

关于首创证券创赢 18 号集合资产管理计划

修改合同的征求及回复意见函二

华夏银行股份有限公司：

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 18 号集合资产管理计划的管理合同（包括《首创证券创赢 18 号集合资产管理计划资产管理合同》、《首创证券创赢 18 号集合资产管理计划变更合同条款说明》，以下合并简称“管理合同”）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“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：

“（1）管理人核算业绩报酬的原则：

管理人将在每个运作周期开始前公布该运作周期的业绩报酬计提基准。若运作周期结束后份额持有人期间年化收益率超过管理人公告的该运作周期内的业绩报酬计提基准，则管理人将期间年化收益率超过该业绩报酬计提基准的 60% 计提为管理人的业绩报酬，剩余 40% 作为超额收益分配给委托人。

（2）业绩报酬计算公式

期间年化收益率 $R_t = [(P_t - P_0) / P_0] \times (365 \div T)$

P_t = 本次业绩报酬计提日的集合计划份额单位净值（扣除本运作周期业绩报酬前）

P_0 = 上一个定期开放日进行净值归一后的集合计划份额单位净值（扣除上一个运作周期业绩报酬后）

T = 上一个定期开放日（不含）到本次业绩报酬计提日（含）的天数

其中，首个封闭期： $P_0 = 1$ ， T = 集合计划成立日（含）到本次业绩报酬计提日（含）的天数

本计划设置产品业绩报酬计提基准 R_t / 年（ R_t 以各开放期前发布的公告为准，



公告需同时抄送托管人)。在本计划收益分配、委托人退出及本计划终止时，若当期年化收益率 R_t 低于业绩报酬计提基准 R_i ，即：

$R_t \leq R_i$ 时，管理人不收取业绩报酬；

若当期实际年化收益率 R_t 大于等于业绩报酬计提基准 R_i ，即：

$R_t > R_i$ 时，则管理人对委托人期间年化收益超过 R_i 部分按照 60% 比例收取业绩报酬。即

期间年化收益率 (R_t)	计提比例	业绩报酬 (E) 的计提公式
$R_t \leq R_i$	0	$E = 0$
$R_t > R_i$	60%	$E = N \times P_0 \times (R_t - R_i) \times 60\% \times T / 365$

注：

E 为管理人应收取的业绩报酬

N 为业绩报酬计提日前一全体委托人持有的总份额数

(3) 业绩报酬支付时间

每个运作周期结束时，管理人全额提取当期计提的业绩报酬（如有），具体以管理人安排和计算为准。集合计划终止时，若业绩报酬仍有剩余，则管理人一次性全部提取。业绩报酬的支付由管理人向托管人发送划款指令，托管人根据管理人出具的划款指令于 3 个工作日内从集合计划中支付给管理人。

业绩报酬的计算和复核由管理人完成，托管人不承担复核责任。托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。

如果法律法规后续对管理人收取的业绩报酬比例有最高上限要求时，管理人将按照合同变更约定程序进行向下调整，无须另行征求委托人的意见。”

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
$R \geq$ 业绩报酬 计提基准	60%	$H = [R - \text{业绩报酬计提基准}] \times 60\% \times C \times F \times \frac{D}{365}$
$R <$ 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。

（2）业绩报酬的支付：

由于涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人进行计算，托管人不对其进行复核。业绩报酬支付时间分别是收益分配、份额退出和本集合计划终止时，由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时，支付日期顺延。”



二、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、集合计划份额收益在每个封闭期结束后集中支付分配，封闭期内不分配；
- 3、在符合有关集合计划收益分配条件的前提下，本集合计划将在开放日进行收益分配，分配比例不超过分配基准日全部可分配收益的 100%，分配后实现单位净值归为 1 元；
- 4、集合计划收益分配基准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；
- 5、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；
- 6、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。”



回 执

首创证券股份有限公司：

贵司《关于首创证券创赢 18 号集合资产管理计划修改合同的征求意见函二》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 18 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。

