

## 首创证券创赢 29 号集合资产管理计划变更合同条款说明二

《首创证券创赢 29 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“原合同”)中条款更改主要涉及以下内容:

### 一、原合同“二、释义”中,

**原:**

“推广机构:指招商银行股份有限公司、首创证券股份有限公司及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本集合资产管理计划的机构。”

**变更为:**

“推广机构:指首创证券股份有限公司及其他符合相应资格条件的、经管理人委托的、代理推广本集合资产管理计划的机构。”

**原:**

“巨额退出:指本集合计划单个开放日累计净退出申请份额(退出申请总份额扣除参与总份额后的余额)超过上一日计划总份额 10%的情形;”

**变更为:**

“巨额退出:指本集合计划单个开放日累计净退出申请份额(退出申请总份额扣除参与总份额后的余额)超过上一日计划总份额 20%的情形;”

**新增:**

“信义义务:一是忠实义务,资产托管人按照合同约定义务为委托人利益行事,不为自己或他人谋取私利。二是勤勉义务,资产托管人勤勉尽职、专业审慎履行本合同约定义务。”

### 二、原合同“三、承诺与声明”的“(一)管理人承诺”中:

**原:**

“3. 按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产,不保证委托财产一定盈利,也不保证最低收益或本金不受损失,以及限定投资损失金额或者比例。”

**变更为：**

“3. 按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。资产管理人对本计划的结构设计、投资范围的合规性负责。”

**三、原合同“四、当事人权利与义务”管理人部分第3条“管理人义务”中：**

**删除：**

“（26）进行资产估值等会计核算并编制资产管理计划财务会计报告；  
（27）依法计算并披露资产管理计划净值，确定参与、退出价格；”

其余条款序号自行调整。

**四、原合同“四、当事人权利与义务”托管人部分第1条“托管人简况”中：**

**原：**

“法定代表人或负责人：熊开”

**变更为：**

“法定代表人或负责人：张诚”

**五、原合同“四、当事人权利与义务”托管人部分第3条“托管人的义务”中：**

**原：**

“（9）编制托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；”

**变更为：**

“（9）编制托管年度报告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送；”

**六、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中第（四）条“集合资产管理计划目标规模”中，**

**原：**

“本集合计划推广期规模上限为 50 亿份，存续期不设规模上限，单个客户首次参与金额不低于 30 万元。本集合计划委托人数量为 2 人以上(含)200 人以下(含)。”

**变更为：**

“本集合计划推广期和存续期规模上限为 50 亿份，单个客户首次参与金额不低于 30 万元。本集合计划委托人数量为 2 人以上(含)200 人以下(含)。”

**七、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中第（五）条“投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级”中第 3 项“投资比例”变更：**

**原：**

“本计划投资单一标的债券的数量不超过该债券发行总规模的 25%，按成本计，也不超过本计划净资产的 25%，利率债不受此项限制。

(2) 债券正回购：融入资金余额不超过计划资产净值的 100%。

(3) 债券逆回购资金余额不得超过其上一日净资产的 100%。

(4) 本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的 25%，也不得超过该资产的 25%。本集合计划管理人管理的全部集合资管计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。”

**变更为：**

“本计划投资单一标的债券的数量不超过该债券存续总规模的 25%，按成本计，也不超过本计划净资产的 25%，利率债不受此项限制。

(2) 债券正回购：融入资金余额不超过计划上一日净资产的 100%。

(3) 债券逆回购资金余额不得超过其上一日净资产的 100%。

(4) 本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的 25%，也不得超过该资产存续规模的 25%。本集合计划管理人管理的全部集合资管计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。

(6) 本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意。

(7) 本集合计划不直接投资于商业银行信贷资产。”

**八、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中第（十）条“封闭期、开放期安排”中：**

**原：**

“1、封闭期：除开放期以外的期间为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。”

**变更为：**

“1、封闭期：除开放期、临时开放期以外的期间为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。”

