



华金证券鸿盈 1 号集合资产管理计划 资产管理合同变更的公告

尊敬的投资者：

我公司作为华金证券鸿盈 1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）的管理人，在与托管人协商后，签订《华金证券鸿盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》之补充协议一，对《华金证券鸿盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及《关于华金证券股份有限公司托管在兴业银行股份有限公司部分集合资产管理计划自有资金、关联交易及业绩报酬等相关条款变更的函》（以下合称“原合同”）内容进行了修改，**变更内容如下：**

（一）原合同“第四节 合同当事人及权利义务”部分变更如下：

1、原合同部分当事人信息变更如下：

原条款为：

“管理人

机构名称：华金证券股份有限公司

法定代表人：宋卫东

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 759 号 30 层

通信地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 30 层

邮政编码：200120

联系人：宁鹏飞

联系电话：021-20655728

托管人

机构名称：兴业银行股份有限公司

法定代表人：陶以平（代为履行法定代表人职权）

注册地址：福州路湖东路 154 号

通信地址：上海市银城路 167 号 4 楼

邮政编码：200120

联系人：谭贵洪

联系电话：021-52629999”



修改为：

“管理人

机构名称：华金证券股份有限公司

法定代表人：燕文波

注册地址：上海市静安区天目西路 128 号 19 层 1902 室

通信地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 30 层

邮政编码：200120

联系人：陈瑛明

联系电话：021-20655551

托管人

机构名称：兴业银行股份有限公司南京分行

负责人：叶向峰

注册地址：南京市玄武区长江路 2 号

通信地址：南京市玄武区长江路 2 号

邮政编码：210005

联系人：李国伟

联系电话：025-83193666”

2、原合同“（三）管理人的权利和义务 2. 管理人的义务”的相关条款新增内容。具体如下：

“（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；

（29）除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传。”

（二）原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”部分变更如下：

1、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况（四）存续期限”部分：

原表述：

“（四）存续期限

5 年，可展期或提前结束。”



修改为：

“（四）存续期限

10年，可展期或提前结束。”

2、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况（五）运作方式”中“3.2、投资范围”部分：

原表述：

“本集合计划投资于具有良好流动性的金融工具，包括银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债券、地方政府债、央行票据、企业债、公司债、金融机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、非公开定向债务融资工具、债券型基金、**分级基金A类份额**、资产支持证券优先级、可交换债券、可转换债券、现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金，包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

本集合计划不直接投资股票等权益类资产，但可持有因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票，**因分级基金定期折算、不定期折算、分级基金分拆合并或分级基金基于《指导意见》要求整改转型而持有的权益型基金（包括股票型基金和混合型基金，下同）**。因上述原因持有的股票、**权益型基金**，本集合计划将在其可交易之日起的10个工作日内卖出**或赎回**。本集合计划投资于包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货，以套期保值和对冲风险的目的进行投资。”

修改为：

“本集合计划投资于具有良好流动性的金融工具，包括银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债券、地方政府债、央行票据、企业债、公司债、金融机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、非公开定向债务融资工具、债券型基金（**包括可转债ETF**）、资产支持证券优先级、可交换债券、可转换债券、现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金，包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

本集合计划不直接投资股票等权益类资产，但可持有因可转换债券、可交换



债券转股所形成的股票。因上述原因持有的股票，本集合计划将在其可交易之日起的 10 个工作日内卖出。本集合计划可投资于包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货，以套期保值和对冲风险的目的进行投资。

如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。”

(三) 对原合同“第八节 集合计划的参与、退出与转让 (七) 管理人自有资金参与本集合计划情况”的相关条款进行调整。具体如下：

原条款为：

“ (七) 管理人自有资金参与本集合计划情况

管理人自有资金可以参与本集合计划，将按照本合同约定以及相关法律法规的规定执行。

1、自有资金参与的持有期限：证券期货经营机构自有资金参与本集合计划的，持有期限不得少于 6 个月。

2、自有资金的参与方式和金额：管理人以自有资金参与本集合计划，将通过本集合计划销售机构规定的方式参与。

3、自有资金参与的金额和比例：参与份额不超过本集合计划总份额的 16%，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划或其子公司管理的单个集合资产管理计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。

4、自有资金的收益分配：管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他持有本类份额的投资者享有同等收益分配的权利和义务。

5、自有资金份额责任承担方式和金额：管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他份额投资者享有同等权利和义务。

6、自有资金参与、退出的条件：

(1) 募集期内，管理人可以在符合本合同要求的条件下，以自有资金参与本集合计划，托管人签署本合同、投资者认购本集合计划即视为同意管理人参与本集合计划；

(2) 存续期内，证券期货经营机构拟以自有资金参与、退出本集合计划的，应当提前 5 个交易日通过管理人网站发布公告，并书面告知托管人取得其同意，



公告期满投资者未提出异议且未退出的视为其同意，管理人不再另行通知；投资者不同意的，管理人有权在公告中说明的公告期满后将该投资者持有的全部资产管理计划份额强制退出本计划（退出价格为强制退出当日资产管理计划财产份额净值），由此发生的相关税费、或有损失由该投资者自行承担；

（3）投资者和托管人在此不可撤销地同意并授权管理人：因集合计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与份额比例被动达到或超过本集合计划份额的 16%的，管理人可以对自有资金超限部分强制退出，以满足上述自有资金参与比例管理标准，但需事后及时告知投资者和托管人。投资者和托管人签署本合同，并且投资者参与本资产管理计划份额，即视为投资者和托管人已经充分理解并同意上述安排；

（4）为应对本集合计划巨额赎回（如有）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可不受上述约定限制。出现上述情形时，管理人应及时告知投资者和托管人，并向住所地中国证监会派出机构报告。

7、风险提示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注计划规模变动情况，控制流动性风险。

8、信息披露：管理人及时在管理人指定网站公告自有资金参与和退出情况。”

修改为：

“（七）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划

1. 自有资金参与的条件

证券期货经营机构及其子公司在初始募集期和存续期均可以自有资金参与本集合计划。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划，应符合法律、行政法规、中国证监会及协会和本合同的相关规定。

2. 自有资金参与的金额和比例

管理人自有资金参与本集合计划的份额不得超过本计划总份额的 25%。证券期货经营机构及其子公司的自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过集合计划总份额的 50%。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过前述比例的，管理人应在具备退出本计划条件时将自有资金比例降至



适合比例，并在退出本计划后 5 个工作日内及时以网站公告的形式告知投资者、以邮件等书面形式告知托管人。

3. 自有资金的责任承担方式与收益分配

管理人自有资金参与集合计划，按照其参与份额比例分享同等收益、承担同等风险。

自有资金的参与和退出时应当符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

4. 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月。在满足持有期不少于 6 个月等监管规定的前提下，管理人有权退出以自有资金参与的本集合计划的份额。

