的月度对应日（若该月度对应日为非开放期，则顺延至最近一个开放日）之前，投资者面临无法退出本资产管理计划的风险。</p> <p>除退出开放期、法律法规、监管规定另有规定或本资产管理计划合同另有约定外，投资者存在无法退出本资产管理计划的风险。</p> <p>举例1（对于初始募集期认购份额）：对于初始募集期认购的份额，假设本资产管理计划成立日为2022年1月26日，自成立之日起6个月后的月度对应日为2022年7月26日（周二），由于周二为非开放期，因此初始募集期认购的份额顺延至最近一个开放日2022年7月27日（周三）起可申请退出，此后的每周一、周三、周五可申请退出。</p> <p>举例2（月度对应日为开放期的情形）：假设投资者于2022年5月11日申请参与本资产管理计划，参与申请日为2022年5月11日，自参与申请日起满6个月后的月度对应日为2022年11月11日（周五），则此次参与的份额自2022年11月11日（周五）起可申请退出，此后每周一、周三、周五可申请退出。</p> <p>举例3（月度对应日为非开放期，顺延至最近一个开放日的情形）：假设投资者于2022年5月17日申请参与本资产管理计划，参与申请日为2022年5月17日，自参与申请日起满6个月后的月度对应日为2022年11月17日（周四），由于周四为非开放期，因此此次参与的份额顺延至最近一个开放日2022年11月18日（周五）起可申请退出，此后每周一、周三、周五可申请退出。</p> | <p>二、参与和退出的开放日和时间</p> <p>本资产管理计划的开放期为每周一、周三、周五（如遇非工作日，不开放、不顺延）。在开放期内，投资者可以申请参与或退出本资产管理计划。管理人有权根据实际情况调整开放期的日期、天数及参与、退出安排并提前公告，本集合计划每周开放最多不超过3个工作日（含）。</p> <p>除法律法规、监管规定、开放期、本资产管理合同另有约定外，本资产管理计划不允许投资者参与或退出。</p> |
| <p>五、参与和退出的金额限制</p> <p>.....</p> <p>投资者部分退出资产管理计划的，单笔退出最低份额为1万份，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。投资者没有一次性申请全部退出的，管理人将在退出申请确认日对该投资者所持有的全部份额做退出确认。为符合法律法规、监管规定的要求，投资者因持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额，而触发的前述退出申请，不受本资产管理计划6个月最短持有期限限制。因份额强制退出可能会导致投资者发生实际的投资损益，投资者承诺已知悉并自愿承担强制退出的风险。</p> <p>举例说明：假设投资者A于2022年5月11日申请参与本资产管理计划，参与份额为50万份，则此次参与的50万份自2022年11月11日（周五）起可申请退出。若投资者A于2022年6月13日追加参与了1万份，按照每份6个月最短持有期的要求，原则上追加参与的1万份自2022年12月14日（周三）起可申请退出。但是，如果投资者A于2022年11月11日申请退出首次参与的50万份，由于退出后其剩余的1万份不满足规定的合格投资者最低参与金额，因此应当一次性全部退出；投资者没有一次申请全部退出的，管理人将对投资者所持有的全部份额做退出确认。这种情况下追加参与的1万份不受本资产管理计划6个月最短持有期限限制。</p> <p>本资产管理计划在退出开放期无退出次数限制。</p> | <p>五、参与和退出的金额限制</p> <p>.....</p> <p>投资者部分退出资产管理计划的，单笔退出最低份额为1万份，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。投资者没有一次性申请全部退出的，管理人将在退出申请确认日对该投资者所持有的全部份额做退出确认。</p> <p>本资产管理计划的退出费率按照份额持有人持有该份额的时间分段设定：持有期限小于180天时退出费率为1%；持有期限大于等于180天但小于365天时退出费率为0.50%；持有期限大于等于365天时退出费率为0。当触发前述份额强制退出情形时，持有期限小于365天的份额会按照前述退出费率收取相应的赎回费。投资者面临强制退出时产生赎回费用的风险。</p> <p>因份额强制退出可能会导致投资者发生实际的投资损益，投资者承诺已知悉并自愿承担强制退出的风险。</p> |

| | | | | | | | | | |
|---|--|----------|------|-----------|----|-------------------|-------|-----------|----|
| <p>六、参与和退出费用</p> <p>(二) 资产管理计划退出的费用</p> <p>本资产管理计划不收取退出费用。</p> | <p>六、参与和退出费用</p> <p>(二) 资产管理计划退出的费用</p> <p>本资产管理计划的退出费率按份额持有人持有该份额的时间分段设定如下，退出费 100% 归属于管理人。</p> <table border="1" data-bbox="858 264 1109 376"> <tr> <td>持有期限 (T)</td> <td>退出费率</td> </tr> <tr> <td>T < 180 日</td> <td>1%</td> </tr> <tr> <td>180 日 ≤ T < 365 日</td> <td>0.50%</td> </tr> <tr> <td>T ≥ 365 日</td> <td>0%</td> </tr> </table> | 持有期限 (T) | 退出费率 | T < 180 日 | 1% | 180 日 ≤ T < 365 日 | 0.50% | T ≥ 365 日 | 0% |
| 持有期限 (T) | 退出费率 | | | | | | | | |
| T < 180 日 | 1% | | | | | | | | |
| 180 日 ≤ T < 365 日 | 0.50% | | | | | | | | |
| T ≥ 365 日 | 0% | | | | | | | | |
