

首創證券創贏增利 1 號集合資產管理計劃

修改合同的征求及回复意见函二

广发银行股份有限公司：

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赢增利 1 号集合资产管理计划的《首创证券创赢增利 1 号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、资产管理合同第五章“集合资产管理计划的基本情况”的“(十) 封闭期、开放期安排”中，原：

“2、开放期：

首个开放日为本资产管理计划成立之日起满 2 个月后的对应日（若为非交易日顺延至下一个交易日），首次开放结束后，每月开放一次，可办理参与或退出业务。投资于本计划的每笔资金参与后封闭 2 年，封闭期间不允许赎回该笔资金。如委托人持有份额满足 2 年封闭期要求，可以在对应参与日 2 年后的任一开放日内提起份额赎回申请。具体的开放安排以管理人公告为准。本集合计划合同变更时，管理人有权设置临时开放期，不同意合同变更的委托人可在临时开放期退出集合计划。临时开放期仅允许赎回，不允许申购。”

变更为：

“2、开放期

本集合资产管理计划每月第四个星期二开放，若开放日遇法定节假日、休息日等则自动顺延至下一个交易日。开放日可为投资者办理参与业务，投资者持有份额每满 18 个月方可在开放日办理对应份额赎回业务。若投资者持有份额在满 18 个月的对应开放赎回日未进行份额赎回，则该笔份额将需继续持有 18 个月后方可在开放日赎回。具体的开放安排以管理人公告为准。

本集合计划合同变更时，管理人有权设置临时开放期，不同意合同变更的委

托人可在临时开放期或变更生效前的开放日退出集合计划。因合同变更设置的临时开放期内，申请退出的份额不受上述持有时长的限制。临时开放期仅允许赎回，不允许申购。”

资产管理合同第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”的“(二)参与和退出的开放日及时间”中做相应变更。

二、资产管理合同第五章“集合资产管理计划的基本情况”的“(十二)本集合计划的各项费用”中，原：

“1、认购费/参与费:0%

2、托管费: 0.03%/年

3、管理费: 1.00%/年

4、退出费: 0%

5、业绩报酬: 参见合同集合计划的费用、业绩报酬部分

6、其他费用: 参见合同集合计划的费用、业绩报酬部分”

变更为：

“1、认购费/参与费:0%

2、托管费: 0.03%/年

3、管理费: 0.70%/年

4、退出费: 0%

5、业绩报酬: 以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如发生上一个业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，则为份额确认日，下同）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。

6、其他费用: 其他费用由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。”

三、资产管理合同第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”的“(七)参与份额与退出金额的计算方式”中，原：

“1、参与份额计算

参与份额=参与金额÷参与日计划单位净值

集合计划份额面值为 1.00 元。委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。”

变更为：

“1、参与份额计算

参与份额=参与金额÷参与日计划单位净值

委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。”

四、资产管理合同第八章“资产管理计划的参与、退出与转让”的“(十六)管理人自有资金参与集合计划”中，原：

“管理人可选择以自有资金参与本集合计划份额。

(1) 自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

(2) 自有资金参与的金额和比例：自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的 20%。

(3) 自有资金退出的条件：管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于 6 个月。

(4) 因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限时的处理原则及处理措施：因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人在满足持有期限要求且约定责任解除后，管理人将在 5 个工作日内公告退出安排。

(5) 信息披露：管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前 5 个

工作日通过管理人网站公告。

(6) 自有资金责任承担方式和金额：管理人自有资金参与的享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。

(7) 收益分配以管理人的公告为准。”

变更为：

“管理人可选择以自有资金参与本集合计划份额。

(1) 自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

(2) 自有资金参与的金额和比例：自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 50%。

(3) 自有资金退出的条件：管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于 6 个月。

(4) 因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限时的处理原则及处理措施：因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人在满足持有期限要求且约定责任解除后，管理人将在 5 个工作日内公告退出安排。

(5) 信息披露：管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前 5 个工作日通过管理人网站公告。

(6) 自有资金责任承担方式和金额：管理人自有资金参与的享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。

(7) 收益分配以管理人的公告为准。”

五、资产管理合同第二十章“资产管理计划的费用与税收”的“(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 1.0%。计算方法如下：

$$H=E \times 1.0\% \div 365$$

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

管理人的管理费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次，经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。”

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 0.7%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div 365$$

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

管理人的管理费每日计提，逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次，经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。”

六、资产管理合同第二十章“资产管理计划的费用与税收”的“(二) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间”中，原：

“3、业绩报酬的计提和支付

(1) 管理人核算业绩报酬的原则：

在本计划分红确认日、退出确认日和计划终止确认日，管理人将根据委托人上一个业绩报酬计提基准日（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基准日的年化收益率 R ，对业绩报酬计提基准 $Y\%$ 以上的部分按照 60% 的比例收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）。

（1）业绩报酬计提原则

① 委托人每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。在符合业绩报酬计提条件时，在本计划的分红确认日、退出确认日和计划终止确认日计提业绩报酬。

② 计划分红确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金；在退出确认和计划终止确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。

③ 在退出确认日和计划终止确认日，业绩报酬按委托人退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔认购/追加份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔认购/追加份额的剩余部分不受影响。

（2）业绩报酬计提方法

业绩报酬计提基准日为本计划的分红基准日、退出开放日和计划终止日。业绩报酬计提日为本计划的分红确认日、退出确认日和计划终止确认日。业绩报酬的计提，以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准。上一个业绩报酬计提基准日，如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提，认购所得的份额，以份额注册日期为准；追加所得的份额，以追加申请对应日为准；委托人退出时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔认购/追加应收的管理人业绩报酬。