投资者签署本合同即视为知悉并同意管理人可以在初始募集期内以自有资金参与本集合资产管理计划。证券期货经营机构及其子公司在初始募集期以自有资金参与集合资产管理计划的，应当在发布募集公告时披露自有资金参与情况；证券期货经营机构及其子公司在存续期以自有资金参与、退出集合资产管理计划的，应当提前 5 个工作日告知和征询全体投资者的意见，并以邮件等书面形式征询托管人，取得托管人同意，投资者应在管理人指定的征询日期内按指定的形式回复意见。投资者未在指定征询日期内回复的视为同意；投资者不同意管理人自有资金参与、退出的，有权在管理人公告规定的时间内提出退出本集合计划的申请；对于明确回复不同意管理人自有资金参与、退出且逾期未退出的投资者，管理人将统一做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划份额净值），具体强制退出时间以管理人公告为准。

为应对集合资产管理计划巨额退出以解决流动性风险、因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过前述比例的，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，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受上述限制，但应于事后 5 个工作日内及时告知投资者和托管人，并根据监管要求向中国证监会相关派出机构报告。

集合计划存续期内，当法律法规或有关自有资金参与集合计划的监管规定或政策发生变更，管理人经与托管人协商一致并公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整。投资者对修改或调整的内容有异议，可在修改或调整的内容



生效前按照本合同规定申请退出集合计划。投资者未退出的，视为同意修改或调整的内容。”

（四）原合同“十一、集合计划的投资”部分做如下调整：

1、“十一、集合计划的投资”部分“（二）投资范围及比例”调整如下：

原表述：

“（二）投资范围及比例

本集合计划投资于具有良好流动性的金融工具，包括银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债券、地方政府债、央行票据、企业债、公司债、金融机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、非公开定向债务融资工具、债券型基金、**分级基金 A 类份额**、资产支持证券优先级、可交换债券、可转换债券、现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金，包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

本集合计划不直接投资股票等权益类资产，但可持有因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票，因分级基金定期折算、不定期折算、分级基金分拆合并或分级基金基于《指导意见》要求整改转型而持有的权益型基金（包括股票型基金和混合型基金，下同）。因上述原因持有的股票、权益型基金，本集合计划将在其可交易之日起的 10 个工作日内卖出或赎回。本集合计划投资于包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货，以套期保值和对冲风险的目的进行投资。

2. 投资比例

（1）本集合计划投资于固定收益类的比例不低于集合计划资产总值的 80%。

（2）本集合计划投资于股指期货、国债期货，以套期保值和对冲风险的目的，衍生品账户权益不超过本计划资产总值的 20%。

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 个交易日内将投资比例降至许可范围内（如遇相关证券不能上市交易的，上述时间期限自动顺延），并向管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。若法律、法规、行政政策对管理人报备事宜有新规定的，



按新规定执行。”

修改为：

“（二）投资范围及比例

1. 投资范围

本集合计划投资于具有良好流动性的金融工具，包括银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债券、地方政府债、央行票据、企业债、公司债、金融机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、非公开定向债务融资工具、债券型基金（包括可转债 ETF）、资产支持证券优先级、可交换债券、可转换债券、现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金，包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

本集合计划不直接投资股票等权益类资产，但可持有因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票。因上述原因持有的股票，本集合计划将在其可交易之日起的 10 个工作日内卖出。本集合计划可投资于包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货，以套期保值和对冲风险的目的进行投资。

2. 投资比例

（1）本集合计划投资于固定收益类资产的比例不低于集合计划资产总值的 80%。

（2）本集合计划投资于股指期货、国债期货，以套期保值和对冲风险的目的，衍生品账户权益不超过本计划资产总值的 20%。

本集合计划建仓期结束后，本集合计划投资组合的比例应符合上述投资比例的约定。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管理人之外的因素，造成集合计划除股指期货、国债期货以外的投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的二十个交易日内将投资比例降至许可范围内（如遇相关证券不能上市交易的，上述时间期限自动顺延）。确有特殊事由未能在上述时间内完成调整的，管理人应向住所地中国证监会派出机构报告。若因证券期货市场波动、资产管理计划规模变动等证券公司之外的原因致使集合计划中股指期货、国债期货投资比例超标的，管理人应当在 10 个交易



日内将投资比例降至许可范围内(如遇相关证券不能上市交易的,上述时间期限自动顺延),同时在该情形发生之日起2个工作日内向管理人住所地证监局报告。

全体投资者不可撤销地同意并授权管理人在本集合计划存续期间,为规避特定风险,投资于【固定收益类】资产的比例可以低于计划总资产的80%,但不得持续6个月低于计划总资产的80%。上述特定风险包括但不限于因经济政策、交易制度、交易方式、市场环境等因素的变化可能对资产收益产生不利影响而产生的风险。”

2、删除“十一、集合计划的投资 (六) 投资策略 4.2、固定收益类资产投资策略”中“(3) 分级A投资策略”并调整后续(4)(5)(6)(7)策略的序号为(3)(4)(5)(6),具体删除内容如下:

删除原表述:

“(3) 分级A投资策略

分级A属于低风险高收益的债性品种,持有分级A的收益主要来自三部分:利息收入、利差收益、下折收益。管理人在分析分级A隐含收益率的基础上,以高折价分级A为主要投资标的。

1) 长期持有策略

该策略较为简单,选取隐含到期收益率较高的品种,长期持有,获得比无风险收益率更高的收益。

2) 期权策略

该策略属于分级基金折价套利策略。分级A附带一定的期权价值,而折溢价率是影响期权价值最重要的变量。当分级A处于折价状态,期权价值为正;当分级A处于溢价状态,期权价值为负。B净值逼近下折时A的期权价值应该得到体现,分级A价格上升。无论是市场大幅波动还是市场规则出现重大变动,分级A的期权价值将凸显。买入期权价值被低估的品种,长期看可以获得一定收益。

3) 套利策略

分级基金的母份额可以申购赎回,子份额在二级市场上交易。当子份额的交易价格同母基金净值整体不相等时,就存在套利的机会。当子份额交易价格相对于母基金净值溢价时,可以通过申购母基金份额,分拆为子基金份额,在场内分别卖出获利;当子份额交易价格相对于母基金净值折价时,可以通过场内买入



子份额，合并为母基金份额，在场外赎回获利。”

（五）原合同“第十四节 利益冲突及关联交易”做如下调整：

原表述：

“（一）利益冲突情形

本计划可能存在如下涉及利益冲突的情况：

1. 以资产管理计划资产参与关联交易；
2. 管理人董事、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；
3. 管理人自有资金参与和退出本计划；
4. 其他利益冲突的情形。

（二）关联交易的定义、分类标准及管控机制

1. 关联交易的定义

关联交易包括资产管理计划投资于管理人、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股票、债券、资产支持证券等各类证券或者承销期内承销的证券，及与管理人关联方互为交易对手的交易。

管理人将在公司网站（www.huajinsc.cn）披露管理人关联方名单，托管人关联方名单请关注托管人公布的信息，查询路径：www.cib.com.cn。

2. 关联交易的分类

管理人在运用受托管理资产从事关联交易时，将按照法律法规及中国证监会的有关规定，对关联交易按照重要性原则区分为一般关联交易和重大关联交易并进行分层管理。

3. 一般关联交易的管控机制

投资者在此不可撤销地同意并授权管理人可以将本集合计划的资产从事以下一般关联交易：

（1）将本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、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等发行或承销期承销的单证券、管理的单只公募基金的资金或与管理人关联方互为交易对手发生交易行为时，单证券交易金额不超过本集合计划净值的 10%（不含）；