| <p>七、参与份额和退出金额的计算方式</p> <p>(二) 退出金额的计算方式</p> <p>退出金额 = 退出份额 × T 日集合计划单位净值 - 业绩报酬 (如有)</p> | <p>七、参与份额和退出金额的计算方式</p> <p>(二) 退出金额的计算方式</p> <p>退出金额 = 退出份额 × T 日集合计划单位净值</p> <p>退出费用 = 退出金额 × 退出费率</p> <p>退出净额 = 退出金额 - 退出费用 - 业绩报酬 (如有)</p> | | | | | | | | |
| <p>九、巨额退出或连续退出</p> <p>(一) 巨额退出</p> <p>2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>.....</p> <p>部分顺延退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者的退出申请可能对资产管理计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于上一日资产管理计划总份额的 10% 的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，应当按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；.....</p> | <p>九、巨额退出或连续退出</p> <p>(一) 巨额退出</p> <p>2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>.....</p> <p>部分顺延退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者的退出申请可能对资产管理计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出比例不低于上一日资产管理计划总份额的 10% 的前提下，可以对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，应当按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出份额；.....</p> | | | | | | | | |
| <p>十四、管理人自有资金参与及退出</p> <p>(一) 自有资金参与</p> <p>2、自有资金参与的方式</p> <p>管理人自有资金持有的份额与其他投资者持有的份额享有同等权益、承担同等风险。管理人自有资金不对投资者的本金和收益进行赔付。参与时，管理人应当提前 5 个工作日告知投资者和托管人。</p> <p>3、自有资金参与的金额和比例</p> <p>(1) 如管理人及其附属机构以自有资金参与本资产管理计划的，管理人自有资金参与资产管理计划的份额不超过资产管理计划总份额的 15%，管理人及其附属机构以自有资金参与资产管理计划的份额合计不得超过资产管理计划总份额的 50%。</p> <p>(2) 本资产管理计划份额增加时，管理人有权增加自有资金参与份额，但参与比例不能超过上述第 (1) 条的限制。</p> <p>本资产管理计划因规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与本资产管理计划比例被动超过法律、法规及本合同规定的上限时，管理人应及时退出自有资金持有的超限部分资产管理计划份额。</p> | <p>十四、管理人自有资金参与及退出</p> <p>(一) 自有资金参与</p> <p>2、自有资金参与的方式</p> <p>管理人自有资金持有的份额与其他投资者持有的份额享有同等权益、承担同等风险。管理人自有资金不对投资者的本金和收益进行赔付。参与时，管理人应当提前 5 个工作日告知投资者和托管人，并取得其同意。</p> <p>3、自有资金参与的金额和比例</p> <p>(3) 如管理人及其子公司以自有资金参与本资产管理计划的，管理人自有资金参与资产管理计划的份额不超过资产管理计划总份额的 15%，管理人及其子公司以自有资金参与资产管理计划的份额合计不得超过资产管理计划总份额的 50%。</p> <p>(4) 本资产管理计划份额增加时，管理人有权增加自有资金参与份额，但参与比例不能超过上述第 (1) 条的限制。</p> <p>本资产管理计划因规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与本资产管理计划比例被动超过法律、法规及本合同规定的上限时，管理人应及时退出自有资金持有的超限部分资产管理计划份额。</p> | | | | | | | | |
| <p>十四、管理人自有资金参与及退出</p> <p>(二) 自有资金退出</p> <p>资产管理计划存续期间，管理人自有资金参与资产管理计划的持有期限不少于 6 个月时，可以退出资产管理计划。退出时，管理人应当提前 5 个工作日告知投资者和托管人。</p> <p>(三) 为应对资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及后续退出集合资产管理计划可不受上述第 (一)、(二) 条的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会报告。</p> | <p>十四、管理人自有资金参与及退出</p> <p>(二) 自有资金退出</p> <p>资产管理计划存续期间，管理人自有资金参与资产管理计划的持有期限不少于 6 个月时，可以退出资产管理计划。退出时，管理人应当提前 5 个工作日告知投资者和托管人，并取得其同意。</p> <p>(三) 为应对资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其子公司以自有资金参与及后续退出集合资产管理计划可不受上述第 (一)、(二) 条的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> | | | | | | | | |
| <p>第 11 部分 资产管理计划的投资</p> | | | | | | | | | |
| <p>二、投资范围及比例</p> <p>(一) 投资范围</p> <p>3、股指期货、国债期货、商品期货、交易所期权等标准化商品及金融衍生品；</p> | <p>二、投资范围及比例</p> <p>(一) 投资范围</p> <p>3、股指期货、国债期货、商品期货、交易所期权等标准化期货和衍生品类资产；</p> | | | | | | | | |
