

首创证券创惠 2 号灵活优选集合资产管理计划

修改合同的征求及回复意见函五

南京银行股份有限公司：

根据最新的投资运作需要，需对我司发行管理并由贵行托管的首创证券创惠 2 号灵活优选集合资产管理计划的《首创证券创惠 2 号灵活优选集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）进行更改，相应更改内容在托管协议、计划说明书、风险揭示书中对应的条款同步更改。

具体更改内容如下：

一、资产管理合同第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”的“(五)参与和退出的金额限制”中，原：

“投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，应符合合格投资者标准，首次参与金额应不低于 30 万元人民币（不含参与费），对于已持有该集合计划份额的投资者在开放日内追加参与的，追加参与的最低金额为人民币 10000 元的整数倍。”

集合计划份额持有人持有的集合计划资产净值高于 30 万元时，可以选择部分退出集合计划份额，集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30 万元。集合计划份额持有人申请退出集合计划份额时，其持有的集合计划资产净值低于 30 万元的，必须选择一次性退出全部集合计划份额，集合计划份额持有人没有一次性全部退出持有份额的，管理人将该集合计划份额持有人所持份额做全部退出处理。”

变更为：

“投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，应符合合格投资者标准，首次参与金额应不低于 30 万元人民币（不含参与费），对于已持有该集合计划份额的投资者在开放日内追加参与的，追加参与的最低金额为人民币 10000 元的整数倍，且追加后的参与总金额不得超过限额，具体限额以管理人公告为准。”



集合计划份额持有人持有的集合计划资产净值高于 30 万元时，可以选择部分退出集合计划份额，集合计划份额持有人在退出后持有的集合计划资产净值不得低于 30 万元。集合计划份额持有人申请退出集合计划份额时，其持有的集合计划资产净值低于 30 万元的，必须选择一次性退出全部集合计划份额，集合计划份额持有人没有一次性全部退出持有份额的，管理人将该集合计划份额持有人所持份额做全部退出处理。”

二、资产管理合同第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”的“（六）参与和退出的费用”中，原：

“1、参与费用

本集合计划无参与费

2、退出费用

持有期 (P)	P < 60 天	P ≥ 60 天
退出费率	0.2%/笔	0

退出费归入管理人收入。”

变更为：

“1、参与费用

本集合计划无参与费

2、退出费用

本集合计划无退出费”

三、资产资管合同第十九章“资产管理计划的估值和会计核算”的“7、估值方法”中，原：

“（4）债券估值方法

①在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；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的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

②在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；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的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

③首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

④交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量。

⑤在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。

⑥同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。”

变更为：

“（4）债券估值方法

①在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的相应品种对应的估值净价估值。

②在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

③首次发行未上市且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与

二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用估值技术确定公允价值。

④交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用第三方估值机构（中证指数有限公司）确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债，采用第三方估值机构（中证指数有限公司）确定公允价值。

⑤在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构（中债金融估值中心有限公司）公布的收益率曲线及估值价格。

⑥同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。”

四、资管合同第十一章“资产管理计划的投资”的“（四）风险收益特征”中，原：

“本计划属于中等风险 R2 的证券投资产品。”

变更为：

“本计划属于中低风险 R2 的证券投资产品。”

若产品合同变更条款涉及到风险揭示书和计划说明书，对应一并修改。



回 执

首创证券股份有限公司：

贵司《首创证券创惠 2 号灵活优选集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函五》已收悉。我行对该集合资产管理计划合同相关文件修改的意见如下：

我行同意按照贵司来函中所列明的内容，对首创证券创惠 2 号灵活优选集合资产管理计划管理合同、托管协议、风险揭示书、计划说明书内容进行修改，并同意继续担任该集合资产管理计划的托管人。



南京银行股份有限公司

2021 年 12 月 24 日



