

# 关于安信证券债券增利1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》，以及《安信证券债券增利1号集合资产管理计划资产管理合同》中“合同的补充、修改与变更”章节的规定，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《安信证券债券增利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：

《安信证券债券增利1号集合资产管理计划合同》主要变更内容详情请参见附件一《安信证券债券增利1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5月12日至2023年5月18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《关于安信证券债券增利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2023年5月17日至2023年5月18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5月18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2023年5月19日。

### 四、其他事项

1、安信证券债券增利1号集合资产管理计划将于2023年5月17日至2023年5月18日期间的交易日正常办理参与及退出业务，于2023年5月17日至2023年5月18日期间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、本次合同变更涉及开放期调整，2023年5月19日合同变更生效以后，本计划每周三、周四（如遇非工作日不开放、不顺延）为开放期，投资者可以在开放期内办理参与、退出业务。

3、本次合同变更内容调整产品费率结构，增加退出费率按份额持有人持有该份额的时间分段设定：持有期限小于90日为0.5%；持有期限大于等于90日为0。退出费不计入集合计划财产。请投资者仔细阅读《附件一：安信证券债券增利1号集合资产管理计划合同修订对照表》以及《安信证券债券增利1号集合资产管理计划风险揭示书》，慎重决定是否参与本集合资产管理计划。

4、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



附件一：安信证券债券增利1号集合资产管理计划合同修订对照表



变更前	变更后
第2部分 释义	
《证券投资基金法》：指2013年6月1日起正式实施的《中华人民共和国证券投资基金法》；	《证券投资基金法》：指2013年6月1日起正式实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及其修订；
《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1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；
删除： 《规范》：指2012年10月19日中国证券业协会发布并施行的《证券公司客户资产管理业务规范》；	
托管人：指上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行，简称“浦发银行”；	托管人：指上海浦东发展银行股份有限公司深圳分行，简称“浦发银行深圳分行”；
投资者/合格投资者：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30万元（扣除参与费后）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织： (1) 具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元； (2) 最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位； (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； (4) 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； (5) 基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）； (6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。	投资者/合格投资者：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30万元（扣除参与费后）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织： (1) 具有2年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元； (2) 最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位； (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； (4) 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； (5) 基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）； (6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。
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	
<b>二、管理人</b> 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 联系电话：0755-82558218	<b>二、管理人</b> 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
<b>三、托管人</b> 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/负责人：李荣军 住址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路333号 通讯地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路333号16楼 邮政编码：518000 联系人：朱津滢 联系电话：0755-81117910	<b>三、托管人</b> 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	
<b>四、投资范围和投资比例</b> 2、资产配置比例 删除： 委托人同意并授权管理人可以直接或间接将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券。但应当建立健全管理人内部审批机制和评估机制，遵循委托人利益优先原则，并采取有效措施防范利益冲突。事后管理人将在交易发生后五个工作日内以公告的方式向托管人和委托人披露，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，投资于证券期货的关联交易还应当当向证券期货交易所报告。	
<b>四、投资范围和投资比例</b> 2、资产配置比例 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	<b>四、投资范围和投资比例</b> 2、资产配置比例 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

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关派出机构和证券投资基金业协会报告。

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国证监会相关派出机构报告。

六、开放期、封闭期

本计划每周三、周四（如遇非工作日不开放、不顺延）为参与开放期，投资者可以在参与开放期内办理参与业务。

投资者参与的每笔份额自参与之日起每 3 个月为一个封闭运作期，封闭运作期内不允许退出。每笔份额自参与之日起满 3 个月的月度对应日为退出开放期，投资者在退出开放期内可以办理退出业务。如果投资者在当期退出开放期未退出的，则投资者持有的该份额自该退出开放期的下一工作日起进入下一个封闭运作期，封闭运作期内不允许退出。

对于投资者参与的每笔份额，第一个退出开放期指自参与之日起满 3 个月的月度对应日（若该月度对应日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一工作日），第二个退出开放期指自参与之日起满 6 个月的月度对应日（若该月度对应日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一工作日），以此类推。