（2）其他符合法律法规、监管准则和自律规则认定的一般关联交易。



一般关联交易经管理人相应内部审批程序审批通过后方可进行，管理人设置两级审批流程，资产管理计划需参与关联交易的，由投资经理书面说明关联交易的必要性，定价依据等，经部门负责人审批后，由合规风控部门审核后方可进行交易，审批人员亦需重点审核关联交易的必要性、交易价格公允性等，确保该关联交易符合本资产管理计划投资者的利益。

管理人在一般关联交易发生后，应及时告知投资者和托管人，事后单独以公告或定期报告的形式进行披露并按照最新监管要求履行报告义务。

4、重大关联交易的管控机制

重大关联交易认定标准如下：

(1) 将本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、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等发行或承销期承销的单证券、管理的单只公募基金的资金或与管理人关联方互为交易对手发生交易行为时，单证券交易金额达到本集合计划净值的 10%及以上的；

(2) 其他法律法规、监管准则、自律规则或按照实质重于形式原则认定的重大关联交易情形。

重大关联交易需先经管理人履行内部审批程序，由管理人设置的资产管理业务决策机构（资产管理产品及业务决策委员会）审批，该委员会由合规部门及风控部门人员列席，所有委员采取记名投票表决方式，同意票数得到有效票数三分之二（含）方通过。此外，重大关联交易还需履行如下程序后方可进行。

管理人拟以集合计划资产从事重大关联交易的（包括单笔或多笔合计），应提前 5 个工作日逐笔通过征询或发布公告等方式征求投资者意见，投资者如有异议的，应于公告发布后 3 个工作日内书面回复，如全体投资者均未提出书面异议的，管理人方可开展该次重大关联交易，如有投资者书面提出不同意进行该次重大关联交易的，则管理人不得进行此次重大关联交易。管理人将单独通过公告形式将相关结果或关联交易情况告知所有投资者及托管人，并根据最新监管要求履行报告义务。

(三) 若管理人董事、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管理人设立的资产管理计划，管理人应当向投资者进行披露，对该计划账户进行监控，并按监管要求进行报告。



（四）其他利益冲突的情形

除前述规定外，管理人不得将本资管计划的委托资产，通过直接投资、投资其他资产管理计划或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构、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。

管理人禁止违规关联交易，遵循投资者利益优先原则对非禁止性关联交易进行专项审批和管控，防范利益冲突，保护投资者合法权益。法律法规、监管准则和自律规则对集合计划关联交易另有规定的，管理人按届时有效的规定执行。”

修改为：

“（一）利益冲突情形

本计划可能存在如下涉及利益冲突的情况：

1. 以资产管理计划资产参与关联交易；
2. 管理人董事、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；
3. 管理人自有资金参与和退出本计划；
4. 其他利益冲突的情形。

（二）关联交易的定义、分类标准及管控机制

1. 关联交易的定义

本计划的关联交易是指本计划与关联方之间进行的各类投资交易，包括：

- （1）本计划投资于本计划关联方发行的股票、债券、资产支持证券等各类证券；
- （2）本计划投资于管理人关联方、托管人关联方承销期内承销的证券；
- （3）本计划投资于管理人及其关联方管理的资产管理计划；
- （4）本计划与管理人关联方互为交易对手或管理人关联方发行的债券作为质押券的交易。

本计划关联方主要包括：

- （1）管理人关联方，管理人通过电子邮件等书面形式向托管人发送管理人关联方名单。
- （2）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。

(3) 其他关联方，指其他根据实质重于形式原则认定的本计划关联方，包括但不限于：本计划的机构投资者的关联方视为本计划的关联方。

2. 关联交易的分类

管理人在运用受托管理资产从事关联交易时，将按照法律法规及中国证监会的有关规定，对关联交易按照重要性原则区分为一般关联交易和重大关联交易并进行分层管理。

3. 一般关联交易的管控机制

投资者在此不可撤销地同意并授权管理人可以将本集合计划的资产从事以下一般关联交易：

(1) 投资于本计划关联方发行的单证券的资金不超过本计划净值的 10%（不含）；

(2) 投资于本计划管理人关联方、托管人关联方承销期内承销的单证券（不含利率债）的资金不超过本计划净值的 10%（不含）；

(3) 投资于本计划管理人关联方、托管人关联方承销期内承销的单只利率债；

(4) 投资于管理人及其关联方管理的资产管理计划的资金累计不超过本计划净值的 10%（不含）；

(5) 与管理人关联方互为交易对手发生交易行为时，未了结交易金额合计不超过本计划净值的 10%（不含）；

(6) 其他符合法律法规、监管准则和自律规则认定的一般关联交易。

一般关联交易经管理人相应内部审批程序审批通过后方可进行，管理人设置两级审批流程，资产管理计划需参与关联交易的，由投资经理书面说明关联交易交易的必要性，定价依据等，经部门负责人审批后，由合规风控部门审核后方可进行交易，审批人员亦需重点审核关联交易的必要性、交易价格公允性等，确保该关联交易符合本资产管理计划投资者的利益。

管理人在一般关联交易发生后，应及时告知投资者和托管人，事后单独以公告或定期报告的形式进行披露并按照最新监管要求履行报告义务。

4、重大关联交易的管控机制



重大关联交易认定标准如下：

(1) 投资于本计划关联方发行的单证券的资金单笔或累计达到本计划净值的 10%及以上；

(2) 投资于本计划管理人关联方、托管人关联方承销期内承销的单证券（不含利率债）的资金单笔或累计达到本计划净值的 10%及以上；

(3) 投资于管理人及其关联方管理的资产管理计划资金单笔或累计达到本计划净值的 10%及以上；

(4) 与管理人关联方互为交易对手发生交易，未了结交易金额合计达到本计划净值的 10%及以上的；

(5) 其他法律法规、监管准则、自律规则或按照实质重于形式原则认定的重大关联交易情形。

重大关联交易需先经管理人履行内部审批程序，由管理人设置的资产管理业务决策机构（资产管理产品及业务决策委员会）审批，该委员会由合规部门及风控部门人员列席，所有委员采取记名投票表决方式，同意票数得到有效票数三分之二（含）方通过。此外，重大关联交易还需履行如下程序后方可进行。

管理人拟以集合计划资产从事重大关联交易的（包括单笔或多笔合计），应提前 5 个工作日逐笔通过征询或发布公告等方式征求投资者意见，投资者如有异议的，应于公告发布后 3 个工作日内书面回复，如全体投资者均未提出书面异议的，管理人方可开展该次重大关联交易，如有投资者书面提出不同意进行该次重大关联交易的，则管理人不得进行此次重大关联交易。管理人将单独通过公告形式将相关结果或关联交易情况告知所有投资者及托管人，并根据最新监管要求履行报告义务。

