

# 关于第一创业稳中求进 2 号 FOF 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作为托管人的第一创业稳中求进 2 号 FOF 集合资产管理计划(以下简称“本计划”)于 2022 年 5 月 24 日成立。现根据 2023 年 3 月 1 日实施的《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》及管理人内部相关制度，拟对《第一创业稳中求进 2 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》、《第一创业稳中求进 2 号 FOF 集合资产管理计划说明书》、《第一创业稳中求进 2 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书》进行变更。主要变更内容体现为以下方面(详细内容见本公告附件)：

- 1、修改管理人自有资金参与、退出资产管理计划安排；
- 2、修改关联交易安排及相关风险揭示；
- 3、新增一名投资经理及其简介；
- 4、修改信息披露的对账单安排；
- 5、修改债券估值方法。

根据相关法律法规，为保证委托人的利益，本计划合同变更需取得委托人和托管人同意。本计划变更事宜已经获得托管人的书面同意确认。委托人如不同意本次合同变更的应在本计划开放日 2023 年 6 月 26 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 2023 年 6 月 26 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 2023 年 6 月 28 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：第一创业稳中求进 2 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同变更明细表

附件 2：第一创业稳中求进 2 号 FOF 集合资产管理计划说明书变更明细表

附件 3：第一创业稳中求进 2 号 FOF 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

二〇二三年六月二十一日

附件 1：第一创业稳中求进 2 号 FOF 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	<p>“八、资产管理计划的参与、退出与转让”“(五) 管理人自有资金参与资产管理计划”</p>	<p>1、自有资金参与的条件</p> <p>在初始募集期间或存续期内，管理人、其子公司可以以自有资金参与本计划。如参与，则管理人及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。法律法规或者中国证监会对管理人、其子公司自有资金投资比例另有规定的，从其规定。</p> <p>管理人、其子公司持有计划份额与其他委托人持有的本计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与所持本计划份额相对应损失的责任。管理人、其子公司投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。</p> <p>2、自有资金参与、退出的条件</p> <p>(1) 管理人、其子公司自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。</p> <p>(2) 委托人和托管人签署本合同即视为同意管理人、其子公司可以在初始募集期间以自有资金参与本计划。</p> <p>(3) 本计划存续期内管理人、其子公司以自有资金参与、退出本计划</p>	<p>1、自有资金参与的条件</p> <p>在初始募集期间或存续期内，证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与本计划。如参与，则证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。法律法规或者中国证监会对证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例另有规定的，从其规定。</p> <p>证券期货经营机构及其子公司持有计划份额与其他委托人持有的本计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与所持本计划份额相对应损失的责任。证券期货经营机构及其子公司投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。</p> <p>证券期货经营机构包括证券公司、基金管理公司、期货公司及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司，具体范围以中国证监会、基金业协会等监管机构的要求为准。</p> <p>2、自有资金参与、退出的条件</p> <p>(1) 证券期货经营机构及其子</p>

	<p>的，应当提前 5 个工作日通知委托人和托管人。管理人和托管人应书面达成一致，同时以公告或其他方式通知委托人。委托人不同意管理人、其子公司自有资金参与、退出的，应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请；未提出退出申请的，视同委托人已经同意管理人、其子公司自有资金参与、退出。</p> <p>但在发生以下特殊情形时，管理人、其子公司自有资金参与、退出可以不受上述条件限制，但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知委托人和托管人，并向住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准：</p> <p>(1) 因规模变动等客观因素导致管理人、其子公司自有资金参与份额比例被动超限或可能被动超限（即管理人、其子公司自有资金投资比例被动超过或可能被动超过《证券公司风险控制指标计算标准规定》等中国证监会对管理人、其子公司自有资金投资比例的规定，或管理人及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计超过或可能超过本计划总份额的 50%），管理人、其子公司在发生上述超限情形或可能超限情形之日起 5 个工作日内退出超限部分的参与份额，5 个工</p>	<p>公司自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。</p> <p>(2) 委托人和托管人签署本合同即视为同意证券期货经营机构及其子公司可以在初始募集期间以自有资金参与本计划。</p> <p>(3) 本计划存续期内证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、退出本计划的，应当提前 5 个工作日通知委托人，书面通知托管人，并取得其同意。管理人和托管人应书面达成一致，同时以公告或其他方式通知委托人。委托人不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的，应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请；未提出退出申请的，视同委托人已经同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出。</p> <p>但在发生以下特殊情形时，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出可以不受上述条件限制，但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知委托人和托管人，并向住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准：</p> <p>(1) 因规模变动等客观因素导致证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额比例被动超限或可</p>
--	--	--