| <p>二、投资范围及比例</p> <p>(二) 投资比例</p> <p>3、本资产管理计划投资商品及金融衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过 80% 或衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的 20%；</p> | <p>二、投资范围及比例</p> <p>(二) 投资比例</p> <p>3、本资产管理计划投资期货和衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过 80% 或期货和衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的 20%；</p> | | | | | | | | |
| <p>三、投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>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之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政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，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 15 个工作日内调整至符合要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相</p> | <p>三、投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>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之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政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，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 20 个工作日内调整至符合要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中</p> | | | | | | | | |

| | |
|---|---|
| 关派出机构和证券投资基金业协会报告。 | 国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。 |
| <p>四、风险收益特征</p> <p>本资产管理计划属于混合类集合资产管理计划，理论上其预期风险和预期收益低于商品及金融衍生品类集合资产管理计划、权益类集合资产管理计划，高于固定收益类集合资产管理计划。</p> | <p>四、风险收益特征</p> <p>本资产管理计划属于混合类集合资产管理计划，理论上其预期风险和预期收益低于期货和衍生品类集合资产管理计划、权益类集合资产管理计划，高于固定收益类集合资产管理计划。</p> |
| <p>六、投资策略</p> <p>(四) 投资管理的方法和标准</p> <p>4、衍生品投资策略</p> <p>.....</p> | <p>六、投资策略</p> <p>(四) 投资管理的方法和标准</p> <p>4、期货和衍生品投资策略</p> <p>.....</p> |
| <p>七、投资限制</p> <p>(六) 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资产管理计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> | <p>七、投资限制</p> <p>(六) 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，所申报的金额原则上不得超过资产管理计划的总资产，所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>新增：</p> <p>(八) 本资产管理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其净资产 50%的，本资产管理计划的总资产不得超过净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、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限制。</p> |
| <p>十、投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配</p> <p>本资产管理计划退出开放期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值不低于本资产管理计划资产净值的 10%。7 个工作日可变现资产包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款、7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。</p> | <p>十、投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配</p> <p>本资产管理计划退出开放期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值不低于本资产管理计划资产净值的 10%。7 个工作日可变现资产包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及标准化期权合约和同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款、7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。</p> |
| 第 14 部分 利益冲突及关联交易 | |
