

# 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

尊敬的投资者：

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。管理人拟对《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》和《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。主要变更内容详见本公告附件。

根据相关法律法规，为保证投资者的利益，本计划合同变更需取得投资者和托管人同意。本计划变更事宜已经获得托管人的书面同意确认。投资者如不同意本次合同变更的应在本计划开放日 2025 年 4 月 14 日提出退出申请。未提出退出申请的，视同投资者已经同意本次合同变更。截止 2025 年 4 月 14 日，若同意合同变更的投资者数量不少于 2 人（含 2 人），则我司约定 2025 年 4 月 16 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

二〇二五年四月十一日

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	“四、当事人及权利义务” “(二) 管理人”	法定代表人：刘学民 通讯地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼	法定代表人：吴礼顺 通讯地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 15 楼
2	“四、当事人及权利义务” “(六) 管理人的权利与义务”	/	2、管理人的义务 增加 “(28) 管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务，并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，配合托管人履行反洗钱义务；”
3	“五、资产管理计划的基本情况” “(四) 资产管理计划的投资目标、投资范围、投资比例”	2、投资范围 本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产、期货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：	2、投资范围 本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产、期货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种： 增加“(5) 期货和衍生品类资产：国债期货、股指期货；” 3、投资比例 增加“期货和衍生品类账户权益不超过资产总值的 20%，或期货和衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%；”
4	“八、资产管理计划的	2、证券期货经营机构及	2、证券期货经营机构及其子公司

序号	位置	原合同	变更后合同
	参与、退出与转让” “(五)证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出资产管理计划”	<p>其子公司自有资金参与、退出的条件</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个工作日以公告或其他方式通知全体委托人，并书面征求托管人同意。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>自有资金参与、退出的条件</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个工作日以公告或其他方式通知全体委托人，并书面征求托管人同意。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>增加</p> <p>4、自有资金参与、退出相关事项授权联系邮箱</p> <p>管理人：<a href="mailto:zgyypublic@fcsc.com">zgyypublic@fcsc.com</a></p> <p>托管人：</p>
5	“十一、资产管理计划的投资” “(二)资产管理计划的投资范围及投资比例”	<p>1、投资范围</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产、期货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>增加“(5)期货和衍生品类资产：国债期货、股指期货；”</p>	<p>1、投资范围</p> <p>本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产及中国证监会认可的其他投资品种：</p> <p>增加“(5)期货和衍生品类资产：国债期货、股指期货；”</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>增加“期货和衍生品类账户权益不超过资产总值的20%，或期货和衍生品</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
			类资产的持仓合约价值低于资产总值的 80%;”
6	“十一、资产管理计划的投资” “(七) 资产管理计划的投资策略”	/	<p>3、管理人投资管理的方法和标准增加</p> <p>“(4) 期货投资策略及相关安排</p> <p>1) 交易目的</p> <p>本集合计划根据市场情况变化，择机进行套保和投机交易，以期提升产品收益表现。</p> <p>2) 风险控制</p> <p>由于期货交易尤其是进行投机交易会涉及到对行情进行判断，因而存在着较高的市场风险，管理人会对以投机为目的的交易进行严格的控制和监管。首先，严格控制投机交易的规模，不得突破管理人有关规定及合同约定进行交易；其次，管理人将对期货的风险敞口进行监控。</p> <p>3) 责任承担</p> <p>管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定，因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，管理人不承担责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
			<p>确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议（如有）为准。</p> <p>4) 期货保证金的流动性应急处理机制</p> <p>①应急触发条件</p> <p>管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。</p> <p>②保证金补充机制</p> <p>如出现保证金不足的情况时，管理人将首先运用集合计划资产从市场上拆借资金；如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现集合计划资产，变现时应重点考虑变现资产的流动性，以最大限度的降低损失。</p> <p>③损失责任承担</p> <p>因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿，但管理人不承担受托资产的变现损失及未及时追加保证金的损失（包括穿仓损失）。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
			错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议（如有）为准。”
7	“十四、利益冲突及关联交易” “(四)资产管理计划的关联交易”	/	5、产品关联方名单披露方式 增加“托管人向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息，具体以托管人面向公开市场披露的信息为准。”
8	“十五、投资经理的指定与变更” “(一)投资经理的指定”	<p>2、本计划投资经理 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，具备成熟的公私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</p>	<p>2、本计划投资经理 本计划投资经理是傅婉丽、连伟程、祝嘉伟、周家生。</p> <p>本计划投资经理简介：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</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>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>	<p>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> <p>祝嘉伟，理学学士，FRM。于 2019 年加入第一创业证券，长期从事券商资管业务，擅长债券投资策略、量化建模、公募基金研究等，经验丰富。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>周家生，华中科技大学数量经济学硕士，于 2021 年加入第一创业证券，长期从事券商资管业务，在量化策略开发、策略配置等方面具有丰富的经验。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>
9	“十六、资产管理计划的财产”	5. 投资定期存款的银行账户的开立和管理	5. 投资定期存款的银行账户的开立和管理