		<p>作日后仍超限的，管理人、其子公司将在其后 5 个工作日处理。</p> <p>(2)为应对本计划巨额赎回或解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，管理人、其子公司自有资金参与、退出本计划。</p> <p><b>3、风险揭示和信息披露</b></p> <p>(1)管理人、其子公司以自有资金参与本计划的份额，享有与其他委托人份额相同的收益分配权，且不对本计划其他委托人承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。</p> <p>(2)管理人、其子公司自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本计划规模变动情况，控制流动性风险。</p>	<p>能被动超限（即证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例被动超过或可能被动超过《证券公司风险控制指标计算标准规定》等中国证监会对证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例的规定，或证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计超过或可能超过本计划总份额的 50%），证券期货经营机构及其子公司在发生上述超限情形或可能超限情形之日起 5 个工作日内退出超限部分的参与份额，5 个工作日后仍超限的，管理人、其子公司将在其后 5 个工作日处理。</p> <p>(2)为应对本计划巨额赎回或解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出本计划。</p> <p><b>3、风险揭示和信息披露</b></p> <p>(1)证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额，享有与其他委托人份额相同的收益分配权，且不对本计划其他委托人承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。</p> <p>(2)证券期货经营机构及其子公司自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本计划损益。管理人</p>
--	--	--	--

			<p>将认真履行管理人职责，关注本计划规模变动情况，控制流动性风险。</p>
2	<p>“十四、利益冲突及关联交易”</p> <p>“（四）资产管理计划的关联交易”</p>	<p>委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于管理人、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承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。管理人将本计划财产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应在交易完成后，书面告知委托人和托管人并向管理人住所地中国证监会派出机构和基金业协会报告。投资于证券期货的关联交易还应当及时向证券期货交易所报告。</p> <p>除将本计划财产投资于管理人、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外，管理人不得将本计划财产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、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提供或者</p>	<p>管理人可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易，管理人制定的划分标准、管控机制包括：</p> <p>1、关联方范围</p> <p>本计划所称关联方包括：</p> <p>（1）本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）；</p> <p>（2）本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>（3）本计划的投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>（4）与管理人、本计划的托管人、投资顾问（如有）有其他重大利害关系的机构。上述第（1）项为管理人全部资产管理计划的关联方；第（2）（3）项为本计划的关联方。</p> <p>（5）监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p> <p>2、关联交易范围</p> <p>本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p>

		<p>变相提供融资。全部委托人均为符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者不包含募集两个以上投资者资金设立的私募资产管理产品）且单个委托人投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得委托人同意的除外。</p>	<p>（1）本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）发行或者承销期内承销的证券；</p> <p>（2）本计划财产投资于本计划托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>（3）本计划财产投资于其投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>（4）本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>（5）本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；</p> <p>（6）本计划财产投资于投资顾问（如有）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>（7）本计划财产以本计划关联方或者以本条第（4）、（5）、（6）项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、</p>
--	--	---	---

		<p>场外基金申购、协议存款、逆回购交易等)；</p> <p>(8) 本计划财产以本计划关联方或者以本条第(4)、(5)、(6)项规定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第(五)项规定的非标准化资产交易；</p> <p>(9) 本计划财产开展逆回购交易，质押券为管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方(含管理人的一级全资子公司及控股子公司)发行的证券；</p> <p>(10) 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p> <p>3、一般关联交易和重大关联交易</p> <p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易包括投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品且金额及比例重大的(本计划为FOF产品或本计划投资于货币基金的除外)、与关联方或关联方产品为交易对手开展非标准化资产交易、与关联方或关联方产品为交易对手进行询价交易或以管理人及其关联方发行的证券作为质押券开展逆</p>
--	--	---