**删除：**

“3、流动性安排：

开放退出期内，其资产组合中7个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的10%，7个工作日可变现资产，包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具以及同业存单，7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。”

**九、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中第（十二）条“封闭期、开放期安排”中：**

**原：**

“3、管理费：0.4%/年”

**变更为：**

“3、管理费：0.6%/年”

**十、原合同“六、资产管理计划的募集”中“（三）资产管理计划的认购事项”的“4、认购份额的计算方式”中：**

**原：**

“认购份额= 净认购金额/ 认购份额初始面值。”

**变更为：**

“认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/认购份额初始面值。”

**十一、原合同“七、资产管理计划的成立与备案”的“（一）集合计划成立的条件和日期”中：**

**原：**

“集合计划的募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定，初始募集资金总额（不含参与费）达到中国证监会规定的集合资产管理计划最低募集规模（即人民币 1000 万元）且其委托人的人数为 2 人（含）以上，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本集合计划成立。集合计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告资产管理计划成立。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。”

**变更为：**

“集合计划的募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定，初始募集资金总额（不含参与费）达到中国证监会规定的集合资产管理计划最低募集规模（即人民币 1000 万元）且其委托人的人数为 2 人（含）以上，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本集合计划成立。集合计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后公告资产管理计划成立。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金，自募集资金账户向托管户划款的除外。”

**十二、原合同“七、资产管理计划的成立与备案”的“（四）集合计划的备案”中：**

**原：**

“管理人应当在集合资产管理计划成立后 5 个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告等材料报中国证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构（如需）。”

**变更为：**

“管理人应当在集合资产管理计划成立之日起 5 个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告等材料报中国证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构（如需）。”

**十三、原合同“十一、资产管理计划的投资”的“（二）投资范围及比例”的“2、资产配置比例及限制”中：**

**原：**

“本计划投资单一标的债券的数量不超过该债券发行总规模的 25%，按成本计，也不超过本计划净资产的 25%，利率债不受此项限制。

(2) 债券正回购：融入资金余额不超过计划资产净值的 100%。

(3) 债券逆回购资金余额不得超过其上一日净资产的 100%。

(4) 本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的 25%，也不得超过该资产的 25%。本集合计划管理人管理的全部集合资管计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。”

**变更为：**

“本计划投资单一标的债券的数量不超过该债券存续总规模的 25%，按成本计，也不超过本计划净资产的 25%，利率债不受此项限制。

(2) 债券正回购：融入资金余额不超过计划上一日净资产的 100%。

(3) 债券逆回购资金余额不得超过其上一日净资产的 100%。

(4) 本集合资产管理计划投资于债券外的其他同一资产，不得超过该计划资产净值的 25%，也不得超过该资产存续规模的 25%。本集合计划管理人管理的全部集合资管计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。

(6) 本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意。

(7) 本集合计划不直接投资于商业银行信贷资产。”

**十四、原合同“十四、利益冲突及关联交易”的“2、存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率”的“（1）存在利益冲突的处理方式”中：**

**原：**

“集合计划投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意本集合计划将进行上述关联交易。管理人从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。”

**变更为：**

“集合计划投资者签署本合同即表明其已经知晓并同意本集合计划将进行上述关联交易。管理人从事重大关联交易的，应事先取得投资者同意，并有充分证据证明未损害投资者利益，且应向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。”

**十五、原合同“十六、资产管理计划的财产”的“（二）集合计划财产相关账户的开立和管理”中：**

**原：**

“1、集合计划管理人或托管人按照规定开立集合计划财产的托管资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。证券账户和期货账户的持有人名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。开立的上述集合计划财产账户与集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划代销机构和集合计划份额登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。”

**变更为：**

“1、集合计划管理人或托管人按照规定开立集合计划财产的托管资金账户、证券账户等投资所需账户。证券账户的持有人名称应当符合证券登记结算机构的有关规定。开立的上述集合计划财产账户与集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划代销机构和集合计划份额登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。”