序号	位置	原合同	变更后合同
	“(二) 资产管理计划财产相关账户的开立和管理”	<p>计划财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，其预留印鉴经各方商议后预留。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管资金账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户。”如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，托管人保管证实书正本或者复印件。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的</p>	<p>计划财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴应包含托管人指定印章。本着便于计划财产的安全保管和日常监督核查的原则，存款行应尽量选择托管人经办行所在地的分支机构。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。</p> <p>该协议中必须有如下条款或意思表示：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管资金账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户。”如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，原则上由托管人保管证实书正本。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。</p> <p>增加</p> <p>“7. 期货投资账户的开立和管理</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		处理方法由管理人和托管人双方协商解决。	管理人、托管人应当按照相关规定开立期货资金账户，在期货交易所获取交易编码。期货资金账户名称及交易编码对应名称应按照有关规定设立。”
10	<p>“十八、交易及交收清算安排”</p> <p>“二、投资证券后的清算交收安排”</p>	<p>(一) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：</p> <p>1. 资产托管人、资产管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则和规定，该等规则和规定自动成为本款规定的内容。资产管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则和规定，并遵守资产托管人为履行特别结算参与人的义务所制定的业务规则与规定。</p> <p>2. 资产托管人代理资产管理计划与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由资产托管人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于资产管理人原因造成资产托管人无法正常完</p>	<p>(一)关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：</p> <p>资产托管人、资产管理人应共同遵守双方签署的《托管银行证券资金结算协议》及对该协议不时的更新。</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>成结算业务，资产托管人发现后应立即通知资产管理人，由资产管理人负责解决，由此造成资产托管人无法按时向中国证券登记公司支付证券清算款的责任以及由此给资产托管人所托管的其他财产造成的损失由资产管理人承担。</p> <p>3. 资产管理人签署本合同/协议，即视为同意资产管理人在构成资金交收违约且未能按时指定相关证券作为交收履约担保物时，资产托管人可自行向结算公司申请由结算公司协助冻结资产管理人证券账户内相应证券，无需资产管理人另行出具书面确认文件。</p> <p>4. 资产托管人遵照中登公司上海分公司和中登公司深圳分公司备付金、保证金管理办法有关规定，确定和调整该委托财产最低结算备付金、证券结算保证金限额，资产管理人应存放于中登公司的最低备付金、结算保证金日末余额不得低于资产托</p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>管人根据中登公司上海和深圳分公司备付金、保证金管理办法规定的限额。资产托管人根据中登公司上海和深圳分公司规定向委托财产支付利息。</p> <p>5. 根据中登公司托管行集中清算规则，如委托财产T日进行了中登公司深圳分公司T+1DVP 卖出交易，资产管理人不能将该笔资金作为T+1 日的可用头寸，即该笔资金在T+1 日不可用也不可提，该笔资金在T+2 日才能划拨至托管资金账户。</p> <p>6. 根据中国证券登记结算有限责任公司的规定，结算备付金账户内的最低备付金、交易保证金账户内的资金按月调整按季结息，因此，资产管理合同终止时，资产管理计划可能有尚存放于结算公司的最低备付金、交易保证金以及结算公司尚未支付的利息等款项。对上述款项，资产托管人将于结算公司支付该等款项时扣除相应银行汇划费用后划付至资产</p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>管理计划清算报告中指定的收款账户。资产管理合同终止后，中登根据结算规则，调增计划的结算备付以及交易保证金，资产管理人应配合资产托管人，向资产托管人及时划付调增款项，以便资产托管人履行交收职责。</p> <p>7. 资产管理人知晓并确认，资产管理人管理资产中用于融资回购的债券将作为资产托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若资产管理人债券回购交收违约，结算公司依法对质押券进行处置。</p> <p>资产管理人应就债券回购交收违约后结算公司对质押券的处置以及委托人或受托人所应承担的委托债券投资风险，预先书面告知委托人或受托人，并由委托人或受托人签字确认。</p>	
11	“十八、交易及交收清算安排”	/	<p>五、投资银行存款的特别约定</p> <p>增加“（四）因投资需要在托管银行以外的其他银行开立活期账户进行投资的，管理人、托管人和存款行需在投资前另行签署三方协议。”</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
			<p>增加</p> <p>“六、期货投资的清算交收安排 本计划相关期货投资的具体操作 按照管理人、托管人及期货经纪机构签 署的《期货投资操作备忘录》（以实际 名称为准）的约定执行。”</p>
12	<p>“十九、越 权交易的界 定”</p>	<p>(二) 越权交易的处理程序</p> <p>1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为</p> <p>托管人对于越权交易，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行并立即要求管理人改正；未能改正或者造成本计划财产损失的，托管人应当及时通知管理人并报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会。</p> <p>根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人应当立即通知管理人，管理人在收到通知后应当及时核对或纠正。</p> <p>管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会派出机构。</p>	<p>(二) 越权交易的处理程序</p> <p>1、违反有关法律法规规定和本合同约定进行的投资交易行为</p> <p>托管人对于越权交易，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行并立即要求管理人改正；未能改正或者造成本计划财产损失的，托管人应当及时通知管理人并报告中国证监会派出机构。</p> <p>根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人应当立即通知管理人，管理人在收到通知后应当及时核对或纠正。</p> <p>管理人应向托管人主动报告越权交易，在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会派出机构。</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。</p> <p>管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地中国证监会派出机构及基金业协会。</p>	