		<p>回购交易且金额及比例重大的等需强化审批、披露、报告的关联交易；</p> <p>一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监管机构和基金业协会的相关要求为准。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于一般关联交易。管理人将本计划财产投资于一般关联交易的，应在交易完成后，定期书面告知委托人和托管人并向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>管理人将本计划财产投资于重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，逐笔通过公告或其他方式提前通知投资者，投资者约定时间内未提出异议的视为同意。委托人提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确。同时，管理人应事后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，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>4、关联交易的内部控制</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交</p>
--	--	---

		<p>易，防范利益冲突，禁止利益输送。</p> <p>公司制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。</p> <p>5、产品关联方名单披露方式</p> <p>本产品的关联方名单信息将通过公告的形式在管理人指定网站上披露或其他适当的方式通知委托人。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>6、其他</p> <p>除将本计划财产投资于管理人、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外，管理人不得将本计划财产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，或通过与他人进行交叉融资安排等方式，违规为管理人、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提供或者变相提供融资。全部委托人均符合中国证监会规定的专业投资者（专业投资者为私募资产管理产品的，穿透认定该私募资产管</p>
--	--	---

			<p>理产品的投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元) 且单个委托人投资金额不低于 1000 万元, 并且事先取得委托人同意的除外。</p>
3	<p>“十五、投资经理的指定与变更”“(一)投资经理的指定”“2、本计划投资经理”</p>	<p>本计划投资经理是熊伟、傅婉丽。</p> <p>本计划投资经理简介：熊伟，毕业于华中科技大学，金融学硕士。曾任博时基金投资经理，联储证券大类资产配置部总经理。2022 年加入第一创业证券。长期从事资产配置研究、FOF 产品的投资管理，具备成熟的公募基金管理人评价体系。具备基金从业资格，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>傅婉丽，毕业于中国人民大学，经济学硕士，7 年金融行业从业经验，于 2016 年加入第一创业证券，长期从事券商资管业务，熟悉资管产品投资方法，参与债券投资、基金投资业务，在券商资产管理领域积累了丰富的经验。具备基金从业资格，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>本计划投资经理是熊伟、傅婉丽、连伟程。</p> <p>本计划投资经理简介：熊伟，毕业于华中科技大学，金融学硕士。曾任博时基金投资经理，联储证券大类资产配置部总经理。2022 年加入第一创业证券。长期从事资产配置研究、FOF 产品的投资管理，具备成熟的公募基金管理人评价体系。具备基金从业资格，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>傅婉丽，毕业于中国人民大学，经济学硕士，7 年金融行业从业经验，于 2016 年加入第一创业证券，长期从事券商资管业务，熟悉资管产品投资方法，参与债券投资、基金投资业务，在券商资产管理领域积累了丰富的经验。具备基金从业资格，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>连伟程，奥克兰大学经济学硕士</p>

			<p>和中山大学岭南学院管理硕士，于2022年加入第一创业证券，拥有丰富的金融机构权益投研经验；曾在安信证券股份有限公司任私募中心项目经理，负责广州、珠海地区的私募尽调评估、自营资金项目投决管理、投后追踪分析以及场外衍生品业务等工作。在私募尽职调查、基金筛选和分析上有丰富的经验，擅长自上而下的把资产配置与投资标的选择相结合。连伟程已取得基金从业资格，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>
4	<p><b>“二十、资产管理计划财产的估值和会计核算”</b> <b>“（一）资产管理计划财产的估值”</b> <b>“（2）债券估值方法”</b></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，</p>	<p>1)对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），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净价，具体估值机构由管理人和托管人协商约定。</p> <p>2)对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），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净价或推荐估值净价，具体估值机构由管理人和托管人协商约定。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</p>