六、开放期、封闭期

本计划每周三、周四（如遇非工作日不开放、不顺延）为开放期，投资者可以在开放期内办理参与、退出业务。

十一、本集合计划的各项费用

2、退出费：本集合计划不收取退出费。

十一、本集合计划的各项费用

2、退出费：本集合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：

持有期限 (T)	退出费率
T < 90 日	0.5%
T ≥ 90 日	0%

其中，退出费用由赎回集合计划份额的份额持有人承担，在份额持有人赎回集合计划份额时收取，不列入集合计划财产。

第 5 部分 集合计划的参与和退出

一、集合计划的参与

(二) 参与的原则

1、投资者资格要求

投资者应当是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 30 万元（扣除参与费后）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：

- (1) 具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；
- (2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；
- (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、金融资产管理公司、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；
- (4) 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；
- (5) 基本养老保险、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；
- (6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

一、集合计划的参与

(二) 参与的原则

1、投资者资格要求

投资者应当是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 30 万元（扣除参与费后）且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：

- (1) 具有 2 年以上投资经历，且满足下列三项条件之一的自然人：家庭金融资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元；
- (2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；
- (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、商业保理公司、金融资产管理公司、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；
- (4) 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；
- (5) 基本养老保险、社会保障基金、年金基金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；
- (6) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

二、集合计划的退出

(一) 退出的办理时间

投资者参与的每笔份额自参与之日起每 3 个月为一个封闭运作期，封闭运作期内不允许退出。每笔份额自参与之日起满 3 个月的月度对应日为退出开放期，投资者在退出开放期内可以办理退出业务。如果投资者在当期退出开放期未退出的，则投资者持有的该份额自该退出开放期的下一工作日起进入下一个封闭运作期，封闭运作期内不允许退出。

对于投资者参与的每笔份额，第一个退出开放期指自参与之日起满 3 个月的月度对应日（若该月度对应日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一工作日），第二个退出开放期指自参与之日起满 6 个月的月度对应日（若该月度对应日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一工作日），以此类推。