13	<p>“二十、资产管理计划财产的估值和会计核算”</p> <p>“3、估值方法”</p>	<p>(5) 资产管理产品估值方法</p> <p>本计划持有的资产管理产品（证券公司集合资产管理计划、基金管理公司及基金子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和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、银行理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品）的管理人、托管人或其运营服务机构定期公布份额净值的，按照最新公布的份额净值估值（若公布份额净值的同时，也提供扣除业绩报酬后的虚拟单位净值，优先选择按虚拟单位净值估值）；所投资产品管理人或其授权机构未向托管人提供价格的，由本计划管理人协调提供，托管人以所投资产品管理人或其授权机构提供的数据进行账务处理。如所投资产管理产品公布的份额净值或虚拟单位净值错误等管理人和托管人之外的原因，导致本计划估值错误的，管理</p>	<p>(5) 资产管理产品估值方法</p> <p>本计划持有的资产管理产品（证券公司集合资产管理计划、基金管理公司及基金子公司集合资产管理计划、期货公司及期货公司子公司集合资产管理计划和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、银行理财产品及其他金融监管部门批准或备案发行的资产管理产品）的管理人、托管人或其运营服务机构定期公布份额净值的，按照最新公布的份额净值估值（若公布份额净值的同时，也提供扣除业绩报酬后的虚拟单位净值，优先选择按虚拟单位净值估值）；所投资产品管理人或其授权机构未向托管人提供价格的，由本计划管理人协调提供，托管人以所投资产品管理人或其授权机构提供的数据进行账务处理。如所投资产管理产品公布的份额净值或虚拟单位净值错误等管理人和托管人之外的原因，导致本计划估值错误的，管理</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>资产管理产品公布的份额净值或虚拟单位净值错误等管理人和托管人之外的原因，导致本计划估值错误的，管理人和托管人予以免责。</p> <p>管理人决定采取所投资资产管理产品的虚拟单位净值作为估值依据的，可以使用资产管理产品的管理人、托管人或其运营服务机构最近一次提供的虚拟单位净值，由于所投资资产管理产品的虚拟单位净值的真实性、准确性、完整性、及时性取决于该等资产管理产品基础数据，托管人仅根据其收到的虚拟单位净值对本计划进行估值。</p>	<p>人和托管人予以免责。</p> <p>管理人决定采取所投资资产管理产品的虚拟单位净值作为估值依据的，可以使用资产管理产品的管理人、托管人或其运营服务机构最近一次提供的虚拟单位净值，由于所投资资产管理产品的虚拟单位净值的真实性、准确性、完整性、及时性取决于该等资产管理产品基础数据，托管人仅根据其收到的虚拟单位净值对本计划进行估值。</p> <p>持有的私募基金管理人(基金业协会登记)发行并备案的私募证券投资基金，按标的产品私募基金托管人提供的最新基金估值信息估值。如投资标的份额变动基金管理人需及时提供份额变动确认凭证。</p> <p>增加</p> <p>“(8) 期货及衍生品的估值方法 交易所交易的金融衍生品(具体为以下品种: 国债期货、股指期货) 按估值日交易所公布的当日结算价估值; 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, 按最近交易日的结算价估值; 如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, 调整最近交易市价, 确定公允价格。</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
			(9) 估值计算中涉及港币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价或其他能反映公允价值的汇率。”
14	<p>“二十三、信息披露与报告”</p> <p>“(一)定期报告”</p>	/	<p>2、本计划的季度报告和年度报告</p> <p>(1) 本计划的资产管理季度报告增加“集合计划投资期货的，管理人应当在资产管理季度报告中披露资产管理计划参与相关标的的有关情况。若监管机构对资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。”</p> <p>(2) 本计划的资产管理年度报告和托管年度报告增加“集合计划投资期货的，管理人应当在资产管理年度报告中披露资产管理计划参与相关标的的有关情况。若监管机构对资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。”</p>
15	<p>“二十四、风险揭示”</p> <p>“(二)一般风险揭示”</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) 从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险</p> <p>按照资产管理合同约定，管理人在本计划存续期内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。</p> <p>管理人制定了关联交易内控管理</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<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②③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、</p>	<p>制度，明确了关联交易的类型和范围、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严格执行，但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虽然积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、防范利益输送，但仍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。此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时，管理人无法确保选择进行交易的实际交易结果（就投资完成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，或者关联交易行为可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，从而可能影响受托资产的投资收益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。</p> <p>管理人从事一般关联交易的，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事一般关联交易。该等事先约定同意、事后统一披露的方式可能造成投资者无法及时知悉本计划从事一般关联交易并采取措施，投资者愿承</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>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>担由此造成的参与财产损失。</p> <p>管理人从事重大关联交易的，可能因为重大关联交易金额或比例较高对本计划的投资运作产生较大影响。此外，对于重大关联交易，管理人将事先取得投资者同意，若投资者未及时更新有效联系方式，可能影响管理人征求意见的效率，进而可能影响本计划的投资策略实施。</p>