		<p>调整最近交易市价，确定公允价格。</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>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。</p> <p>3)对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券、可交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。</p> <p>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，一般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。</p>
5	<p><b>“二十三、信息披露与报告”</b></p> <p><b>“（一）定期报告”“4、对账单”</b></p>	<p>管理人至少每个季度以邮寄方式向委托人寄送对账单。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。</p> <p>委托人应向管理人提供邮寄地址等资料，因委托人未正常提供以上信息、邮寄运营商系统平台故障及内部操作等原因导致委托人未能获得邮寄对账单的，管理人不承担任何责任。</p>	<p>管理人至少每个季度以电子或其他形式向委托人提供对账单，如有调整，管理人将以公告形式通知委托人。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。委托人应向管理人提供电子邮箱地址等资料，因委托人未正常提供以上信息、邮件运营商系统平台故障及内部操作等非管理人原因导致委托人未能获得</p>

			<p>电子对账单的, 管理人不承担任何责任。</p>
6	<p>“二十四、风险揭示”“(一)特殊风险揭示”“5、其他特殊风险”</p>	/	<p>(13) 使用虚拟净值进行估值的风险</p> <p>当本计划投资场外资产管理产品时, 由于场外资产管理产品的份额净值中包含了应当计提但是未支付的业绩报酬, 采用份额净值对本计划资产进行估值可能无法准确地反映本计划的真实资产价值, 因此, 管理人可视产品实际运作情况, 使用虚拟单位净值对该等场外资产管理产品进行估值</p> <p>由于虚拟单位净值的真实性、准确性、完整性依赖于场外资产管理产品的相关基础数据的真实性、准确性、完整性, 若场外资产管理产品之托管人、管理人以及本计划之管理人未及时提供真实、准确、完整的虚拟单位净值或估值材料, 可能发生该等虚拟单位净值存在错误或延迟, 从而影响本计划的资产净值。</p> <p>由于虚拟单位净值需要将场外资产管理产品份额净值扣除估值当日预计内含的业绩报酬(如有), 因此采用虚拟单位净值估值后的单位净值将低于之前按照份额净值估值的单位净值。</p>

7	<p>“二十四、风险揭示”“(二)一般风险揭示”“15、其他风险”“(1)关联交易的风险”</p>	<p>管理人可以将本计划的资产投资于管理人、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承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，管理人按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险，同时，本计划进行关联交易时可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。</p>	<p>管理人可运用本计划财产从事关联交易，关联交易包括一般关联交易和重大关联交易，管理人制定的划分标准、管控机制包括：</p> <p>1) 关联方范围</p> <p>本计划所称关联方包括：</p> <p>① 本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）；</p> <p>② 本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>③ 本计划的投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方；</p> <p>④ 与管理人、本计划的托管人、投资顾问（如有）有其他重大利害关系的机构。上述第①项为管理人全部资产管理计划的关联方；第②、③项为本计划的关联方。</p> <p>⑤ 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p> <p>2) 关联交易范围：本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于：</p> <p>① 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其</p>

		<p>他关联方（含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司）发行或者承销期内承销的证券；</p> <p>② 本计划财产投资于本计划托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>③ 本计划财产投资于其投资顾问（如有）、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>④ 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>⑤ 本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；</p> <p>⑥ 本计划财产投资于投资顾问（如有）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；</p> <p>⑦ 本计划财产以本计划关联方或者以本条第（4）、（5）、（6）项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款、逆回购交易等）；</p>
--	--	--



			<p>⑧ 本计划财产以本计划关联方或者以本条第④、⑤、⑥项规定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产交易；</p> <p>⑨ 本计划财产开展逆回购交易，质押券为管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）发行的证券；</p> <p>⑩ 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。</p> <p>3) 一般关联交易和重大关联交易</p> <p>关联交易分为一般关联交易和重大关联交易，实行分类管理。重大关联交易包括投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品且金额及比例重大的（本计划为FOF产品或本计划投资于货币基金的除外）、与关联方或关联方产品为交易对手开展非标准化资产交易、与关联方或关联方产品为交易对手进行询价交易或以管理人及其关联方发行的证券作为质押券开展逆回购交易且金额及比例重大的等需强化审批、披露、报告的关联交易；</p>
--	--	--	--

		<p>一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监管机构和基金业协会的相关要求为准。</p> <p><b>委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于一般关联交易。</b>管理人将本计划财产投资于一般关联交易的，在交易完成后，定期书面告知委托人和托管人并向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。</p> <p><b>管理人将本计划财产投资于重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，逐笔通过公告等方式提前通知投资者，投资者约定时间内未提出异议的视为同意。</b>委托人提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确。同时，管理人应事后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，具体以监管机构的要求为准。</p> <p>4) 关联交易的内控机制</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。管理人为此制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类</p>
--	--	--