二、集合计划的退出

(一) 退出的办理时间

本计划每周三、周四（如遇非工作日不开放、不顺延）为开放期，投资者可以在开放期内办理参与、退出业务。

二、集合计划的退出

(四) 退出费及退出份额的计算

1、退出费用

本集合计划不收取退出费。

2、退出金额的计算方法及退出方式

退出金额 = 退出份额 × 资产管理计划单位净值 - 业绩报酬（如有）；  
退出金额保留到小数点后两位。

二、集合计划的退出

(四) 退出费及退出份额的计算

1、退出费用

本集合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：

持有期限 (T)	退出费率

<p>退出金额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由集合计划财产承担，产生的收益归集合计划财产所有。</p>	<table border="1" data-bbox="833 152 1457 241"> <tr> <td>T &lt; 90 日</td> <td>0.5%</td> </tr> <tr> <td>T ≥ 90 日</td> <td>0%</td> </tr> </table> <p>其中，退出费用由赎回集合计划份额的份额持有人承担，在份额持有人赎回集合计划份额时收取，不列入集合计划财产。</p> <p>2、退出金额的计算方法及退出方式</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>退出金额结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由集合计划财产承担，产生的收益归集合计划财产所有。</p>	T < 90 日	0.5%	T ≥ 90 日	0%
T < 90 日	0.5%				
T ≥ 90 日	0%				
<p>（五）退出的限制与次数</p> <p>委托人单笔退出最低份额为1万份；若某笔退出导致该委托人在某销售机构持有的份额少于1万份，则剩余部分必须一起退出。本集合计划在退出开放日无退出次数限制。</p>	<p>（五）退出的限制与次数</p> <p>委托人单笔退出最低份额为1万份；若某笔退出导致该委托人在某销售机构持有的份额少于1万份，则剩余部分必须一起退出。本集合计划在退出开放日无退出次数限制。</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90天时退出费率为0.5%，持有期限大于等于90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90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）巨额退出的认定和处理方式</p> <p>2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>当出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出或部分顺延退出。</p> <p>全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序执行。</p> <p>部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请有困难或认为兑付委托人的退出申请可能对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；未能退出部分，除投资者在提交退出申请时明确选择不参加顺延退出外，选择参加顺延退出的投资者的未退出份额将自动转为下一个开放日退出处理，如在开放日内未能办理完毕，将顺延到下一个工作日。转入下一个开放日（或工作日）的退出将以下一个开放日（或工作日）的单位净值为准进行计算，并以此类推，直到全部退出为止。因巨额退出导致的顺延退出不受当日是否仅限办理参与业务或是否为开放日的限制。委托人在提出退出申请时可选择将当日未获受理部分予以撤销。投资者在提交退出申请时明确选择不参加顺延退出的，当日未获受理的份额视为继续持有。</p> <p>当发生巨额退出并顺延退出时，管理人应立即通过在管理人的公司网站刊登公告等途径向委托人公布信息，并说明有关处理方法。</p>	<p>（六）巨额退出的认定和处理方式</p> <p>2、巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>当出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出或部分顺延退出。</p> <p>全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序执行。</p> <p>部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请有困难或认为兑付委托人的退出申请可能对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；未能退出部分，除投资者在提交退出申请时明确选择不参加顺延退出外，选择参加顺延退出的投资者的未退出份额将自动转为下一个开放日退出处理，如在开放日内未能办理完毕，将顺延到下一个工作日。转入下一个开放日（或工作日）的退出将以下一个开放日（或工作日）的单位净值为准进行计算，并以此类推，直到全部退出为止。因巨额退出导致的顺延退出不受当日是否仅限办理参与业务或是否为开放日的限制。委托人在提出退出申请时可选择将当日未获受理部分予以撤销。投资者在提交退出申请时明确选择不参加顺延退出的，当日未获受理的份额视为继续持有。</p> <p>当发生巨额退出并顺延退出时，管理人应立即通过在管理人的公司网站刊登公告等途径向委托人公布信息，并说明有关处理方法。</p>				
<p>第6部分 管理人自有资金参与集合计划</p>	<p>第6部分 证券期货经营机构自有资金参与集合计划</p>				
<p>管理人不以自有资金参与本集合计划，但为应对集合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，在不存在利益冲突的前提下，管理人可以以自有资金参与及退出本集合计划，但应当及时告知委托人和托管人，并向中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报告。</p>	<p>证券期货经营机构及其子公司不以自有资金参与本集合计划，但为应对集合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，在不存在利益冲突的前提下，证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与及退出本集合计划，但应当及时告知委托人和托管人，并向中国证监会派出机构报告。</p>				
<p>第12部分 集合计划估值</p>					
<p>七、估值方法</p> <p>1、基金产品估值方法：</p> <p>（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）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>七、估值方法</p> <p>1、基金产品估值方法：</p> <p>（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）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；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>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</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。</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，且最近交易后经济环境未发</p>				

<p>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>(2) 银行间市场交易的债券，按如下估值方式处理：</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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，按成本估值。</p> <p>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，均被认为采用了适当的估值方法。</p> <p>法律法规、监管规定有最新规定的，按其规定进行估值。</p> <p>4、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值，选定的第三方机构未提供价格的，按成本估值。</p>	<p>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。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）提供的唯一估值全价或推荐估值全价确定公允价值；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>(2) 银行间市场交易的债券，按如下估值方式处理：</p> <p>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全价。</p> <p>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，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的的影响。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。</p> <p>4、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。</p> <p>5、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，均被认为采用了适当的估值方法。</p> <p>法律法规、监管规定有最新规定的，按其规定进行估值。</p> <p>4、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值全价估值，中债估值未提供价格的，采用估值技术确定公允价值。</p>
<p><b>第15部分 投资理念与投资策略</b></p>	
<p>三、投资策略</p> <p>2、公司债投资策略</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，……</p>	<p>三、投资策略</p> <p>2、公司债投资策略</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，……</p>
<p><b>第16部分 投资决策与风险控制</b></p>	
<p><b>二、集合计划的投资程序</b></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。本资产管理计划采取投资决策委员会领导下的投资主办负责制。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主办提供独立、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>投资主办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>投资主办将跟踪经济状况、证券市场和上市公司的发展变化，结合集合计</p>	<p><b>二、集合计划的投资程序</b></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。本资产管理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、证券市场和上市公司的发展变化，结合集合计划</p>