| <p>一、资产管理计划在的或可能存在利益冲突的情形</p> <p>(二) 管理人及其附属机构以自有资金参与本资产管理计划；</p> | <p>一、资产管理计划在的或可能存在利益冲突的情形</p> <p>(二) 管理人及其子公司以自有资金参与本资产管理计划；</p> |
| <p>二、利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率</p> <p>(二) 利益冲突的披露方式、披露内容以及披露频率</p> <p>管理人运用受托管理资产从事上述法律法规、监管规定允许的的利益冲突交易的，将在交易发生后及时以公告的方式，充分地 向托管人和投资者披露，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货还应当 向证券期货交易所报告。</p> | <p>二、利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率</p> <p>(二) 利益冲突的披露方式、披露内容以及披露频率</p> <p>管理人运用受托管理资产从事上述法律法规、监管规定允许的的利益冲突交易的，将在交易发生后及时以公告的方式，充分地 向托管人和投资者披露，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> |
| 第 15 部分 投资经理的指定与变更 | |
| <p>三、投资经理离任的，管理人应当对其进行离任审查，并自离任之日起三十个工作日内将审查报告报送中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会。</p> | <p>三、投资经理离任的，管理人应当对其进行离任审查，并自离任之日起三十个工作日内将审查报告报送中国证监会相关派出机构。</p> |
| 第 19 部分 越权交易 | |
| <p>二、越权交易的处理程序</p> <p>(三) 非因管理人主观因素导致本资产管理计划投资突破本合同投资范围中约定的投资比例的，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 15 个工作日内调整完毕。法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。</p> | <p>二、越权交易的处理程序</p> <p>(三) 非因管理人主观因素导致本资产管理计划投资突破本合同投资范围中约定的投资比例的，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 20 个工作日内调整完毕。法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。</p> |
| 第 20 部分 资产管理计划财产的估值和会计核算 | |
| <p>三、估值方法</p> <p>(三) 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或挂牌转让的不含权债券，选取中证指数行情提供的相应品种当日的估值净价。</p> <p>对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权债券，选取中证指数行情提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。</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交换债，选取每日收盘价作为估值净价。</p> <p>对于在交易所市场挂牌转让的非公开发行债券，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>三、估值方法</p> <p>(三) 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或挂牌转让的不含权债券，选取中证指数行情提供的相应品种当日的估值全价。</p> <p>对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权债券，选取中证指数行情提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。对于含投资人回售权的债券，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间建议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。</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作为估值全价进行估值；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作为估值全价进行估值。</p> <p>对于在交易所市场上市净价交易的公募可交换债，选取每日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。</p> <p>对于在交易所市场挂牌转让的非公开发行债券，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</p> |

| | |
|--|--|
| <p>2、银行间市场交易的债券，按如下估值方式处理： 对于在银行间市场上不含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的估值净价。 对于在银行间市场上含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。对于含投资人回售权的债券，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。 对于银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用估值技术确定公允价值。 3、对于银行间市场发行的资产支持证券按中央国债登记结算公司提供的估值价进行估值。对于在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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。 4、交易所违约债的估值按中证提供的特殊证券估值方法进行估值，银行间的违约债按中债提供的特殊证券估值方法进行估值。 