**原：**

“3、证券账户、期货账户以及集合计划投资运作有关的其他账户由集合计划管理人与集合计划托管人协商后办理。集合计划管理人和集合计划托管人不得随意假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户。”

**变更为：**

“3、证券账户账户以及集合计划投资运作有关的其他账户由集合计划管理人与集合计划托管人协商后办理。集合计划管理人和集合计划托管人不得随意假借本集合计划的名义开立任何其他银行账户。”

**十六、原合同“十七、投资指令的发送、确认和执行”的“（三）指令的发送、确认及执行的时间和程序”中：**

**原：**

“（2）管理人以传真或双方认可的其他方式发送指令。”

**变更为：**

“（2）管理人以传真或电子邮件方式发送指令。”

**原：**

“4. 指令的执行：托管人确认收到管理人发送的指令后，应对指令进行表面形式审查，验证指令的要素是否齐全，传真指令还应审核印鉴和签章是否和预留印鉴和签章样本相符，指令复核无误后应在规定期限内及时执行。”

**变更为：**

“4. 指令的执行：托管人确认收到管理人发送的指令后，应对指令进行审查，验证指令的要素是否齐全，传真指令还应审核印鉴和签章是否和预留印鉴和签章样本相符，指令复核无误后应在规定期限内及时执行。”

**十七、原合同“十七、投资指令的发送、确认和执行”的“（四）管理人发送错误指令的情形和处理程序”中：**

**原：**

“2. 当托管人认为所接受指令为错误指令时，应及时与管理人进行电话确认，并有权暂停指令的执行并要求管理人重新发送指令。托管人有权要求管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性及其准确性。托管人待收齐相关资料并判断指令有效后在指令形式审查通过后重新开始执行指令。管理人应在合理时间内补充相关资料，并给托管人预留必要的执行时间，否则托管人对因此造成的延误不承担责任。”

**变更为：**



“2. 当托管人认为所接受指令为错误指令时，应及时与管理人进行电话确认，并有权暂停指令的执行并要求管理人重新发送指令。托管人有权要求管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性及其准确性。托管人待收齐相关资料并判断指令有效后在指令审查通过后重新开始执行指令。管理人应在合理时间内补充相关资料，并给托管人预留必要的执行时间。”

**十八、原合同“十七、投资指令的发送、确认和执行”的“（五）托管人依照法律法规暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序”中：**

**原：**

“托管人发现管理人发送的指令有可能违反本合同约定或其他有关法律法规的规定时，应暂缓执行指令，并及时通知管理人，管理人收到通知后应及时核对并纠正；如相关交易已生效，则应通知管理人在 10 个工作日内纠正，并有权报告相关监管部门。对于管理人违反本合同或其他有关法律法规的规定造成产品财产损失的，由管理人承担全部责任，托管人免于承担责任。”

**变更为：**

“托管人发现管理人发送的指令有可能违反本合同约定或其他有关法律法规的规定时，应暂缓执行指令，并及时通知管理人，管理人收到通知后应及时核对并纠正；如相关交易已生效，则应通知管理人在 10 个工作日内纠正，并有权报告相关监管部门；对于此类托管人事前无法监督并拒绝执行的交易行为，托管人在履行了对管理人的通知义务后，即视为完全履行了其投资监督职责。对于管理人违反本合同或其他有关法律法规的规定造成产品财产损失的，由管理人承担全部责任，托管人免于承担责任。”

**十九、原合同“十七、投资指令的发送、确认和执行”的“（九）相关责任”中：**

**新增：**

“资产托管人根据本协议相关规定履行印鉴和签名的审核职责，如果资产管理人的指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能及时提供授权通知等情形，资产托管人因执行有关指令或拒绝执行有关指令而给资产管理人或基金资产或