(三) 若管理人董事、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管理人设立的资产管理计划，管理人应当向投资者进行披露，对该计划账户进行监控，并按监管要求进行报告。

(四) 其他利益冲突的情形

除前述规定外，管理人不得将本资管计划的受托资产，通过直接投资、投资其他资产管理计划或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构、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。

管理人禁止违规关联交易，遵循投资者利益优先原则对非禁止性关联交易进行专项审批和管控，防范利益冲突，保护投资者合法权益。法律法规、监管准则和自律规则对集合计划关联交易另有规定的，管理人按届时有效的规定执行。”

（六）原合同“十六、集合计划的财产（二）集合计划财产相关账户的开立和管理”中“5. 定期存款账户”部分做如下调整：

原表述：

“5. 定期存款账户

委托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。定期存款账户户名应与托管账户保持一致，该账户预留印鉴由管理人负责预留。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。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，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专户（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。存款证实书原件由管理人负责办理、取得并保管。”

修改为：

“5. 投资定期存款的银行账户的开立和管理

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检查的原则，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。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。”

（七）原合同“十八、越权交易的界定（二）越权交易的处理程序”中“1. 违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为”部分做如下调整：

原表述：

“托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构或基金业协会。

托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构或基金业协会。

管理人应向托管人主动报告越权交易并限期改正。托管人有权督促管理人在限期内改正并在期限内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。”

修改为：

“托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构。

托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知管理人，并依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构。

管理人应向托管人主动报告越权交易并限期改正。托管人有权督促管理人在限期内改正并在期限内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人依据相关法律法规的要求报告中国证监会。”

（八）原合同“十八、越权交易（三）托管人对管理人投资运作的监督



”中第1部分第(8)条内容做如下调整：

原表述：

“（8）可转债转股、可交换债换股所带来持股、为参与优先配售可转债在可转债发行公告公布的股权登记日买入该可转债对应的股票需在其具备可上市流通条件后20个交易日内卖出；因分级基金定期折算、不定期折算、分拆合并或分级基金基金监管要求整改转型而持有的权益型基金份额均须在具备赎回、交易条件后10个工作日内赎回或卖出；”

修改为：

“8）可转债转股、可交换债换股所带来持股、为参与优先配售可转债在可转债发行公告公布的股权登记日买入该可转债对应的股票需在其具备可上市流通条件后20个交易日内卖出；”

（九）原合同“十八、越权交易 （三）托管人对管理人投资运作的监督”中第1部分：

新增：

“备注：其中期货交易目的由管理人自行监控。”

（十）原合同“十八、越权交易 （三）托管人对管理人投资运作的监督”：

新增：

“5、管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责的，由管理人/过错方承担相应的责任。”

（十一）原合同“十九、集合计划财产的估值和会计核算 （一）集合计划财产的估值”中“7.3、证券投资基金的估值方法”部分做如下调整：

原表述：

“7.3、证券投资基金的估值方法

（1）持有的交易所上市基金，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且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，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；



(2) 持有的场外基金，按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；

(3) 持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利；

(4) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值。”

修改为：

“7.3、基金的估值方法

在交易所交易的基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)、交易型货币基金、ETF基金等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值，但最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价等变化因素，确定公允价值进行估值。

未上市流通的其他开放式证券投资基金按估值日上一工作日的基金份额净值估值，当日未公布的，且整体市场环境及投资标的未发生重大变化的，以估值当日能获取的最新基金份额净值为准。若有充足证据表明最近可获取的单位净值不能真实反映公允价值的，可采用估值技术确定公允价值；

非交易所上市的货币市场基金，按所投资基金前一估值日的万份收益计提估值日基金收益。”

(十二) 原合同“第二十三章 风险揭示 (二) 一般风险揭示”部分，新增风险揭示如下：

增加条款：

“19、资金前端控制产生的风险

根据《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》的要求，管理人应控制在交易所实施竞价交易且为净额担保结算的交易品种的全天净买入金额，在极端情况下，可能因相关交易单元买入申报金额不符合资金前端控制额度限制而导致买入申报被拒绝。

20、本计划计提业绩报酬导致投资者实际收益低于产品净值收益率的风险

本合同约定本集合计划的业绩报酬计提日为收益分配日、份额退出日和本集合计划终止日。在收益分配日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中提取。管



理人从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次。在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。

由于业绩报酬的设置，本集合计划进行收益分配或投资者赎回本计划时，如满足业绩报酬计提标准的，投资者收到的资金为扣除业绩报酬后的资金，会低于按照产品净值计算的收益率，请投资者特别留意由此可能导致的风险。”

（十三）原合同“第二十八、其他事项”部分新增内容，具体如下：

新增：

“合同其他方签署本合同即视为知悉/授权托管人可为订立、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；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。”

《华金证券鸿盈 1 号集合资产管理计划说明书》《华金证券鸿盈 1 号集合资产管理计划风险揭示书》相关内容一并调整。

根据原合同第二十五章、资产管理合同的变更、终止与财产清算中的约定：“由于其他原因（包括但不限于改变投向和比例）需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致，并通过在管理人网站公告的形式向投资者征求意见（本合同另有约定的除外）。

投资者不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利，管理人可采取措施安排投资者办理退出集合计划的业务；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人有权在公告中说明的回复期限届满后，将其份额强制退出集合计划，由此发生的相关税费或或有损失由投资者自行承担。投资者未在管理人指定期限内回复意见的，视为投资者同意。

合同变更生效日以管理人公告为准。集合计划份额的退出价格为退出当日集合计划单位净值。

投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人变更本合同的行为均不应被视为或认定为管理人的违约行为。”。

本公告于 2025 年 8 月 29 日由管理人以网站公告的形式向投资者征求意见，



投资者不同意变更的,应在征询意见发出的5个工作日内提出退出本集合计划的申请,即于2025年9月4日15:00(含)前以邮件形式发送姓名+证件类型+证件号码+“不同意华金证券鸿盈1号集合资产管理计划合同变更”至管理人邮箱chenxin2@huajinsc.cn,或投资者在本集合计划特别开放期内进行份额赎回申请。

管理人于2025年9月4日设置特别开放期,仅为不同意合同变更的客户办理赎回业务。在本公告满5个工作日后,《华金证券鸿盈1号集合资产管理计划资产管理合同》之补充协议一将于2025年9月5日正式生效。

特此公告。

附:《华金证券鸿盈1号集合资产管理计划资产管理合同》之补充协议一

华金证券股份有限公司

2025年8月28日



《华金证券鸿盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》之 补充协议一

投资者

个人填写：

- 姓名：
- 证件类型：
- 证件号码：
- 通信地址：
- 邮政编码：
- 联系电话：
- 电子信箱：
- 其他：

机构填写：

- 机构名称：
- 法定代表人：
- 注册地址：
- 通信地址：
- 邮政编码：
- 代理人姓名：
- 代理人身份证号码：
- 联系电话：
- 传真：
- 其他：

