

# 第一创业期货有限责任公司

## 关于“第一创业期货-睿博7号资产管理计划” 的投资范围变更的公告

尊敬的投资者：

《第一创业期货-睿博7号资产管理计划资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》）于2017年11月27日成立以来，运行平稳，因策略需要，调整第一创业期货-睿博7号资产管理计划的投资范围、投资策略、投资限制以及风险揭示。

经资产委托人、资产管理人、资产托管人三方友好协商一致，决定对《资产管理合同》“第十三章 资产管理计划的投资 第三十六条（二）投资范围及比例、（三）投资策略、（七）投资限制；第二十一章 风险揭示 第五十六条（六）本计划特定风险”进行修订，具体内容如下：

（二）投资范围及比例中增加“3、 权益类：国内依法公开发行上市的上市公司股票及新股申购（0%-100%）”。

（三）投资策略增加如下条款：

根据现货头寸进行量化分析，确定用以对冲现货头寸贝塔风险的期货合约手数，根据现货指数大趋势对现货头寸进行择时套保。

权益类：

依照基本面和量化指标筛选出具有高阿尔法收益的股票现货组合。



(七) 投资限制增加如下条款：

权益类：

(1) 投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过该上市公司总股本的 4.99%；

(2) 购买单一非创业板上市公司股票不超过计划财产净值的 10% (以成本计)；

(3) 不得进行上市公司定向增发交易，不得参与融资融券交易；

(4) 不得进行购买创业板股票、“S”、“ST”、“\*ST”、“S\*ST”及“SST”类股票；

(5) 不得投资于未上市公司股权、场外期权；

第二十一章 风险揭示 第五十六条 (六) 本计划特定风险中增加如下条款：

权益投资风险主要包括：

本资产管理计划投资于权益类资产，会面临因经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的股票价格波动，导致收益水平变化，产生风险。同时，本计划终止清算时，若有未能流通变现的证券，则会面临二次清算。

详细信息参见《资产管理合同》的补充协议。

特此公告。



第一创业期货有限责任公司

2018年 6月 12日