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。	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。
<b>第 17 部分 投资限制及禁止行为</b>	
<p>一、投资限制</p> <p>5、本集合计划参与债券、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>一、投资限制</p> <p>5、本集合计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过集合计划的总资产，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>一、投资限制</p>	<p>一、投资限制</p> <p>新增：</p> <p>7、本集合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，本集合计划的总资产不得超过其净资产的 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除外。</p>
<p>一、投资限制</p> <p>如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 15 个工作日内将投资比例降至许可范围内。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关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p>	<p>一、投资限制</p> <p>如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 20 个工作日内将投资比例降至许可范围内。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关派出机构报告。</p>
	<p>二、禁止行为</p> <p>新增：</p> <p>14、利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；</p> <p>15、为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利；</p>
	<p>新增 第 18 部分 利益冲突及关联交易</p>
	<p>一、资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形</p> <p>(一) 将资产管理计划资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券或者其他关联交易事项；</p> <p>(二) 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本资产管理计划；</p> <p>(三) 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本资产管理计划；</p> <p>(四) 其他可能产生利益冲突的情形。</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>(一)利益冲突的处理方式</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本资产管理计划财产，公平对待全体投资者，实现在公司、股东和员工个人的利益与投资者利益发生冲突时，优先保障投资者的利益，不同投资者利益之间的利益发生冲突时，公平对待不同投资者。</p> <p>管理人制定了内部控制和风险合规管理制度，按照内外部管控要求识别、报告、评估、解决利益冲突事项。管理人运用受托资产从事上述利益冲突交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会、证券投资基金业协会的规定和合同约定，并遵循投资者利益优先原则，防范利益冲突。</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> <p>三、资产管理计划的关联交易</p> <p>(一)关联交易的范围</p> <p>本资产管理计划可能涉及的关联交易情形包括：</p> <p>1. 投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券；</p> <p>2. 投资管理及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行设立的资产管理产品；</p> <p>3. 与管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方开展现券交易、债券借贷、回购交易、场外衍生品交易及接受或提供服务等其他关联交易，含逆回购交易对手方、质押券；</p> <p>4. 其他依据法律法规或监管机构规定应认定为关联交易的情形。</p> <p>(二)关联方名单披露</p> <p>1. 管理人的关联方名单披露。管理人的关联方名单及其更新，管理人将以公告或其他方式告知托管人和投资者。</p> <p>2. 托管人的关联方名单披露。托管人应当配合管理人提供并更新关联方名单与关联证券（如有），管理人将在获取托管人关联方名单后将以公告或其他方式告知投资者。托管人应对其提交的关联方名单与关联证券（如有）的真实性、准确性、完整性等负责。管理人将按照托管人提交的关联方名单与关联证券（如有）</p>



及其变化情况进行关联交易控制，但管理人无义务对托管人提供的关联方名单与关联证券（如有）的真实性、准确性、完整性等进行复核，亦无须承担责任。

### （三）关联交易的分类

管理人对资产管理计划关联交易进行分层管理，区分为重大关联交易和一般关联交易，具体分类如下：

#### 1. 重大关联交易

管理人运用资产管理计划资产从事以下关联交易的为重大关联交易：

（1）与管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方开展关联交易，单笔交易金额达到或超过特定比例或数值：

