

关于金元证券尊享定制年年红 1 号集合资产管理计划 资产管理合同变更的公告

尊敬的金元证券尊享定制年年红 1 号集合资产管理计划投资者：

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》的有关规定，以及《金元证券尊享定制年年红 1 号集合资产管理计划资产管理合同》中“第二十四节 资产管理合同的变更、终止与财产清算”的规定，经与托管人浙商银行股份有限公司协商一致并签订《金元证券尊享定制年年红 1 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议二》（以下简称“《补充协议二》”），管理人金元证券股份有限公司拟对《金元证券尊享定制年年红 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）、《金元证券尊享定制年年红 1 号集合资产管理计划说明书》（以下简称“《说明书》”）及《金元证券尊享定制年年红 1 号集合资产管理计划风险揭示书》（以下简称“《风险揭示书》”）的相关条款进行变更。现将《资产管理合同》变更主要条款予以公告，具体变更内容敬请各位投资者认真阅读《补充协议二》。《资产管理合同》变更主要内容如下：

一、“第五节 资产管理计划的基本情况”中的“4. 产品风险等级”

原条款为：

本集合计划属于 R2 中低风险等级产品，适合风险承受能力中低等级以上的投资者。

现修改为如下条款：

本集合计划属于 R3 中风险等级产品，适合风险承受能力中等级以上的投资者。

二、“第六节 资产管理计划的募集”中的“(一) 资产管理计划的募集对象、募集方式、募集期限”中的“1. 募集对象”

原条款为：

本集合计划属于固定收益类资产管理计划，属于 R2 中低风险等级产品，适合风险承受能力中低风险等级以上的投资者，本集合计划向合格投资者及专业投资者募集。

现修改为如下条款：

本集合计划属于固定收益类资产管理计划，属于 R3 中风险等级产品，适合风险承受能力中风险等级以上的投资者，本集合计划向合格投资者及专业投资者募集。

三、“第十一节 资产管理计划的投资”中的“(二) 投资范围、投资比例及投资限制”原条款为：

1. 投资范围

募集资金投资范围包括但不限于在交易所/银行间市场发行的国债、央行票据、各类金融债（含次级债、混合资本债、政策性金融债）、企业债券、公司债券、永续债、可转债、可交债、经银行间市场交易商协会注册发行的各类债务融资工具或交易所发行的各类债券工具等（含短期融资券、中期票据、超短融 SCP、非公开定向融资工具 PPN、资产证券化产品：ABS、ABN 等）。

货币市场工具和存款工具：包括但不限于现金、债券回购、银行存款、大额可转让存单等。

固定收益类基金：包括但不限于货币基金、债券基金等。

监管机构（人行、交易商协会、证监会、银保监会、发改委等）认可的其他标准化资产。

如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围，可以变更本计划的投资比例和限制。

2. 投资比例及投资限制

(1) 本产品投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于产品总资产的 80%;

(2) 本产品投资于同一资产的资金不得超过本产品资产净值的 25%; 同一证券期货经营机构管理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);

(3) 本产品参与债券、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产品的总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量;

(4) 主动投资于流动性受限资产的市值在开放期内合计不得超过本产品资产净值的 20%;

(5) 开放期内, 本产品资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于本产品资产净值的 10%;

(6) 债券正回购: 融入资金余额不超过计划资产净值的 100%;

(7) 本集合计划所投资的资产支持证券底层, 仅投资优先级份额且不为优先级的最后一级;

(8) 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, 该资产管理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不受前述规定限制;

(9) 本计划不得投资非标准化资产。

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证券期货经营机构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二十个交易日内调整至符合相关要求; 确有特殊事由未能在约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。

现修改为如下条款：

1. 投资范围

固定收益类投资品种：包括但不限于在银行间/交易所发行或上市交易的国债、企业债券、地方政府债、政府机构债、资产支持证券、公司债券（含非公开发行公司债）、可转换债券、可交换债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、经银行间市场交易商协会和发改委批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、超短期融资券、中期票据、项目收益债、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、债券逆回购、同业存单等；

权益类投资品种：国内依法发行上市的股票、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通股票”）；

期货和衍生品类资产：股指期货、国债期货以及证券交易所发行上市的股票期权、股指期权、CLN等

金融产品：公募证券投资基金以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品、基金公司及其子公司集合资产管理计划、基金公司及其子公司单一资产管理计划、在基金业协会备案的私募基金管理人发行的私募证券投资基金；

货币市场工具：包括但不限于银行存款（含通知存款、协议存款和同业存款）等；

如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围，可以变更本计划的投资比例和限制。

2. 投资比例及投资限制

（1）本产品投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于产品总资产的 80%；

（2）本产品投资于权益类资产的比例不超过本资产管理计划总资产的 20%；

(3) 本集合资产管理计划投资于期货和衍生品类资产合计市值占资产管理计划总值的比例不超过 20%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%。

(4) 本产品投资于同一资产的资金不得超过本产品资产净值的 25%；同一证券期货经营机构管理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）；

(5) 本产品参与债券、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产品的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

(6) 主动投资于流动性受限资产的市值在开放期内合计不得超过本产品资产净值的 20%；

(7) 开放期内，本产品资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本产品资产净值的 10%；

(8) 债券正回购：融入资金余额不超过计划资产净值的 100%；

(9) 本集合计划所投资的资产支持证券底层，仅投资优先级份额且不为优先级的最后一级；

(10) 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，该资产管理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不受前述规定限制；

(11) 本计划不得投资非标准化资产。

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证券期货经营机构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二十个交易日内调整至符合相关要求；确有特殊事由未能在约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。

四、本次变更投资范围新增权益类、期货和衍生品类资产等投资品种,同步变更资管合同“第十一节 资产管理计划的投资”中的“(五) 投资策略、决策依据及投资程序”中的“1. 投资策略”、“第十九节 资产管理计划财产的估值和会计核算”、“第二十三节 风险揭示”相关条款。

按照合同的上述约定,管理人特此就本次合同变更事项以网站公告的形式向委托人征询意见。对本次合同变更持反对意见的委托人可以选择于自公告之日起最近一个开放期(2024年12月6日)申请办理全额退出手续;如委托人未在上述时间内全额退出,将视为对本次合同变更无异议。

特此公告。