管理人

- 机构名称：华金证券股份有限公司
- 法定代表人：燕文波
- 注册地址：上海市静安区天目西路 128 号 19 层 1902 室
- 通信地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 30 层





邮政编码：200120

联系人：陈瑛明

联系电话：021-20655551

托管人

机构名称：兴业银行股份有限公司南京分行

负责人：叶向峰

注册地址：南京市玄武区长江路2号

通信地址：南京市玄武区长江路2号

邮政编码：210005

联系人：李国伟

联系电话：025-83193666

鉴于：

投资者、管理人、托管人三方已经签署了《华金证券鸿盈1号集合资产管理计划资产管理合同》及《关于华金证券股份有限公司托管在兴业银行股份有限公司部分集合资产管理计划自有资金、关联交易及业绩报酬等相关条款变更的函》（以下合称“原合同”）。出于产品投资运作、投资者利益考虑，经各方友好协商，特签订本补充协议。

一、改动内容：

（一）原合同“第四节 合同当事人及权利义务”部分变更如下：

1、原合同部分当事人信息变更如下：

原条款为：

“管理人

机构名称：华金证券股份有限公司

法定代表人：宋卫东

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区杨高南路759号30层

通信地址：上海市浦东新区杨高南路759号30层

邮政编码：200120

联系人：宁鹏飞



联系电话：021-20655728

托管人

机构名称：兴业银行股份有限公司

法定代表人：陶以平（代为履行法定代表人职权）

注册地址：福州路湖东路 154 号

通信地址：上海市银城路 167 号 4 楼

邮政编码：200120

联系人：谭贵洪

联系电话：021-52629999”

修改为：

“管理人

机构名称：华金证券股份有限公司

法定代表人：燕文波

注册地址：上海市静安区天目西路 128 号 19 层 1902 室

通信地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 30 层

邮政编码：200120

联系人：陈瑛明

联系电话：021-20655551

托管人

机构名称：兴业银行股份有限公司南京分行

负责人：叶向峰

注册地址：南京市玄武区长江路 2 号

通信地址：南京市玄武区长江路 2 号

邮政编码：210005

联系人：李国伟

联系电话：025-83193666”

2、原合同“（三）管理人的权利和义务 2. 管理人的义务”的相关条款新增内容。具体如下：

“（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；

（29）除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传。”

（二）原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”部分变更如下：

1、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况（四）存续期限”部分：

原表述：

“（四）存续期限
5年，可展期或提前结束。”

修改为：

“（四）存续期限
10年，可展期或提前结束。”

2、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况（五）运作方式”中“3.2、投资范围”部分：

原表述：

“本集合计划投资于具有良好流动性的金融工具，包括银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债券、地方政府债、央行票据、企业债、公司债、金融机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、非公开定向债务融资工具、债券型基金、分级基金A类份额、资产支持证券优先级、可交换债券、可转换债券、现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金，包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

本集合计划不直接投资股票等权益类资产，但可持有因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票，因分级基金定期折算、不定期折算、分级基金分拆合并或分级基金基于《指导意见》要求整改转型而持有的权益型基金（包括股票型基金和混合型基金，下同）。因上述原因持有的股票、权益型基金，本集合计划将在其可交易之日起的10个工作日内卖出或赎回。本集合计划投资于包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货，以套期保值和对冲风险的目的进行投资。”



修改为：

“本集合计划投资于具有良好流动性的金融工具，包括银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债券、地方政府债、央行票据、企业债、公司债、金融机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、非公开定向债务融资工具、债券型基金（包括可转债ETF）、资产支持证券优先级、可交换债券、可转换债券、现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金，包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

本集合计划不直接投资股票等权益类资产，但可持有因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票。因上述原因持有的股票，本集合计划将在其可交易之日起的10个工作日内卖出。本集合计划可投资于包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货，以套期保值和对冲风险的目的进行投资。

如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。”

（三）对原合同“第八节 集合计划的参与、退出与转让（七）管理人自有资金参与本集合计划情况”的相关条款进行调整。具体如下：

原条款为：

“（七）管理人自有资金参与本集合计划情况

管理人自有资金可以参与本集合计划，将按照本合同约定以及相关法律法规的规定执行。

1、自有资金参与的持有期限：证券期货经营机构自有资金参与本集合计划的，持有期限不得少于6个月。

2、自有资金的参与方式和金额：管理人以自有资金参与本集合计划，将通过本集合计划销售机构规定的方式参与。

3、自有资金参与的金额和比例：参与份额不超过本集合计划总份额的16%，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划或其子公司管理的单个集合资产管理计划的份额合计不得超过本计划总份额的50%。

4、自有资金的收益分配：管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与



其他持有本类份额的投资者享有同等收益分配的权利和义务。

5、自有资金份额责任承担方式和金额：管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他份额投资者享有同等权利和义务。

6、自有资金参与、退出的条件：

(1) 募集期内，管理人可以在符合本合同要求的条件下，以自有资金参与本集合计划，托管人签署本合同、投资者认购本集合计划即视为同意管理人参与本集合计划；

(2) 存续期内，证券期货经营机构拟以自有资金参与、退出本集合计划的，应当提前 5 个交易日通过管理人网站发布公告，并书面告知托管人取得其同意，公告期满投资者未提出异议且未退出的视为其同意，管理人不再另行通知；投资者不同意的，管理人有权在公告中说明的公告期满后将该投资者持有的全部资产管理计划份额强制退出本计划（退出价格为强制退出当日资产管理计划财产份额净值），由此发生的相关税费、或有损失由该投资者自行承担；

(3) 投资者和托管人在此不可撤销地同意并授权管理人：因集合计划规模变动等客观因素导致管理人自有资金参与份额比例被动达到或超过本集合计划份额的 16% 的，管理人可以对自有资金超限部分强制退出，以满足上述自有资金参与比例管理标准，但需事后及时告知投资者和托管人。投资者和托管人签署本合同，并且投资者参与本资产管理计划份额，即视为投资者和托管人已经充分理解并同意上述安排；

(4) 为应对本集合计划巨额赎回（如有）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可不受上述约定限制。出现上述情形时，管理人应及时告知投资者和托管人，并向住所地中国证监会派出机构报告。

7、风险提示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注计划规模变动情况，控制流动性风险。

8、信息披露：管理人及时在管理人指定网站公告自有资金参与和退出情况。”
修改为：

“（七）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划

1. 自有资金参与的条件



证券期货经营机构及其子公司在初始募集期和存续期均可以自有资金参与本集合计划。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划，应符合法律、行政法规、中国证监会及协会和本合同的相关规定。

2. 自有资金参与的金额和比例

管理人自有资金参与本集合计划的份额不得超过本计划总份额的 25%。证券期货经营机构及其子公司的自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过集合计划总份额的 50%。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过前述比例的，管理人应在具备退出本计划条件时将自有资金比例降至适合比例，并在退出本计划后 5 个工作日内及时以网站公告的形式告知投资者、以邮件等书面形式告知托管人。

3. 自有资金的责任承担方式与收益分配

管理人自有资金参与集合计划，按照其参与份额比例分享同等收益、承担同等风险。

自有资金的参与和退出时应当符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

4. 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月。在满足持有期不少于 6 个月等监管规定的前提下，管理人有权退出以自有资金参与的本集合计划的份额。