		<p>型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。</p> <p>5) 产品关联方名单披露方式</p> <p>本产品的关联方名单信息将通过公告的形式在管理人指定网站上披露或其他适当的方式通知委托人。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>管理人按照上述标准及机制进行关联交易管理时，需按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险，同时，本计划进行关联交易时可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。</p>
--	--	--

附件 2：第一创业稳中求进 2 号 FOF 集合资产管理计划说明书变更明细表

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
1	“管理人自有资金参与情况”	<p>1、自有资金参与的条件</p> <p>在初始募集期间或存续期内，管理人、其子公司可以以自有资金参与本计划。如参与，则管理人及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。法律法规或者中国证监会对管理人、其子公司自有资金投资比例另有规定的，从其规定。</p> <p>管理人、其子公司持有计划份额与其他委托人持有的本计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与所持本计划份额相对应损失的责任。管理人、其子公司投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。</p> <p>2、自有资金参与、退出的条件</p> <p>(1) 管理人、其子公司自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。</p> <p>(2) 委托人和托管人签署本合同即视为同意管理人、其子公司可以在初始募集期间以自有资金参与本计划。</p> <p>(3) 本计划存续期内管理人、其子公司以自有资金参与、退出本计划的，应当提前 5 个工作日通知委托人和托管人。管理人和托管人应书面达成一致，同时以公告或其他方式通知委托人。委托人不同意管理人、其子公司自有资金参与、退出的，</p>	<p>1、自有资金参与的条件</p> <p>在初始募集期间或存续期内，证券期货经营机构及其子公司可以以自有资金参与本计划。如参与，则证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。法律法规或者中国证监会对证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例另有规定的，从其规定。</p> <p>证券期货经营机构及其子公司持有计划份额与其他委托人持有的本计划份额享有同等参与收益分配的权利，也承担与所持本计划份额相对应损失的责任。证券期货经营机构及其子公司投入自有资金参与本计划份额不承担任何补偿责任。</p> <p>证券期货经营机构包括证券公司、基金管理公司、期货公司及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司，具体范围以中国证监会、基金业协会等监管机构的要求为准。</p> <p>2、自有资金参与、退出的条件</p> <p>(1) 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月。</p> <p>(2) 委托人和托管人签署本合同即视为同意证券期货经营机构及其子公司可以</p>

	<p>应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请；未提出退出申请的，视同委托人已经同意管理人、其子公司自有资金参与、退出。</p> <p>但在发生以下特殊情形时，管理人、其子公司自有资金参与、退出可以不受上述条件限制，但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知委托人和托管人，并向住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准：</p> <p>(1)因规模变动等客观因素导致管理人、其子公司自有资金参与份额比例被动超限或可能被动超限（即管理人、其子公司自有资金投资比例被动超过或可能被动超过《证券公司风险控制指标计算标准规定》等中国证监会对管理人、其子公司自有资金投资比例的规定，或管理人及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计超过或可能超过本计划总份额的 50%），管理人、其子公司在发生上述超限情形或可能超限情形之日起 5 个工作日内退出超限部分的参与份额，5 个工作日后仍超限的，管理人、其子公司将在其后 5 个工作日处理。</p> <p>(2)为应对本计划巨额赎回或解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，管理人、其子公司自有资金参与、退出本计划。</p> <p>3、风险揭示和信息披露</p>	<p>在初始募集期间以自有资金参与本计划。</p> <p>(3) 本计划存续期内证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、退出本计划的，应当提前 5 个工作日通知委托人，书面通知托管人，并取得其同意。管理人和托管人应书面达成一致，同时以公告或其他方式通知委托人。委托人不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的，应当在管理人通知的退出开放日提出退出申请；未提出退出申请的，视同委托人已经同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出。</p> <p>但在发生以下特殊情形时，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出可以不受上述条件限制，但事后管理人应及时将自有资金参与、退出情况告知委托人和托管人，并向住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准：</p> <p>(1) 因规模变动等客观因素导致证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额比例被动超限或可能被动超限（即证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例被动超过或可能被动超过《证券公司风险控制指标计算标准规定》等中国证监会对证券期货经营机构及其子公司自有资金投资比例的规定，或证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计超过或可能超过本计划总份额的 50%），证券期货经营机构及其子公司在发生上述超限情形</p>
--	---	--