任何第三方带来的损失，由资产管理人承担相关责任，但资产托管人未按合同约定尽审核义务执行指令而造成损失的情形除外。”

**二十、原合同“十八、越权交易的界定”的“（二）对越权交易的处理程序”中：**

**原：**

“2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

集合计划托管人在行使监督职能时，如果发现集合计划资产投资过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由此给集合计划资产造成的损失由管理人承担，托管人不承担任何责任。如果因管理人原因发生交易所场内超买行为，必须于发生超买行为日的下一个工作日上午 10：00 点之前完成融资，保证完成清算交收。”

**变更为：**

“2、法律法规禁止的超买、超卖行为。

集合计划托管人在行使监督职能时，如果发现集合计划资产投资过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由此给集合计划资产及托管人托管的其他财产造成的损失由管理人承担，托管人不承担任何责任。如果因管理人原因发生交易所场内超买行为，必须于发生超买行为日的下一个工作日上午 10：00 点之前完成融资，保证完成清算交收。”

**二十一、原合同“十八、越权交易的界定”的“（三）集合计划托管人对管理人越权交易的监督”中：**

**删除：**

“3、集合计划托管人越权交易监督的真实性、准确性、及时性和完整性受限于管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他中介机构提供的数据和信息，合规投资的责任在集合计划管理人。集合计划托管人对上述机构提供信息的真实性、准确性、及时性和完整性不作任何担保、暗示或表示，并对上述机构提供信息的错误、遗漏或延迟所引起的损失不承担任何责任。

4、对于集合计划管理人的任何投资行为、投资策略、投资决定或由于集合计划产品设计缺陷或越权交易造成的任何损失，集合计划托管人不承担任何责任。集合计划托管人按照本合同约定履行了上述越权交易监督义务的，即代表托管人

对集合计划投资运作进行了监督。对于集合计划管理人实际发生的越权交易，无论托管人是否发现，托管人对该越权交易的行为以及产生的后果和损失不承担任何补充或连带责任。”

## 二十二、原合同“十八、越权交易的界定”中：

### 新增：

“（四）越权交易的例外

以下不属于越权交易情形：

1、本合同第十一章第（三）条“投资比例超限的处理方式及流程”中所述非因管理人主观原因导致本集合计划投资比例不符合本合同约定；

2、本集合计划终止前 10 个交易日内，管理人对所投资的资产进行变现造成投资比例不符合本合同约定。”

## 二十三、原合同“十九、资产管理计划的估值和会计核算”的“（一）集合计划的估值”的“7、估值方法”的“（4）债券估值方法”中：

### 原：

“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。

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。

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：**

“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。”

**二十四、原合同“二十、资产管理计划的费用与税收”中“（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间”中：**

**原：**

“2、管理人管理费计提和支付：

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为 0.4%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.4\% \div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一自然日集合计划资产净值”

**变更为：**

“2、管理人管理费计提和支付：

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为 0.6%。计算方法如下：

$$H=E\times 0.6\%\div 365$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一自然日集合计划资产净值”

**此次变更不涉及追溯调整。**

**原：**

“（2）业绩报酬支付时间

业绩报酬支付时间分别是收益分配、计划开放和本集合计划终止时，由管理人于 3 个工作日内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。”

**变更为：**

“（2）业绩报酬支付时间

业绩报酬支付时间分别是收益分配、计划开放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。”

**二十五、原合同“二十二、信息披露与报告”的“（一）定期报告”中：**

**原：**

“定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告和托管季度（年度）报告、年度审计报告和对账单。

1、集合计划单位净值披露

披露时间：至少每周披露一次经托管人复核的集合计划的单位净值，并于初始募集期或开放期前公告下一个封闭期的业绩报酬计提基准。

披露方式：披露文件等信息将在管理人指定网站上披露，委托人可随时查阅。

## 2、集合计划的资产管理季度报告

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的季度报告，报告包括但不限于以下内容：

- （一）管理人履职报告；
- （二）托管人履职报告；
- （三）资产管理计划投资表现；
- （四）资产管理计划投资组合报告；
- （五）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- （六）资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；
- （七）资产管理计划投资收益分配情况；
- （八）投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- （九）若本计划投资国债期货的，季度报告还应披露集合计划参与国债期货交易的有关情况，包括投资目的，持仓情况，损益情况，投资国债期对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的等。
- （十）中国证监会及自律组织规定的其他事项。