投资者签署本合同即视为知悉并同意管理人可以在初始募集期内以自有资金参与本集合资产管理计划。证券期货经营机构及其子公司在初始募集期以自有资金参与集合资产管理计划的，应当在发布募集公告时披露自有资金参与情况；证券期货经营机构及其子公司在存续期以自有资金参与、退出集合资产管理计划的，应当提前 5 个工作日告知和征询全体投资者的意见，并以邮件等书面形式征询托管人，取得托管人同意，投资者应在管理人指定的征询日期内按指定的形式回复意见。投资者未在指定征询日期内回复的视为同意；投资者不同意管理人自有资金参与、退出的，有权在管理人公告规定的时间内提出退出本集合计划的申请；对于明确回复不同意管理人自有资金参与、退出且逾期未退出的投资者，管理人将统一做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划份额净值），具体强制退出时间以管理人公告为准。

为应对集合资产管理计划巨额退出以解决流动性风险、因集合计划规模变



动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过前述比例的，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，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受上述限制，但应于事后5个工作日内及时告知投资者和托管人，并根据监管要求向中国证监会相关派出机构报告。

集合计划存续期内，当法律法规或有关自有资金参与集合计划的监管规定或政策发生变更，管理人经与托管人协商一致并公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整。投资者对修改或调整的内容有异议，可在修改或调整的内容生效前按照本合同规定申请退出集合计划。投资者未退出的，视为同意修改或调整的内容。”

（四）原合同“十一、集合计划的投资”部分做如下调整：

1、“十一、集合计划的投资”部分“（二）投资范围及比例”调整如下：

原表述：

“（二）投资范围及比例

本集合计划投资于具有良好流动性的金融工具，包括银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债券、地方政府债、央行票据、企业债、公司债、金融机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、非公开定向债务融资工具、债券型基金、分级基金A类份额、资产支持证券优先级、可交换债券、可转换债券、现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金，包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

本集合计划不直接投资股票等权益类资产，但可持有因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票，因分级基金定期折算、不定期折算、分级基金分拆合并或分级基金基于《指导意见》要求整改转型而持有的权益型基金（包括股票型基金和混合型基金，下同）。因上述原因持有的股票、权益型基金，本集合计划将在其可交易之日起的10个工作日内卖出或赎回。本集合计划投资于包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货，以套期保值和对冲风险的目的进行投资。

2. 投资比例



(1) 本集合计划投资于固定收益类的比例不低于集合计划资产总值的 80%。

(2) 本集合计划投资于股指期货、国债期货，以套期保值和对冲风险的目的，衍生品账户权益不超过本计划资产总值的 20%。

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 个交易日内将投资比例降至许可范围内（如遇相关证券不能上市交易的，上述时间期限自动顺延），并向管理人住所地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。若法律、法规、行政政策对管理人报备事宜有新规定的，按新规定执行。”

修改为：

“（二）投资范围及比例

1. 投资范围

本集合计划投资于具有良好流动性的金融工具，包括银行间市场和交易所市场上市交易的国债、政策性金融债券、地方政府债、央行票据、企业债、公司债、金融机构债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债（包括二级资本债）、非公开定向债务融资工具、债券型基金（包括可转债 ETF）、资产支持证券优先级、可交换债券、可转换债券、现金、银行存款、同业存单、债券回购、货币市场基金，包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货及其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种。

本集合计划不直接投资股票等权益类资产，但可持有因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票。因上述原因持有的股票，本集合计划将在其可交易之日起的 10 个工作日内卖出。本集合计划可投资于包括在证券期货交易所等国务院同意设立的交易所集中交易清算的股指期货、国债期货，以套期保值和对冲风险的目的进行投资。

2. 投资比例

(1) 本集合计划投资于固定收益类资产的比例不低于集合计划资产总值的 80%。

(2) 本集合计划投资于股指期货、国债期货，以套期保值和对冲风险的目的，衍生品账户权益不超过本计划资产总值的 20%。



本集合计划建仓期结束后，本集合计划投资组合的比例应符合上述投资比例的约定。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管理人之外的因素，造成集合计划除股指期货、国债期货以外的投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的二十个交易日内将投资比例降至许可范围内(如遇相关证券不能上市交易的，上述时间期限自动顺延)。确有特殊事由未能在上述时间内完成调整的，管理人应向住所地中国证监会派出机构报告。若因证券期货市场波动、资产管理计划规模变动等证券公司之外的原因致使集合计划中股指期货、国债期货投资比例超标的，管理人应当在 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内(如遇相关证券不能上市交易的，上述时间期限自动顺延)，同时在该情形发生之日起 2 个工作日内向管理人住所地证监局报告。

全体投资者不可撤销地同意并授权管理人在本集合计划存续期间，为规避特定风险，投资于【固定收益类】资产的比例可以低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。上述特定风险包括但不限于因经济政策、交易制度、交易方式、市场环境等因素的变化可能对资产收益产生不利影响而产生的风险。”

2、删除“十一、集合计划的投资 (六) 投资策略 4.2、固定收益类资产投资策略”中“(3) 分级 A 投资策略”并调整后续(4)(5)(6)(7)策略的序号为(3)(4)(5)(6)，具体删除内容如下：

删除原表述：

“ (3) 分级 A 投资策略

分级 A 属于低风险高收益的债性品种，持有分级 A 的收益主要来自三部分：利息收入、利差收益、下折收益。管理人在分析分级 A 隐含收益率的基础上，以高折价分级 A 为主要投资标的。

1) 长期持有策略

该策略较为简单，选取隐含到期收益率较高的品种，长期持有，获得比无风险收益率更高的收益。

2) 期权策略

该策略属于分级基金折价套利策略。分级 A 附带一定的期权价值，而折溢价率是影响期权价值最重要的变量。当分级 A 处于折价状态，期权价值为正；当分



级 A 处于溢价状态，期权价值为负。B 净值逼近下折时 A 的期权价值应该得到体现，分级 A 价格上升。无论是市场大幅波动还是市场规则出现重大变动，分级 A 的期权价值将凸显。买入期权价值被低估的品种，长期看可以获得一定收益。

3) 套利策略

分级基金的母份额可以申购赎回，子份额在二级市场上市交易。当子份额的交易价格同母基金净值整体不相等时，就存在套利的机会。当子份额交易价格相对于母基金净值溢价时，可以通过申购母基金份额，分拆为子基金份额，在场内分别卖出获利；当子份额交易价格相对于母基金净值折价时，可以通过场内买入子份额，合并为母基金份额，在场外赎回获利。”

(五) 原合同“第十四节 利益冲突及关联交易”做如下调整：

原表述：

“（一）利益冲突情形

本计划可能存在如下涉及利益冲突的情况：

1. 以资产管理计划资产参与关联交易；
2. 管理人董事、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；
3. 管理人自有资金参与和退出本计划；
4. 其他利益冲突的情形。