本计划业绩报酬的提取频率不超过每 6 个月一次，因投资者退出本计划，管理人按照本计划合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

① 年化收益率的计算公式

$$R = [(P1 - P0) \div P2] \times 100\% \times (365 \div T)$$

其中：

R = 年化收益率

$P1$ = 本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值（扣除本次封闭期业绩报酬前）

P_0 = 上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值（扣除上一个封闭期业绩报酬后）

P_2 = 上一个业绩报酬计提基准日的单位净值

T = 份额注册日期或上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数

② 管理人以超额比例的方式提取业绩报酬，具体计算公式如下：

年化收益率	收取比例	管理人业绩报酬计算公式
$R \leq Y\%$	0	$E = 0$
$Y\% < R$	60%	$E = N \times P_2 \times (R - Y\%) \times 60\% \times T / 365$

E = 某笔份额对应的管理人业绩报酬

N = 委托人该笔认购（追加）在本次退出日退出的份额数，或其在分红基准日所持的份额数，或其在计划终止时所持的份额数

③ 将所有笔数的管理人业绩报酬加总，得到总的管理人业绩报酬（ ΣE ）。

$$\Sigma E = E_1 + E_2 + E_3 + \dots + E_n$$

其中的 n 为所对应的份额笔数。

业绩报酬由注册登记机构负责计算，资产托管人按照管理人指令进行划款。

（2）业绩报酬支付时间

资产管理人于业绩报酬计提日起三个工作日内向资产托管人发送业绩报酬划款指令，资产托管人按照指令从计划财产中一次性支付给资产管理人。遇法定节假日、休息日时，支付日期顺延。

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

变更为：

“3、业绩报酬的计提和支付

（1）管理人核算业绩报酬的原则：

按投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红日、投资者退出日和本集合计划终止日计提业绩报酬。其中，在投资者退出日计提的，仅对投资者退出的份额计提业绩报酬。

集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。

投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。例如：某投资者于开放时参与 100 万份，锁定 18 个月后的开放日时又参与 200 万份，继续锁定 18 个月后的开放日时退出 150 万份，则认为这 150 万份中的 100 万份持有了 36 个月，另外的 50 万份持有了 18 个月，分别计算业绩报酬。

(2) 业绩报酬计提方法

每笔集合计划份额的业绩报酬以该笔份额上一个发生业绩报酬的业绩报酬计提日（如发生上一个业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，则为参与份额确认日，下同）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率 R ，作为计提业绩报酬的依据。当集合计划份额年化收益率 $R \leq$ 业绩报酬计提基准 r 时，则管理人不提取业绩报酬；当集合计划份额年化收益率 $R >$ 业绩报酬计提基准 r 时，管理人对年化收益率超过业绩报酬计提基准的收益部分收取 60% 作为业绩报酬。

业绩报酬具体计算方法如下：

$$F = \max \{ (R - r) \times 60\% \times C \times (N / 365), 0 \}$$

其中：

$$R = [(PA - PC) / PC] \times (365 / N) \times 100\%$$

F ：投资者每笔认购/存续期参与集合计划份额应提取的业绩报酬；

R ：该笔认购/存续期参与份额的年化收益率；

r ：业绩报酬计提基准。对于客户持有的某一笔份额，自其上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日起至本次业绩报酬计提期间，其适用的第一个年化业绩报酬计提基准为 r_{x_1} ，对应天数为 D_{x_1} ；其适用的第二个年化业绩报酬计提基准为 r_{x_2} ，对应天数为 D_{x_2} ；以此类推，其适用的最后一个年化业绩报酬计提基准为 r_{x_k} ，对应天数为 D_{x_k} 。则该笔份额 x 的年化业绩报酬计提基准 r_x 为：

$$r_x = \frac{r_{x_1} \times D_{x_1} + r_{x_2} \times D_{x_2} + \dots + r_{x_k} \times D_{x_k}}{(D_{x_1} + D_{x_2} + \dots + D_{x_k})}$$

PA: 本次发生业绩报酬计提日单位累计净值;

PC: 上一个发生业绩报酬计提日的单位累计净值;

PC*: 上一个发生业绩报酬计提日的单位净值;

C: 投资者每笔认购/存续期参与的集合计划份额在上一个发生业绩报酬计提日的资产净值总额;

N: 上一个发生业绩报酬计提日到本次发生业绩报酬计提日的天数。

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。

每个自然季度起 10 个工作日内或产品终止时,管理人有权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。支付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。

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

业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的计算使用,并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。”

七、资产管理合同第二十章“资产管理计划的费用与税收”的“(二)集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间”中,原:

“5、审计费用

本集合计划的年度审计费用,按管理人与会计师事务所确定的金额,在被审计的会计年度期间,自确认费用开始按直线法在当年年度剩余的每个自然日内平均计提。”

变更为:

“5、审计费用

本集合计划的年度审计费用，按管理人与会计师事务所确定的金额，审计费用按年度一次性计提。”

八、资产管理合同第二十四章“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满10个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，管理人将在生效日之前三个工作日设置临时开放期，委托人可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。”

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。”

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 執

首創證券股份有限公司：

貴司《首創證券創贏增利 1 號集合資產管理計劃修改合同的征求意见函二》已收悉。我行對該集合資產管理計劃合同修改的意見如下：

我行同意按照貴司來函中所列明的內容，對首創證券創贏增利 1 號集合資產管理計劃資產管理合同、托管協議、風險揭示書、計劃說明書進行修改，請貴司按照相關法律法規和資產管理合同的相关规定進行產品變更備案，並及時、充分履行信息披露義務。

廣發銀行股份有限公司
2021年5月6日



02041354