资产管理季度报告由管理人、托管人编制，由管理人公告，每季度结束之日起一个月内通过管理人网站披露季度报告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，可以不编制当期的季度报告。

## 3、集合计划的资产管理年度报告

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，年度报告包括但不限于以下内容：

- （一）管理人履职报告；
- （二）托管人履职报告（如适用）；
- （三）资产管理计划投资表现；
- （四）资产管理计划投资组合报告；
- （五）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- （六）资产管理计划财务会计报告；

- (七) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (八) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (九) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (十) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理年度报告由管理人编制，报送管理人住所地中国证监会派出机构，并报中国证券投资基金业协会备案（如需）。托管人在每年度向管理人提供一次托管报告，由管理人向委托人公告。年度报告在每年度结束后四个月内通过管理人网站披露。本集合计划成立不足三个月时，管理人可不编制披露当期的年度报告。”

### **变更为：**

“定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告和托管季度（年度）报告、年度审计报告。

#### **1、集合计划单位净值披露**

**披露时间：**至少每周披露一次经托管人复核的集合计划的单位净值，并于初始募集期或开放期前公告下一个封闭期的业绩报酬计提基准。

**披露方式：**披露文件等信息将在管理人指定网站上披露，委托人可随时查阅。

#### **2、集合计划的资产管理季度报告**

管理人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的季度报告，报告包括但不限于以下内容：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；
- (7) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (8) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (9) 中国证监会及自律组织规定的其他事项。

资产管理季度报告由管理人编制，由管理人公告，每季度结束之日起一个月内通过管理人网站披露季度报告，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。本集合计划成立不足三个月时，可以不编制当期的季度报告。

### 3、集合计划的资产管理年度报告

管理人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告，年度报告包括但不限于以下内容：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告（如适用）；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 资产管理计划财务会计报告；
- (7) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (8) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (9) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理年度报告由管理人编制，并按现行有效的法律法规规定、金融管理部门以及中国证券投资基金业协会的要求进行备案、报送。托管人在每年度向委托人提供一次托管报告，由管理人公告，每年度结束之日起四个月内通过管理人网站披露。本集合计划成立不足三个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的年度报告。”

## 二十六、原合同“二十三、风险揭示”的“（六）其他风险”中：

原：

### “13、反洗钱报送安排相关风险

根据《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构反洗钱规定》、《金融机构反洗钱监督管理办法（试行）》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送



内容属管理人、销售机构保密信息，委托人无权知悉，委托人签署本协议，则视为知悉并同意前述安排。”

**变更为：**

**“13、反洗钱报送安排相关风险**

根据《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》、《金融机构客户身份识别和客户身份资料及交易记录保存管理办法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》及相关的法律法规、监管规定，管理人、销售机构将向监管机构报送反洗钱信息，且前述报送安排及报送内容属管理人、销售机构保密信息，委托人无权知悉，委托人签署本协议，则视为知悉并同意前述安排。”

**二十七、原合同“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”的“（一）合同的变更”中：**

**原：**

“1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所、基金业协会、证券业协会等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告之日起生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照管理人开放公告中约定的开放日申请退出本集合计划。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的10个工作日内开放日或10个工作日内期限届满后的合同变更临时开放期内提出退出本集合计划的申请；委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：委托人不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；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委托人，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理。合同变更生效日以管理人公告为准。”

**变更为：**

“1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所、基金业协会、证券业协会等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告之日起生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照管理人开放公告中约定的开放日申请退出本集合计划。临时开放期内，本集合计划不接受任何参与申请。