（二）关联交易的定义、分类标准及管控机制

1. 关联交易的定义

关联交易包括资产管理计划投资于管理人、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股票、债券、资产支持证券等各类证券或者承销期内承销的证券，及与管理人关联方互为交易对手的交易。

管理人将在公司网站（www.hua.jinsec.cn）披露管理人关联方名单，托管人关联方名单请关注托管人公布的信息，查询路径：www.cib.com.cn。

2. 关联交易的分类

管理人在运用受托管理资产从事关联交易时，将按照法律法规及中国证监会的有关规定，对关联交易按照重要性原则区分为一般关联交易和重大关联交易并进行分层管理。



3. 一般关联交易的管控机制

投资者在此不可撤销地同意并授权管理人可以将本集合计划的资产从事以下一般关联交易：

(1) 将本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、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等发行或承销期承销的单证券、管理的单只公募基金的资金或与管理人关联方互为交易对手发生交易行为时，单证券交易金额不超过本集合计划净值的 10%（不含）；

(2) 其他符合法律法规、监管准则和自律规则认定的一般关联交易。

一般关联交易经管理人相应内部审批程序审批通过后方可进行，管理人设置两级审批流程，资产管理计划需参与关联交易的，由投资经理书面说明关联交易的必要性，定价依据等，经部门负责人审批后，由合规风控部门审核后方可进行交易，审批人员亦需重点审核关联交易的必要性、交易价格公允性等，确保该关联交易符合本资产管理计划投资者的利益。

管理人在一般关联交易发生后，应及时告知投资者和托管人，事后单独以公告或定期报告的形式进行披露并按照最新监管要求履行报告义务。

4. 重大关联交易的管控机制

重大关联交易认定标准如下：

(1) 将本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、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等发行或承销期承销的单证券、管理的单只公募基金的资金或与管理人关联方互为交易对手发生交易行为时，单证券交易金额达到本集合计划净值的 10%及以上的；

(2) 其他法律法规、监管准则、自律规则或按照实质重于形式原则认定的重大关联交易情形。

重大关联交易需先经管理人履行内部审批程序，由管理人设置的资产管理业务决策机构（资产管理产品及业务决策委员会）审批，该委员会由合规部门及风控部门人员列席，所有委员采取记名投票表决方式，同意票数得到有效票数三分之二（含）方通过。此外，重大关联交易还需履行如下程序后方可进行。

管理人拟以集合计划资产从事重大关联交易的（包括单笔或多笔合计），应提前 5 个工作日逐笔通过征询或发布公告等方式征求投资者意见，投资者如有异



议的，应于公告发布后3个工作日内书面回复，如全体投资者均未提出书面异议的，管理人方可开展该次重大关联交易，如有投资者书面提出不同意进行该次重大关联交易的，则管理人不得进行此次重大关联交易。管理人将单独通过公告形式将相关结果或关联交易情况告知所有投资者及托管人，并根据最新监管要求履行报告义务。

（三）若管理人董事、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管理人设立的资产管理计划，管理人应当向投资者进行披露，对该计划账户进行监控，并按监管要求进行报告。

（四）其他利益冲突的情形

除前述规定外，管理人不得将本资管计划的委托资产，通过直接投资、投资其他资产管理计划或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构、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。

管理人禁止违规关联交易，遵循投资者利益优先原则对非禁止性关联交易进行专项审批和管控，防范利益冲突，保护投资者合法权益。法律法规、监管准则和自律规则对集合计划关联交易另有规定的，管理人按届时有效的规定执行。”

修改为：

“（一）利益冲突情形

本计划可能存在如下涉及利益冲突的情况：

1. 以资产管理计划资产参与关联交易；
2. 管理人董事、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；
3. 管理人自有资金参与和退出本计划；
4. 其他利益冲突的情形。

（二）关联交易的定义、分类标准及管控机制

1. 关联交易的定义

本计划的关联交易是指本计划与关联方之间进行的各种投资交易，包括：

- （1）本计划投资于本计划关联方发行的股票、债券、资产支持证券等各类证券；
- （2）本计划投资于管理人关联方、托管人关联方承销期内承销的证券；



(3) 本计划投资于管理人及其关联方管理的资产管理计划；

(4) 本计划与管理人关联方互为交易对手或管理人关联方发行的债券作为质押券的交易。

本计划关联方主要包括：

(1) 管理人关联方，管理人通过电子邮件等书面形式向托管人发送管理人关联方名单。

(2) 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。

(3) 其他关联方，指其他根据实质重于形式原则认定的本计划关联方，包括但不限于：本计划的机构投资者的关联方视为本计划的关联方。

2. 关联交易的分类

管理人在运用受托管理资产从事关联交易时，将按照法律法规及中国证监会的有关规定，对关联交易按照重要性原则区分为一般关联交易和重大关联交易并进行分层管理。

3. 一般关联交易的管控机制

投资者在此不可撤销地同意并授权管理人可以将本集合计划的资产从事以下一般关联交易：

(1) 投资于本计划关联方发行的单证券的资金不超过本计划净值的 10%（不含）；

(2) 投资于本计划管理人关联方、托管人关联方承销期内承销的单证券（不含利率债）的资金不超过本计划净值的 10%（不含）；

(3) 投资于本计划管理人关联方、托管人关联方承销期内承销的单只利率债；

(4) 投资于管理人及其关联方管理的资产管理计划的资金累计不超过本计划净值的 10%（不含）；

(5) 与管理人关联方互为交易对手发生交易行为时，未了结交易金额合计不超过本计划净值的 10%（不含）；

(6) 其他符合法律法规、监管准则和自律规则认定的一般关联交易。



一般关联交易经管理人相应内部审批程序审批通过后方可进行，管理人设置两级审批流程，资产管理计划需参与关联交易的，由投资经理书面说明关联交易交易的必要性，定价依据等，经部门负责人审批后，由合规风控部门审核后方可进行交易，审批人员亦需重点审核关联交易的必要性、交易价格公允性等，确保该关联交易符合本资产管理计划投资者的利益。

管理人在一般关联交易发生后，应及时告知投资者和托管人，事后单独以公告或定期报告的形式进行披露并按照最新监管要求履行报告义务。

4、重大关联交易的管控机制

重大关联交易认定标准如下：

(1) 投资于本计划关联方发行的单证券的资金单笔或累计达到本计划净值的 10%及以上；

(2) 投资于本计划管理人关联方、托管人关联方承销期内承销的单证券（不含利率债）的资金单笔或累计达到本计划净值的 10%及以上；

(3) 投资于管理人及其关联方管理的资产管理计划的资金单笔或累计达到本计划净值的 10%及以上；

(4) 与管理人关联方互为交易对手发生交易，未了结交易金额合计达到本计划净值的 10%及以上的；

(5) 其他法律法规、监管准则、自律规则或按照实质重于形式原则认定的重大关联交易情形。

重大关联交易需先经管理人履行内部审批程序，由管理人设置的资产管理业务决策机构（资产管理产品及业务决策委员会）审批，该委员会由合规部门及风控部门人员列席，所有委员采取记名投票表决方式，同意票数得到有效票数三分之二（含）方通过。此外，重大关联交易还需履行如下程序后方可进行。