		<p>(1) 管理人、其子公司以自有资金参与本计划的份额，享有与其他委托人份额相同的收益分配权，且不对本计划其他委托人承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。</p> <p>(2) 管理人、其子公司自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本计划规模变动情况，控制流动性风险。</p> <p>(六) 管理人将按照法律法规及基金业协会的要求，定期将本计划投资者变更情况报送基金业协会，具体以监管机构的要求为准。</p>	<p>或可能超限情形之日起 5 个工作日内退出超限部分的参与份额，5 个工作日后仍超限的，管理人、其子公司将在其后 5 个工作日处理。</p> <p>(2) 为应对本计划巨额赎回或解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出本计划。</p> <p>3、风险揭示和信息披露</p> <p>(1) 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额，享有与其他委托人份额相同的收益分配权，且不对本计划其他委托人承担任何补偿责任。请投资者注意投资风险。</p> <p>(2) 证券期货经营机构及其子公司自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本计划规模变动情况，控制流动性风险。</p>
2	<p>“信息披露” “定期报告”</p>	<p>...</p> <p>4、对账单</p> <p>管理人至少每个季度以邮寄方式向委托人寄送对账单。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。</p> <p>委托人应向管理人提供邮寄地址等资料，因委托人未正常提供以上信息、邮寄运营商系统平台故障及内部操作等原</p>	<p>...</p> <p>4、对账单</p> <p>管理人至少每个季度以电子或其他形式向委托人提供对账单，如有调整，管理人将以公告形式通知委托人。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。委托人应向管理人提供电子邮箱地址等资料，因委托人未正常提供以上信息、邮件运营商</p>

		因导致委托人未能获得邮寄对账单的, 管理人不不承担任何责任。	系统平台故障及内部操作等非管理人原因导致委托人未能获得电子对账单的, 管理人不不承担任何责任。
--	--	--------------------------------	---

附件 3：第一创业稳中求进 2 号 FOF 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	“二十四、风险揭示” “（一）特殊风险揭示” “5、其他特殊风险”	/	<p>（13）使用虚拟净值进行估值的风险</p> <p>当本计划投资场外资产管理产品时，由于场外资产管理产品的份额净值中包含了应当计提但是未支付的业绩报酬，采用份额净值对本计划资产进行估值可能无法准确地反映本计划的真实资产价值，因此，管理人可视产品实际运作情况，使用虚拟单位净值对该等场外资产管理产品进行估值</p> <p>由于虚拟单位净值的真实性、准确性、完整性依赖于场外资产管理产品的相关基础数据的真实性、准确性、完整性，若场外资产管理产品之托管人、管理人以及本计划之管理人未及时提供真实、准确、完整的虚拟单位净值或估值材料，可能发生该等虚拟单位净值存在错误或延迟，从而影响本计划的资产净值。</p> <p>由于虚拟单位净值需要将场外资产管理产品份额净值扣除估值当日预计内含的业绩报酬(如有)，因此采用虚拟单位净值估值后的单位净值将低于之前按照份额净值估值的单位净值。</p>
2	“二、风险揭示” “（二）一般风险揭示” “14、其他	<p>14、其他风险</p> <p>（1）关联交易的风险：管理人可以将本计划的资产投资于管理人、托管</p>	<p>15、其他风险</p> <p>（1）关联交易的风险</p> <p>管理人可运用本计划财产从事关联交</p>