1) 存在非专业投资者或单个投资者投资金额低于1,000万元的资产管理计划，单笔交易金额达到或超过资产管理计划资产净值的5%且达到5,000万元及以上的；

2) 全部投资者均为专业投资者，且单个投资者投资金额不低于1,000万元的资产管理计划：若产品规模超过20亿元，单笔交易金额达到或超过资产管理计划资产净值的10%的；

3) 全部投资者均为专业投资者，且单个投资者投资金额不低于1000万元的资产管理计划，若产品规模低于20亿元，单笔交易金额达到或超过资产管理计划资产净值的10%或达到6000万及以上的。

（2）与管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方开展逆回购交易，或回购交易中的质押券为相关关联方发行的证券。

#### 2. 一般关联交易

管理人运用资产管理计划资产从事包括但不限于下列交易，以及前述重大关联交易以外的其他关联交易，为一般关联交易：

（1）与管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方开展关联交易，单笔关联交易金额未达到前述重大关联交易的特定比例或数值；

（2）与管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方开展的正回购交易；

（3）与托管人及其控股股东、实际控制人或其他关联方开展逆回购，或回购交易中的质押券为相关关联方发行的证券；

（4）高管战略配售资产管理计划、员工持股计划等特定目的资产管理计划，所投资的股票为管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方承销期内承销的股票，或者该等股票的发行人为管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方的，该等特定目的资产管理计划投资该上市公司股票的。

法律法规、监管规定或自律规则对重大关联交易及一般关联交易的范围和标准另有规定的，从其规定。

### （四）关联交易的投资者同意机制

1. 投资者同意并授权管理人可以运用受托管理资产从事一般关联交易，无需就一般关联交易再行分别取得投资者授权或同意；

2. 管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先另行取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。管理人应提前在管理人网站以公告或以其他方式充分告知投资者，并采取如下权利保障措施及安排：

（1）投资者不同意开展该笔重大关联交易的，管理人保障其退出权利，具体退出安排以管理人公告为准；

（2）投资者不同意该笔重大关联交易且未在公告确定的退出日内退出的，则管理人有权在公告中确定的退出日将相关份额强制退出计划（退出价格为退出当日资产管理计划相应份额的单位净值），由此发生的相关税费或或有损失由投资者自行承担；

（3）投资者未回复意见且未在公告确定的退出日内退出的，视同投资者同意该笔重大关联交易，管理人不再另行通知；

（4）投资者回复意见不明确的，则视为该投资者不同意该笔重大关联交易，按照上述（1）-（2）处理。

### （五）管理人关联交易的内部管控机制

1. 管理人已建立健全的关联交易审批机制和评估机制，包括但不限于关联方的清单管理、关联交易的识别、关联交易的投资决策、信息披露等。

2. 管理人运用受托管理资产从事关联交易的，在遵循投资者利益优先原则的前提下，管理人的投资部门根据实际投资需要，按照管理人、托管人及其关联方清单谨慎开展关联交易，按照公司制度规定的定价规则进行定价，并将包括但不限于定价结果及定价依据提交审批，其中一般关联交易提交管理人投资部门的分管领导进行审批，重大关联交易提交管理人的投资决策委员会进行审批。管理人的交易部门按照公司制度的规定在完成审批后开展交易，同时公司通过系统和人工的方式，对关联交易进行核查。管理人的合规部门对关联交易的合法合规性进行事后监督和检查。

