

# 关于首创证券创赢 20 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函

平安银行股份有限公司北京分行：

根据最新的投资运作需要，需对我司发行管理并由贵司托管的首创证券创赢 20 号集合资产管理计划的管理合同（包括《首创证券创赢 20 号集合资产管理计划资产管理合同》，以下简称《原合同》）进行更改，相应更改内容在托管协议、计划说明书、风险说明书中对应的条款同步更改。具体更改内容如下：

一、原合同“四、集合资产管理计划的基本情况”中第（十）条“本集合计划的各项费用”中，原：

“3、管理费：0.3%/年”

变更为：

“3、管理费：0.8%/年”

二、原合同“十三、集合计划的费用、业绩报酬”中第（二）条“集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间”中第 2 条“管理人管理费计提和支付”中，原：

“本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为 0.3%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.3\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值”

变更为：

“本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为 0.8%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.8\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费



E 为前一日集合计划资产净值”

三、原合同“十三、集合计划的费用、业绩报酬”中第（二）条“集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间”中第 3 条“业绩报酬的计提和支付”，原：

“管理人收取业绩报酬的原则

（1）按委托人参与份额计算收益率并计提业绩报酬；

（2）在符合业绩报酬计提条件时，在集合计划收益分配基准日、份额退出日和本集合计划终止日计提业绩报酬；

（3）在集合计划收益分配基准日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除，在份额退出日和本集合计划终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

业绩报酬的计提方法：

本集合计划业绩报酬计提日为收益分配基准日、份额退出日和本集合计划终止日。以上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，则为本计划成立日或存续期参与日）至本次业绩报酬计提日的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基础，累计提取业绩报酬。当两个业绩报酬计提日期间的年化收益率高于管理人公告的对应日期的业绩报酬计提基准，管理人对超过业绩报酬计提基准部分提取 60%作为管理人业绩报酬；当两个业绩报酬计提日期间的年化收益率低于管理人公告的对应日期的业绩报酬计提基准，管理人不提取业绩报酬。

用公式表示如下：

A=上次业绩报酬计提日的累计单位净值

B=本次业绩报酬计提日的累计单位净值

C=上次业绩报酬计提日的单位净值

D=两次业绩报酬计提日的间隔天数（第一个运作周期计提时算头算尾，非第一个运作周期计提时算尾不算头）

E=委托人参与份额应计提的管理人业绩报酬

F=本次提取业绩报酬的份额

$$R = \left[ \frac{(B-A)}{C} \right] * [365/D] * 100\%$$

r=业绩报酬计提基准

$$\text{若 } R > r \quad E = \max\{ (R-r) \times 60\% \times F * C \times (D/365), 0 \}$$

若  $R < r$  不提取业绩报酬”

变更为：

“（1）管理人核算业绩报酬的原则：

在本集合计划存续过程中，业绩报酬计提日为本集合计划收益分配日（以管理人的分红公告为准）、计划开放日或本集合计划终止日。以上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日）至本次业绩报酬计提日的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准，按照业绩报酬计提基准以上部分的 60%提取业绩报酬，具体提取方式如下：

$$R = \frac{A - B}{C} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

其中，A 为业绩报酬计提日的累计单位净值；

B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；

C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为上一业绩报酬计提日与本次业绩报酬计提日间隔天数。若管理人于某个业绩报酬计提日未实际计提业绩报酬（即业绩报酬为 0），则该日仍然作为管理人下一次业绩报酬计提起始日。

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬计提方法
$R \geq$ 业绩	60%	$H = [R - \text{业绩报酬计提基准}] \times 60\% \times C \times F \times \frac{D}{365}$

报酬计提基准		
R<业绩报酬计提基准	0	H=0

注：F 为提取业绩报酬的份额

由于涉及注册登记数据，由管理人计算，托管人不承担复核责任。

管理人收取业绩报酬按委托人参与份额计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

管理人业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，但因投资者退出集合计划提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。”

**四、** 原合同“十四、集合计划的收益分配”中第（三）条“收益分配原则”中，原：

“（1）每一集合计划份额享有同等的收益分配权；

（2）若在本集合计划开放日集合计划单位净值高于 1 元，本集合计划将在开放日进行收益分配，实现份额净值归为 1 元；

（3）集合计划收益分配除权日的每份额净值减去每份额分红金额后不能低于集合计划份额面值；

（4）收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；

（5）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。”

变更为：

“（1）每一集合计划份额享有同等的收益分配权，若收益分配基准日可供分配利润大于 0，管理人可以视情况选择进行收益分配；

（2）在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，由管理人拟定分红方案进行收益分配，分配比例不超过收益分配基准日全部可分配利润的 100%；

（3）集合计划收益分配日的每份额净值减去每份额分红金额后不能低于集

合计划份额面值；

(4) 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。”

首创证券有限责任公司

2020年2月24日

## 回 执

首创证券有限责任公司：

贵司《关于首创证券创赢 20 号集合资产管理计划修改合同的征求意见函》已收悉。我行对该集合资产管理计划合同修改的意见如下：

我行同意按照贵司来函中所列明的内容，对首创证券创赢 20 号集合资产管理计划管理合同、托管协议、计划说明书和风险揭示书相关内容进行修改，并同意继续担任该集合资产管理计划的托管人。

平安银行股份有限公司北京分行

2020年2月24日

1101020073050