序号	位置	原合同	变更后合同
		<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 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的（如本计划财产开展逆回购交易的，将交易对手、质押券等统一纳入管理），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。重大关联交易是指投资于本计划关联方发行</p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>或承销期内承销的证券、投资于关联方产品的（本计划为 FOF 产品，或本计划投资于货币基金，或关联产品为公募基金、投资金额不超过该资管产品净值 10% 且不超过公募基金份额 10% 的除外）、与关联方及关联方产品为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20% 或金额超过 2 亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10% 或金额超过 3000 万元）的询价交易、以管理人及其关联方发行证券作为质押券开展的金额及比例重大（固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20% 或金额超过 2 亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10% 或金额超过 3000 万元）的逆回购交易等需强化审批、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</p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<p>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，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></p> <p>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>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		<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</p>	

序号	位置	原合同	变更后合同
		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，由此造成损失由本计划财产承担。	
16	“三十九、其他事项”	/	增加“（五）合同其他方签署本合同即视为知悉/授权管理人/托管人可为订立、履行个人作为一方当事人的合同所必需或为履行法定职责或者法定义务所必需而处理个人信息；管理人/托管人承诺对上述个人信息的处理合法合规，个人亦已知悉其享有《个人信息保护法》项下所有相关权利。如果个人信息系由一方向另一方提供的，提供方承诺已告知并获得相关个人同意向接收方提供个人信息，且个人已知晓个人信息的使用用途。”

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	“基本信息” “投资范围及	1、投资范围 本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产及中国证监会认可的其他投	1、投资范围 本计划投资于法律法规及监管规则允许证券公司集合资产管理计划投资的资产管理产品、权益类资产、固定收益类资产、期货和衍生品类资产及中国证监会认可的其他投资品种：

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
	“比例”	资品种:	<p>增加“（5）期货和衍生品类资产：国债期货、股指期货；”</p> <p>资产配置比例</p> <p>增加“期货和衍生品类账户权益不超过资产总值的20%，或期货和衍生品类资产的持仓合约价值低于资产总值的80%；”</p>
2	“基本信息” “投资策略”	/	<p>增加</p> <p>“(4) 期货投资策略及相关安排</p> <p>1) 交易目的 本集合计划根据市场情况变化，择机进行套保和投机交易，以期提升产品收益表现。</p> <p>2) 风险控制 由于期货交易尤其是进行投机交易会涉及到对行情进行判断，因而存在着较高的市场风险，管理人会对以投机为目的的交易进行严格的控制和监管。首先，严格控制投机交易的规模，不得突破管理人有关规定及合同约定进行交易；其次，管理人将对期货的风险敞口进行监控。</p> <p>3) 责任承担 管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定，因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签</p>