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的10个工作日内内的开放日或10个工作日内期限届满后的合同变更临时开放期内提出退出本集合计划的申请；委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：委托人不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；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委托人，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理。合同变更生效日以管理人公告为准。临时开放期内，本集合计划不接受任何参与申请。”

**二十八、原合同“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”的“（四）集合计划的清算”的“7、集合计划财产相关账户的注销”中：**

**原：**

“集合计划财产清算完毕后，集合计划托管人及集合计划管理人应按照交易所、银行的有关规定注销托管资金专门账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。”

**变更为：**

“集合计划财产清算完毕后,集合计划托管人及集合计划管理人应按照交易所、银行的有关规定注销托管资金专门账户、证券账户等投资所需账户。”

### **二十九、原合同“二十五、违约责任”的第1条中:**

#### **删除:**

“(9)本合同履行过程中如涉及到期违约债券处置(到期违约的定义见《全国银行间债券市场债券托管结算机构到期违约债券转让结算业务规则》(下称《规则》)),管理人应自行负责寻找交易对手方、交易价格商定、协议签署、债券过户等违约债券转让业务所涉环节,托管人不参与上述业务,仅根据合同的约定履行托管人职责(包括根据管理人指令将资金调入产品托管账户或自托管账户划至DVP账户)。相关违约债券处置的全部责任或可能造成的损失均由管理人自行承担。

此外,为维护委托人利益,如须托管人配合管理人根据《规则》向债券托管结算机构出具《到期违约债券转让结算业务承诺函》(下称《承诺函》)的,各双方一致确认,虽然《承诺函》由管理人和托管人双方共同出具,相关承诺事项视为全部由管理人单方作出,因其违反/不符合《承诺函》导致的全部责任及后果由管理人自行承担。同时,管理人确认并承诺:如托管人因在《承诺函》所承诺事项而被债券托管结算机构或任何第三方追责,导致托管人对外偿付及其他任何损失的,将由管理人承担全部赔偿责任。”

### **三十、原合同“二十七、资产管理合同的效力”中:**

#### **新增:**

“(五)本合同一式叁份,当事人各执壹份,每份具有同等的法律效力。”

### **三十一、原合同“二十八、其他事项”中:**

#### **原:**

“本合同所称的或有事件是指,根据相关法律法规的规定,在满足本合同约定的情况下,本集合计划管理人与托管人可能发生变更。

(一)资产管理计划管理人和托管人的更换的情形

#### **1、资产管理计划管理人的更换**

(1)资产管理计划管理人的更换条件

有下列情形之一的,管理人职责终止:

- ①管理人被依法取消资产管理业务资格；
- ②管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；
- ③法律法规和基金合同规定的其他情形。

## 2、资产管理计划托管人的更换

### (1) 托管人的更换条件

有下列情形之一的，托管人职责终止：

- ①托管人被依法取消基金托管资格；
- ②托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产；
- ③法律法规和基金合同规定的其他情形。”

### **变更为：**

“本合同所称的其他事项是指，根据相关法律法规的规定，在满足本合同约定的情况下，本集合计划管理人与托管人可能发生变更。

### (一) 资产管理计划管理人和托管人的更换的情形

#### 1、资产管理计划管理人的更换

有下列情形之一的，管理人职责终止：

- ①管理人被依法取消资产管理业务资格；
- ②管理人依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产；
- ③法律法规和基金合同规定的其他情形。

#### 2、资产管理计划托管人的更换

有下列情形之一的，托管人职责终止：

- ①托管人被依法取消基金托管资格；
- ②托管人依法解散、被依法撤销或者被依法宣布破产；
- ③法律法规和基金合同规定的其他情形。”

上述变更内容如涉及到托管协议、计划说明书、风险揭示书，相应同步变更。

首创证券股份有限公司

2022年1月19日