3. 关联交易完成后，管理人将及时向投资者和托管人进行披露，并向中国证监会相关派出机构报告。

法律法规、监管规定或自律规则对关联交易管理另有规定的，如为本合同未约定或与本合同约定不一致的，管理人将在管理人网站另行公告，无需修改本合同，以最新规则为准。

	<p>新增 第19部分 投资经理的指定与变更</p> <p>一、投资经理的指定</p> <p>本资产管理计划的投资理由管理人指定。</p> <p>本资产管理计划的投资经理：竺印，赵雪飞</p> <p>竺印，中南财经政法大学会计学硕士，中国注册会计师。历任安信证券资产管理部债券交易员、信用研究员、投资经理，多年债券研究与交易经验，现任安信资管投资经理。</p> <p>赵雪飞：厦门大学管理学院财务投资学硕士，7年以上证券研究及投资交易经验。2014年3月至2016年3月，任中集集团财务公司金融市场部投资经理助理。2016年3月加入安信证券资产管理部，历任安信证券资产管理部债券交易员、信用研究员，多年债券研究与交易经验，现任安信证券资产管理有限公司固定收益部投资经理。</p> <p>本资产管理计划的投资经理已取得基金从业资格，本资产管理计划的投资经理最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>二、投资经理的变更</p> <p>管理人因以下情况需更换投资经理：</p> <p>(一)投资经理辞职/离职；</p> <p>(二)管理人内部调整；</p> <p>(三)其他原因需要更换投资经理。</p> <p>管理人在更换投资经理时需提前1个工作日以公告等书面形式通知投资者。</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18部分 集合计划的信息披露	第20部分 集合计划的信息披露
<p>一、定期报告</p> <p>2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告。</p> <p>管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站通告，并按照规定及时向相关监管机构备案。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人、托管人可以编制当季的季度报告。集合计划终止当季，管理人、托管人可以编制当季的季度报告。</p> <p>3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个年度结束之日起四个月内通过管理人网站通告，并按照规定及时向相关监管机构备案。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月时，管理人、托管人可以编制当季的年度报告。集合计划终止当年，管理人、托管人可以编制当年的年度报告。</p>	<p>一、定期报告</p> <p>2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告。</p> <p>管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站通告，并按照规定及时向相关监管机构报送。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人、托管人可以编制当季的季度报告。集合计划终止当季，管理人、托管人可以编制当季的季度报告。</p> <p>3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个年度结束之日起四个月内通过管理人网站通告，并按照规定及时向相关监管机构报送。集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月时，管理人、托管人可以编制当季的年度报告。集合计划终止当年，管理人、托管人可以编制当年的年度报告。</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>
<p>二、临时报告</p> <p>5、管理人以自有资金参与和退出；</p>	<p>二、临时报告</p> <p>5、证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与和退出；</p>
<p>二、临时报告</p> <p>9、集合计划投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券；</p>	<p>二、临时报告</p> <p>9、集合计划投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或承销期内承销的证券或者开展其他关联交易；</p>
第20部分 集合计划的展期	第22部分 集合计划的展期
<p>(六)展期情况备案</p> <p>本集合计划展期后5日内，管理人将展期情况公告并报中国基金业协会备案，同时抄送管理人所在地中国证监会派出机构。</p>	<p>(六)展期情况备案</p> <p>本集合计划展期后5日内，管理人将展期情况公告并报中国基金业协会备案。</p>
第21部分 集合计划终止与清算	第23部分 集合计划终止与清算
<p>二、集合计划的清算</p> <p>4、清算结束后5个工作日内由集合计划清算小组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>二、集合计划的清算</p> <p>4、清算结束后5个工作日内由集合计划清算小组将清算结果报证券投资基金业协会备案。</p>
第24部分 风险揭示	第26部分 风险揭示
<p>(八)本集合计划特有风险</p> <p>3、关联交易风险</p> <p>本计划委托人已同意并授权管理人可投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，管理人应按规定就关联交易进行信息披露，委托人已知悉本集合计划存在关联交易风险。</p>	<p>(八)本集合计划特有风险</p> <p>3、关联交易风险</p> <p>管理人可以按照合同约定进行关联交易，仍存在程序不完整、不规范等风险。管理人已建立健全关联交易管理制度，根据本计划/管理人所涉关联交易的金额、比例、类型等标准对关联交易进行一般与重大关联交易的区分，并对一般与重大关联交易的审批程序进行规范。</p> <p>一般关联交易风险：投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人可以将本资管计划的资产投资一般关联交易事项，管理人无需就具体一般关联交易再行分别取得投资者的授权，可能存在投资者不认可本计划拟开展的一般关联交</p>