在任何情况下，管理人如采用本小项规定的方法对委托资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。 法律法规、监管规定有最新规定的，按其规定进行估值。 （四）同业存单的估值 同业存单按估值日中债估值提供的估值净价估值，中债估值未提供价格的，按成本估值。</p> | <p>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。 2、银行间市场交易的债券，按如下估值方式处理： 对于在银行间市场上不含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的估值净价。 对于在银行间市场上含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。对于含投资人回售权的债券，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间建议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净价或推荐估值净价，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。 对于银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值全价的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用估值技术确定公允价值。 3、对于银行间市场发行的资产支持证券按中央国债登记结算公司提供的估值全价进行估值。对于在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用第三方机构（此处指中证指数有限公司）提供的估值全价确定公允价值；第三方机构无法提供估值全价时，采用估值技术确定公允价值。 4、交易所违约债的估值按中证提供的特殊证券估值方法进行估值，银行间的违约债按中债提供的特殊证券估值方法进行估值。 在任何情况下，管理人如采用本小项规定的方法对委托资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。 法律法规、监管规定有最新规定的，按其规定进行估值。 （四）同业存单的估值 同业存单按估值日中债估值提供的估值全价估值，中债估值未提供价格的，按成本估值。</p> |
| <p>第 24 部分 风险揭示</p> | |
| <p>二、本资产管理计划特有风险 （六）无法退出风险 本资产管理计划对每份份额设置 6 个月的最短持有期，每份份额自参与申请日（募集期认购的，为本资产管理计划成立之日）起 6 个月后的月度对应日后（含该日）可以申请退出，若该月度对应日为非开放期，则顺延至最近一个开放日（即周一/周三/周五），此后可以在开放期（即每周一、周三、周五）申请退出。 特别提示，初始募集期认购的份额，自本资产管理计划成立之日起至 6 个月后的月度对应日（若该月度对应日为非开放期，则顺延至最近一个开放日）之前，投资者面临无法退出本资产管理计划的风险。 除法律法规、监管规定、退出开放期或本资产管理合同另有约定之外，存续期其余时间不办理退出业务，投资者面临无法退出的风险。</p> | <p>二、本资产管理计划特有风险 （六）无法退出风险 除法律法规、监管规定、退出开放期或本资产管理合同另有约定之外，存续期其余时间不办理退出业务，投资者面临无法退出的风险。</p> |
| <p>（七）强制退出风险 投资者部分退出资产管理计划的，单笔退出最低份额为 1 万份，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。投资者没有一次性申请全部退出的，管理人将在退出申请确认日对该投资者所持有的全部份额做退出确认，投资者将面临全部份额被退出的风险。为符合法律法规、监管规定的要求，投资者因持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额，而触发的前述退出申请，不受本资产管理计划 6 个月最短持有期限限制。因份额强制退出可能会导致投资者发生实际的投资损益，投资者承诺已知悉并自愿承担强制退出的风险。</p> | <p>（七）强制退出风险 投资者部分退出资产管理计划的，单笔退出最低份额为 1 万份，其退出后持有的资产管理计划份额净值应当不低于规定的合格投资者最低参与金额。投资者持有的资产管理计划份额净值低于规定的最低投资金额时，需要退出资产管理计划的，应当一次性全部退出。投资者没有一次性申请全部退出的，管理人将在退出申请确认日对该投资者所持有的全部份额做退出确认，投资者将面临全部份额被退出的风险。 本资产管理计划的退出费率按照份额持有人持有该份额的时间分段设定：持有期限小于 180 天时退出费率为 1%；持有期限大于等于 180 天但小于 365 天时退出费率为 0.50%；持有期限大于等于 365 天时退出费率为 0。当触发前述份额强制退出情形时，持有期限小于 365 天的份额会按照前述退出费率收取相应的赎回费。投资者面临强制退出时产生赎回费用的风险。 因份额强制退出可能会导致投资者发生实际的投资损益，投资者承诺已知悉并自愿承担强制退出的风险。</p> |
| <p>第 25 部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</p> | |
| <p>一、资产管理合同变更的情形 （五）本合同的变更满足法律法规要求的资产管理计划成立要件后，本合同变更生效。自合同变更生效之日起，变更后的内容即成为本合同组成部分。 （六）管理人自资产管理合同变更之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。</p> | <p>一、资产管理合同变更的情形 （五）资产管理合同的变更事项自管理人公告中确定的合同变更生效日起生效。自合同变更生效之日起，变更后的内容即成为本合同组成部分，对合同各方均具有法律效力。 （六）管理人自资产管理合同变更之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案。</p> |