<p><b>风险” “（1）关联交易的风险”</b></p>	<p>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承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易,管理人按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查,存在无法监控全部关联交易类型的风险,同时,本计划进行关联交易时可能存在一定的利益冲突风险,由此造成的损失由本计划财产承担。</p>	<p>易, 关联交易包括一般关联交易和重大关联交易, 管理人制定的划分标准、管控机制包括:</p> <p>1) 关联方范围</p> <p>本计划所称关联方包括:</p> <p>① 本计划管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方 (含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司);</p> <p>② 本计划的托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其他关联方;</p> <p>③本计划的投资顾问 (如有)、投资顾问的控股股东、实际控制人及其他关联方;</p> <p>④ 与管理人、本计划的托管人、投资顾问 (如有) 有其他重大利害关系的机构。上述第①项为管理人全部资产管理计划的关联方; 第②、③项为本计划的关联方。</p> <p>⑤ 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的, 管理人遵照执行。</p> <p>2) 关联交易范围: 本计划涉及的关联交易的具体类型包括但不限于:</p> <p>① 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方 (含管理人公司的一级全资子公司及控股子公司) 发行或者承销期内承销的证券;</p> <p>② 本计划财产投资于本计划托管人、托管人的控股股东、实际控制人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券;</p> <p>③ 本计划财产投资于其投资顾问 (如有)、投资顾问的控股股东、实际控制人及其</p>
--------------------------------	--	---

他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；

④ 本计划财产投资于管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；

⑤ 本计划财产投资于管理人对外作为投资顾问管理的资产管理产品；

⑥ 本计划财产投资于投资顾问（如有）担任管理人的资产管理产品（含公募基金）；

⑦ 本计划财产以本计划关联方或者以本条第（4）、（5）、（6）项规定的资产管理产品为交易对手，进行询价交易（包括但不限于银行间市场、交易所固收平台、大宗交易平台、场外基金申购、协议存款、逆回购交易等）；

⑧ 本计划财产以本计划关联方或者以本条第④、⑤、⑥项规定的资产管理产品为交易对手，进行《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》第三十八条第（五）项规定的非标准化资产交易；

⑨ 本计划财产开展逆回购交易，质押券为管理人、管理人的控股股东、实际控制人及其他关联方（含管理人的一级全资子公司及控股子公司）发行的证券；

⑩ 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的，管理人遵照执行。

3) 一般关联交易和重大关联交易

关联交易分为一般关联交易和重大关联

交易，实行分类管理。重大关联交易包括投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品且金额及比例重大的（本计划为 FOF 产品或本计划投资于货币基金的除外）、与关联方或关联方产品为交易对手开展非标准化资产交易、与关联方或关联方产品为交易对手进行询价交易或以管理人及其关联方发行的证券作为质押券开展逆回购交易且金额及比例重大的等需强化审批、披露、报告的关联交易；一般关联交易是指除重大关联交易以外的其他关联交易。监管机构和基金业协会对于一般关联交易和重大关联交易的区分标准有明确规定的，以监管机构和基金业协会的相关要求为准。

**委托人在此同意并授权管理人可以将本计划财产投资于一般关联交易。**管理人将本计划财产投资于一般关联交易的，在交易完成后，定期书面告知委托人和托管人并向管理人住所地中国证监会派出机构报告，具体以监管机构的要求为准。

**管理人将本计划财产投资于重大关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定和本合同约定，逐笔通过公告等方式提前通知投资者，投资者约定时间内未提出异议的视为同意。**委托人提出异议的处理方式，由管理人在通知中明确。同时，管理人应事后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，具体以监管机构的要求为准。

			<p>4) 关联交易的内部控制机制</p> <p>管理人应当遵循诚信、公平原则，以公平、合理的市场价格进行交易，防范利益冲突，禁止利益输送。管理人为此制定了相应的内控管理制度，明确了关联交易的范围及类型、审批程序、信息披露、关联数据库管理、稽核审计等内控机制并执行，参与关联交易管理的部门包括业务部门、内控部门等前中后台部门，管理人参与关联交易管理的部门按照内控机制的要求对关联交易进行审批。</p> <p>5) 产品关联方名单披露方式</p> <p>本产品的关联方名单信息将通过公告的形式在管理人指定网站上披露或其他适当的方式通知委托人。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>管理人按照上述标准及机制进行关联交易管理时，需按照各方提供的关联方名单进行关联交易的审查，存在无法监控全部关联交易类型的风险，同时，本计划进行关联交易时可能存在一定的利益冲突风险，由此造成的损失由本计划财产承担。</p>
--	--	--	---