管理人拟以集合计划资产从事重大关联交易的（包括单笔或多笔合计），应提前 5 个工作日逐笔通过征询或发布公告等方式征求投资者意见，投资者如有异议的，应于公告发布后 3 个工作日内书面回复，如全体投资者均未提出书面异议的，管理人方可开展该次重大关联交易，如有投资者书面提出不同意进行该次重大关联交易的，则管理人不得进行此次重大关联交易。管理人将单独通过公告形式将相关结果或关联交易情况告知所有投资者及托管人，并根据最



新监管要求履行报告义务。

（三）若管理人董事、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管理人设立的资产管理计划，管理人应当向投资者进行披露，对该计划账户进行监控，并按监管要求进行报告。

（四）其他利益冲突的情形

除前述规定外，管理人不得将本资管计划的受托资产，通过直接投资、投资其他资产管理计划或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构、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。

管理人禁止违规关联交易，遵循投资者利益优先原则对非禁止性关联交易进行专项审批和管控，防范利益冲突，保护投资者合法权益。法律法规、监管准则和自律规则对集合计划关联交易另有规定的，管理人按届时有效的规定执行。”

（六）原合同“十六、集合计划的财产（二）集合计划财产相关账户的开立和管理”中“5. 定期存款账户”部分做如下调整：

原表述：

“5. 定期存款账户

委托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。定期存款账户户名应与托管账户保持一致，该账户预留印鉴由管理人负责预留。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。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，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专户（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。存款证实书原件由管理人负责办理、取得并保管。”

修改为：

“5. 投资定期存款的银行账户的开立和管理

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。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。”

（七）原合同“十八、越权交易的界定（二）越权交易的处理程序”中“1. 违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为”部分做如下调整：

原表述：

“托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构或基金业协会。

托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同约定的，应立即通知管理人，并有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构或基金业协会。

管理人应向托管人主动报告越权交易并限期改正。托管人有权督促管理人在限期内改正并在期限内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权依据相关法律法规的要求报告中国证监会或基金业协会。”

修改为：

“托管人在行使监督职责时，发现管理人的投资指令违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人，并依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构。

托管人在行使监督职责时，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违



反本合同约定的，应立即通知管理人，并依据相关法律法规的要求报告中国证监会相关派出机构。

管理人应向托管人主动报告越权交易并限期改正。托管人有权督促管理人在限期内改正并在限期内对通知事项进行复查。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人依据相关法律法规的要求报告中国证监会。”

（八）原合同“十八、越权交易 （三）托管人对管理人投资运作的监督”中第1部分第（8）条内容做如下调整：

原表述：

“（8）可转债转股、可交换债换股所带来持股、为参与优先配售可转债在可转债发行公告公布的股权登记日买入该可转债对应的股票需在其具备可上市流通条件后20个交易日内卖出；因分级基金定期折算、不定期折算、分拆合并或分级基金基金监管要求整改转型而持有的权益型基金份额均须在具备赎回、交易条件后10个工作日内赎回或卖出；”

修改为：

“8）可转债转股、可交换债换股所带来持股、为参与优先配售可转债在可转债发行公告公布的股权登记日买入该可转债对应的股票需在其具备可上市流通条件后20个交易日内卖出；”

（九）原合同“十八、越权交易 （三）托管人对管理人投资运作的监督”中第1部分：

新增：

“备注：其中期货交易目的由管理人自行监控。”

（十）原合同“十八、越权交易 （三）托管人对管理人投资运作的监督”：

新增：

“5、管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责的，由管理人/过错方承担相应的责任。”

（十一）原合同“十九、集合计划财产的估值和会计核算 （一）集合计划财产的估值”中“7.3、证券投资基金的估值方法”部分做如下调整：

原表述：

“7.3、证券投资基金的估值方法



(1) 持有的交易所上市基金，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且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，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(2) 持有的场外基金，按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；

(3) 持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利；

(4) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值。”

修改为：

“7.3、基金的估值方法

在交易所交易的基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)、交易型货币基金、ETF基金等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值，但最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价等变化因素，确定公允价值进行估值。

未上市流通的其他开放式证券投资基金按估值日上一工作日的基金份额净值估值，当日未公布的，且整体市场环境及投资标的未发生重大变化的，以估值当日能获取的最新基金份额净值为准。若有充足证据表明最近可获取的单位净值不能真实反映公允价值的，可采用估值技术确定公允价值；

非交易所上市的货币市场基金，按所投资基金前一估值日的万份收益计提估值日基金收益。”

(十二) 原合同“第二十三节 风险揭示 (二) 一般风险揭示”部分，新增风险揭示如下：

增加条款：

“19、资金前端控制产生的风险

根据《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》的要求，管理人应控制在交易所实施竞价



交易且为净额担保结算的交易品种的全天净买入金额，在极端情况下，可能因相关交易单元买入申报金额不符合资金前端控制额度限制而导致买入申报被拒绝。

20、本计划计提业绩报酬导致投资者实际收益低于产品净值收益率的风险

本合同约定本集合计划的业绩报酬计提日为收益分配日、份额退出日和本集合计划终止日。在收益分配日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中提取。管理人从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次。在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。

由于业绩报酬的设置，本集合计划进行收益分配或投资者赎回本计划时，如满足业绩报酬计提标准的，投资者收到的资金为扣除业绩报酬后的资金，会低于按照产品净值计算的收益率，请投资者特别留意由此可能导致的风险。”

（十三）原合同“第二十八、其他事项”部分新增内容，具体如下：

新增：

“合同其他方签署本合同即视为知悉/授权托管人可为订立、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；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。”

二、《华金证券鸿盈1号集合资产管理计划说明书》《华金证券鸿盈1号集合资产管理计划风险揭示书》以及原合同中涉及上述变更内容的将同步进行变更。除涉及上述变更内容外，原合同以及《条款变更的函》其他条款内容继续有效。原合同当事人签署的原合同以及《条款变更的函》与本补充协议有冲突的，以本补充协议的约定为准。

三、本补充协议经管理人、托管人法定代表人、负责人或授权代表签名或盖章并加盖公章或合同专用章后，由管理人通过管理人官网发布合同变更公告向投资者征求意见，该等征求工作完成之后，自2025年9月5日起正式生效。终止期限与原合同相同。



四、本补充协议一式伍份，管理人执贰份、托管人执贰份，其余报监管机构使用，每份具有同等法律效力。

(以下无正文)

091490
091490



091490



(本页无正文，为《华金证券鸿盈1号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议一》签署页)：

投资者(签字/公章)：

(注：自然人客户，请签字；机构客户，请由法定代表人或其授权代理人签字并加盖机构公章)

2025年 月 日

管理人：华金证券股份有限公司(盖章)



法定代表人或授权代表(签字或盖章)：



2025年 月 日

2025年 08月 25日

托管人：兴业银行股份有限公司南京分行(盖章)



负责人或授权代表(签字或盖章)：



2025年 月 日
2025-08-26