	<p>易但无法退出的风险。</p> <p><b>重大关联交易风险：</b>对于本计划涉及的重大关联交易事项，管理人在进行重大关联交易前，应当提前以公告的方式向投资者发送征询意见，投资者应在公告指定的日期内按照指定形式回复意见，逾期未做答复的，视为同意重大关联交易事项；投资者向管理人答复不同意重大关联交易事项的，则应当在管理人发出的公告中确定的开放日内提出退出申请，逾期未提出退出申请的，则投资者其已以行为表明其对重大关联交易最终确定的意思表示应为同意公告中载明的重大关联交易事项。可能存在投资者不认可本计划拟开展的重大关联交易，但在公告中确定的开放日未提出退出申请，从而未能及时退出的风险。</p> <p>管理人根据资产管理合同约定从事关联交易的，虽然管理人积极遵循委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因管理人运用集合计划资产从事关联交易被监管部门认为存在重大风险，且管理人无法确保选择进行关联交易的实际交易结果（就投资结束后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，进而可能影响集合计划份额持有人的利益。此外，管理人运用集合计划资产从事关联交易时可能依照相关法律法规、其他规范性文件被限制相关权利的行使，进而可能影响集合计划份额持有人的利益。此外，若将来法律、行政法规及中国证监会的规定对于集合计划的关联交易做出新的监管要求的，本计划将按照届时最新的监管要求对关联交易的认定标准及合同条款（如需）进行调整，该等调整可能会对集合计划的投资收益造成影响。</p> <p>管理人对与托管人有关的关联交易的监控受限于托管人公开披露的关联方名单及关联证券名单的真实性、准确性、全面性和及时性，如托管人未能公开披露关联方名单及关联证券名单的，管理人将无法监控与托管人有关的关联交易，无法向投资者、托管人进行披露。</p> <p>此外，关联交易的风险还包括关联交易的经营风险以及关联交易的财务风险，关联交易的经营风险是指企业在关联交易的控制过程当中，由于关联双方鉴定不准确、关联交易定价不合理，以及关联交易活动中断等原因导致的各种风险，关联交易财务风险指因为关联交易会计核算不规范给企业造成的风险。</p> <p>管理人从事关联交易的，应当符合资管计划的投资目标和投资策略，遵循资管计划份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，按照市场公平合理价格及公司关联交易内部审批机制和评估机制执行，事后管理人将及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露，并向中国证监会相关派出机构报告。</p>
<p>（十二）其它风险</p> <p>4、对主要业务人员如投资主办的依赖而可能产生的风险；</p> <p>第 26 部分 合同的补充、修改与变更</p>	<p>新增：</p> <p>4、强制退出风险</p> <p>委托人单笔退出最低份额为 1 万份；若某笔退出导致该委托人在某销售机构持有的份额少于 1 万份，则剩余部分必须一起退出。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 90 天时退出费率为 0.5%；持有期限大于等于 90 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 90 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>3、……</p> <p>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>附件 1 投资监督事项</p>	<p>（十二）其它风险</p> <p>4、对主要业务人员如投资经理的依赖而可能产生的风险；</p> <p>第 28 部分 合同的补充、修改与变更</p> <p>3、……</p> <p>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><b>投资限制：</b></p> <p>新增：</p> <p>5、集合计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，所申报的金额原则上不得超过集合计划的总资产，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>6、本集合计划所投资的资产支持证券、资产支持票据须为银行间或沪深交易所挂牌交易的优先级份额，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。（托管人根据管理人提供的资产支持证券和资产支持票据协议进行监督）</p> <p>如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 20 个工作日内将投资比例降至许可范围内。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关派出机构报告。</p>
	<p>新增附件 2</p> <p>安信证券债券增利 1 号集合资产管理计划风险揭示书</p>

附件二

## 关于安信证券债券增利 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 2023 年 5 月 9 日发布的《关于安信证券债券增利 1 号集合资产管理计划合同变更的公告》中有关安信证券债券增利 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](mailto:axzg@essence.com.cn)。