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
			<p>订的相关协议（如有）为准。</p> <p>4) 期货保证金的流动性应急处理机制</p> <p>①应急触发条件</p> <p>管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。</p> <p>②保证金补充机制</p> <p>如出现保证金不足的情况时，管理人将首先运用集合计划资产从市场上拆借资金；如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现集合计划资产，变现时应重点考虑变现资产的流动性，以最大限度的降低损失。</p> <p>③损失责任承担</p> <p>因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿，但管理人不承担受托资产的变现损失及未及时追加保证金的损失（包括穿仓损失）。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议（如有）为准。”</p>
3	<b>“管理人自有资金”</b>	<p>2、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的条件</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</p>	<p>2、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出的条件</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</p>

序号	位置	原计划说明书	变更后计划说明书
	“参与情况”	与、退出本计划的，应当提前 5 个工作日以公告或其他方式通知全体委托人，并书面征求托管人同意。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。	前 5 个工作日以公告或其他方式通知全体委托人，并通过邮件或其他双方认可的形式征求托管人同意。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。 增加 4、自有资金参与、退出相关事项授权联系邮箱 管理人：zgyypublic@fcsc.com 托管人：
4	“信息披露” “定期报告”	/	2、本计划的季度报告和年度报告 (1) 本计划的资产管理季度报告 增加“集合计划投资期货的，管理人应当在资产管理季度报告中披露资产管理计划参与相关标的的有关情况。若监管机构对资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。” (2) 本计划的资产管理年度报告和托管年度报告 增加“集合计划投资期货的，管理人应当在资产管理年度报告中披露资产管理计划参与相关标的的有关情况。若监管机构对资产管理计划参与上述标的的信息披露另有规定的，从其规定。”

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
----	----	--------	----------

		<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) 从事重大关联交易、一般关联交易所涉风险</p> <p>按照资产管理合同约定,管理人在本计划存续期内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。</p> <p>管理人制定了关联交易内控管理制度,明确了关联交易的类型和范围、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严格执行,但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虽然积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、防范利益输送,但仍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。此外,资产管理人运用计划财产从事关联交易时,管理人无法确保选择进行交易的实际交易结果(就投资完成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,或者关联交易行为可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使,从而可能影响受</p>
1	“(二)一般风险揭示”		

	<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>托资产的投资收益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。</p> <p>管理人从事一般关联交易的，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事一般关联交易。该等事先约定同意、事后统一披露的方式可能造成投资者无法及时知悉本计划从事一般关联交易并采取措施，投资者愿承担由此造成的参与财产损失。</p> <p>管理人从事重大关联交易的，可能因为重大关联交易金额或比例较高对本计划的投资运作产生较大影响。此外，对于重大关联交易，管理人将事先取得投资者同意，若投资者未及时更新有效联系方式，可能影响管理人征求意见的效率，进而可能影响本计划的投资策略实施。</p>
--	---	---

	<p>台、场外基金申购、协议存款等);</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 监管机构、基金业协会、管理人内部管理制度另有要求的(如本计划财产开展逆回购交易的，将交易对手、质押券等统一纳入管理)，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。</p> <p>重大关联交易是指投资于本计划关联方发行或承销期内承销的证券、投资于关联方产品的(本计划为FOF产品，或本计划投资于货币基金，或关联产品为公募基金、投资金额不超过该资管产品净值10%且不超过公募基金份额10%的除外)、与关联方及关联方产品为交易对手开展非标准化资产交易或金额及比例重大(固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值20%或金额超过2亿元，权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额</p>	
--	--	--

	<p>超过资管产品净值 10%或金额超过 3000 万元) 的询价交易、以管理人及其关联方发行证券作为质押券开展的金额及比例重大(固定收益类单笔交易金额超过资管产品净值 20%或金额超过 2 亿元, 权益类、衍生品及其他标准化资产单笔交易金额超过资管产品净值 10%或金额超过 3000 万元) 的逆回购交易等需强化审批、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。</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</b></p>
--	---

	<p><b>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</p>	
--	--	--

	<p>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>	
--	--	--