| <p>三、资产管理计划的展期 （五）展期情况备案 本资产管理计划展期后 5 个工作日内，管理人将展期情况向证券投资</p> | <p>三、资产管理计划的展期 （五）展期情况备案 本资产管理计划展期后 5 个工作日内，管理人将展期情况向证券投资</p> |

| | |
|---|--|
| 基金业协会备案，同时抄报中国证监会相关派出机构。 | 资基金业协会备案。 |
| <p>四、资产管理计划终止的情形</p> <p>.....</p> <p>管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第（七）项约定的情形除外。</p> | <p>四、资产管理计划终止的情形</p> <p>.....</p> <p>管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，前述第（七）项约定的情形除外。</p> |
| <p>五、资产管理计划的清算</p> <p>（二）资产管理计划财产清算程序</p> <p>6、将清算报告报中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会备案并公告；</p> | <p>五、资产管理计划的清算</p> <p>（二）资产管理计划财产清算程序</p> <p>6、将清算报告报证券投资基金业协会备案并公告；</p> |
| <p>五、资产管理计划的清算</p> <p>资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，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。管理人可针对该部分未能流通变现证券制定延期清算方案，该方案应经资产管理计划清算小组认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据延期清算方案的规定，对前述未能流通变现的财产在可流通变现后进行清算，并将变现后的财产扣除相关费用后按照投资者持有对应份额的比例或者资产管理合同的约定，以货币形式全部分配给投资者，并注销资产管理计划专用证券账户和资金账户。在进行延期清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。</p> <p>管理人应当在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。</p> | <p>五、资产管理计划的清算</p> <p>资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构。管理人可针对该部分未能流通变现证券制定延期清算方案，该方案应经资产管理计划清算小组认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据延期清算方案的规定，对前述未能流通变现的财产在可流通变现后进行清算，并将变现后的财产扣除相关费用后按照投资者持有对应份额的比例或者资产管理合同的约定，以货币形式全部分配给投资者，并注销资产管理计划专用证券账户和资金账户。在进行延期清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。</p> <p>管理人应当在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案。</p> |
| <p>第 27 部分 争议的处理</p> <p>因本合同引起的或与本合同有关的任何争议，当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，有权将争议提交管理人所在地法院提起诉讼。争议处理期间，相关各方当事人应恪守职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同和托管协议规定的义务，维护投资者的合法权益。</p> | <p>因本合同引起的或与本合同有关的任何争议，当事人可以通过协商或者调解予以解决。当事人不愿通过协商、调解解决或者协商、调解不成的，有权将争议提交管理人所在地法院提起诉讼。争议处理期间，相关各方当事人应恪守职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同规定的义务，维护投资者的合法权益。</p> |
| <p>附件三：投资监督事项表</p> <p>1、投资范围</p> <p>（3）股指期货、国债期货、商品期货、交易所期权等标准化商品及金融衍生品；</p> <p>2、投资比例</p> <p>（3）本资产管理计划投资商品及金融衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过 80%或衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的 20%；</p> <p>3、投资限制</p> <p>（5）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资产管理计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> | <p>1、投资范围</p> <p>（3）股指期货、国债期货、商品期货、交易所期权等标准化期货和衍生品类资产；</p> <p>2、投资比例</p> <p>（3）本资产管理计划投资期货和衍生品类资产合计市值占资产管理计划资产总值的比例不超过 80%或期货和衍生品账户权益不超过资产管理计划资产总值的 20%；</p> <p>3、投资限制</p> <p>（5）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，所申报的金额原则上不得超过资产管理计划的总资产，所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> |
| | <p>新增：</p> <p>附件五：风险揭示书</p> |

附件 2

关于安信资管策略优选 2 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 2023 年 3 月 9 日发布的《关于安信资管策略优选 2 号集合资产管理计划合同变更的公告》中有关安信资管策略优选 2 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。