

关于首创证券创赢9号集合资产管理计划 修改合同的征求及回复意见函五

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9号集合资产管理计划的管理合同（包括《首创证券创赢9号集合资产管理计划资产管理合同》及其修改合同的征求及回复意见函一、修改合同的征求及回复意见函二、修改合同的征求及回复意见函四，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、风险揭示书中对应的条款同步更改。具体更改内容如下：

一、原合同“三、承诺与声明”中“(三) 投资者声明”部分，

原：

“1. 符合《管理规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

2. 投资者承诺以真实身份参与集合计划，财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。投资者承诺，如委托资金为资产管理产品募集的资金时，将确保资产管理产品的投资者中不包含其他资产管理产品。如委托资金为除公募资产管理产品外的合伙企业、契约等非法人形式，最终投资者满足法律法规、监管规则规定的合格投资者要求，并向管理人提供合法募集资金的证明文件、充分披露实际投资者和最终资金来源，保证所提供证明文件真实、准确、完整、合法。

3. 已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。”

变更为：

“1. 符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

2. 投资者承诺以真实身份参与集合计划，财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。投资者承诺，如委托资金为资产管理产品募集的资金时，将确保资产管理产品的投资者中不包含其他资产管理产品。如委托资金为除公募资产管理产品外的合伙企业、契约等非法人形式，最终投资者满足法律法规、监管规则规定的合格投资者要求，并向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源，保证所提供文件真实、准确、完整、合法。

3. 已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

4. 投资者以资产管理产品投资本资产管理计划的，投资者应确保其参与本资产管理计划的资产管理产品为合法、合规且经金融监督管理部门备案的金融产品，不存在资金池等违规行为。”

二、原合同“四、当事人及权利义务”中“3、委托人的义务”部分，

原：

“（1）委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；自然人不得用筹集的他人资金参与集合计划，法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或其他销售机构提供合法筹集资金的证明文件；”

变更为：

“(1) 委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；”

三、原合同“四、当事人及权利义务”中“1、管理人简况”部分，

原：

“机构名称：首创证券股份有限公司

法定代表人：毕劲松

住所及通信地址：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

邮政编码：100088

联系电话：(010) 59366000”

变更为：

“机构名称：首创证券股份有限公司

法定代表人：毕劲松

住所及通信地址：北京市朝阳区安定路 5 号院 13 号楼 A 座 11-21 层

邮政编码：100029

联系电话：010-81152000”

四、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中“(二) 集合资产管理计划目标规模”部分，

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 亿元，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）。”

五、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中“(三) 投资目标、投

资范围和投资比例”部分，

原：

“3、资产配置比例

(1) 固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、同业存单、企业债、项目收益债（NPB）、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、资产支持证券（含证监会和银保监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券，限优先级，且底层不为产品）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等银行间市场交易的投资品种、超过7天的债券逆回购、债券型基金等。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在AA及以上级别，短期融资券债项评级不低于A-1。

(2) 现金类资产包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在1年内（含1年）的国债、到期日在1年内（含1年）的央行票据、到期日在1年内（含1年）的政府债券、不超过7天（含7天）的债券逆回购；

(3) 固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的80%-100%。

全体委托人一致同意，在本资产管理计划存续期间，为规避特定风险保护投资者合法权益的，本产品投资于固定收益资产的比例可以低于计划总资产的80%，但不得持续6个月低于计划总资产的80%。

(4) 债券回购：债券正回购或逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的100%；

(5) 计划总资产不得超过计划净资产的200%。

(6) 以成本价计算，本集合计划投资于单一标的债券金额不得超过该债券存续规模的25%，且不得超过本计划资产净值的25%。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%，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。

(7) 本集合资产管理计划不得直接投资商业银行信贷资产；也不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保。

(8) 本集合资产管理计划不得投资于将资管/信托产品或其收/受益权作为底层资产的资产支持证券或资产支持票据。

(9) 管理人管理的全部集合资产管理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。

委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，交易完成 10 个工作日内，管理人应书面通知托管人，并采取有效措施防范利益冲突保护投资者合法权益。”

变更为：

“3、资产配置比例

(1) 固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、同业存单、企业债、项目收益债（NPB）、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、资产支持证券（含证监会和银保监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券，限优先级，且底层不为产品）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等银行间市场交易的投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型基金等。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别，短期融资券、超短期融资券、短期公司债券如有债项评级则不低于 A-1。

(2) 现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在 1 年内（含 1 年）的国债、到期日在 1 年内（含 1 年）的央行票据、到期日在 1 年内（含 1 年）的政府债券、不超过 7 天（含 7 天）的债券逆回购等。

(3) 固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的 80%-100%。

全体委托人一致同意，在本资产管理计划存续期间，为规避特定风险保护投资者合法权益的，本产品投资于固定收益资产的比例可以低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。

(4) 债券回购：债券正回购或逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的 100%。

(5) 本资产管理计划的总资产不得超过净资产的 200%。

(6) 以成本价计算，本集合计划投资于单一标的债券金额不得超过该债券存续规模的 25%，且不得超过本计划资产净值的 25%。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%，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。

(7) 本集合资产管理计划不得直接投资商业银行信贷资产；也不得违规为地方政府及其部门提供融资，不得要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保。

(8) 本集合资产管理计划不得投资于将资管/信托产品或其收/受益权作为底层资产的资产支持证券或资产支持票据。

(9) 管理人管理的全部集合资产管理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。

委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，交易完成 10 个工作日内，管理人应书面通知委托人和托管人，并采取有效措施防范利益冲突保护投资者合法权益。”

六、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中“(五) 封闭期、开放期安排”部分，

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：除开放期和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。”

七、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中“（八）本集合计划的风险收益特征及适合推广对象”部分，

原：

“本计划属于 R3 风险等级的证券投资产品。适合向风险承受能力 C3 及以上的投资者推广。”

变更为：

“本计划属于 R2 风险等级的证券投资产品。适合向风险承受能力 C2 及以上的投资者推广。”

八、原合同“七、资产管理计划的成立与备案”中“（二）集合计划设立失败”部分，

原：

“集合计划初始募集期结束，在集合计划初始募集资金总额（不含参与费）低于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）或委托人的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败。管理人需以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并将已认购资金及银行同期活期存款利息在初始募集期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人。”

变更为：

“集合计划初始募集期结束，在集合计划初始募集资金总额（不含参与费）低于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）或委托人的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败。管理人需以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并将已认购资金及银行同期活期存款利息在初始募集期结束后 30 日内退还集合计划委托人。”

九、原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“（二）集合计划的退出”部分，

原：

“4、退出费及退出份额的计算

(1) 退出费用

本集合计划无退出费

(2) 退出金额的计算方法

委托人在开放日退出本计划，管理人根据计划单位份额净值计算其退出金额。

退出金额=退出份额×T 日该类集合计划单位份额净值（扣除业绩报酬及分红后）”

变更为：

“4、退出费及退出份额的计算

(1) 退出费用

本集合计划无退出费

(2) 退出金额的计算方法

委托人在开放日退出本计划，管理人根据计划单位份额净值计算其退出金额。

退出金额=退出份额×T 日集合计划单位份额净值（扣除业绩报酬及分红后）”

原：

“6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

(1) 单个委托人大额退出的认定

对单个委托人单日退出份额超过上一工作日计划总份额数的 15%时，即视为单个委托人大额退出。如果大额退出情况触发巨额退出条件，按照巨额退出进行认定和处理。”

变更为：

“6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

(1) 单个委托人大额退出的认定

对单个委托人单日退出份额超过上一工作日计划总份额数的 10%时，即视为单个委托人大额退出。如果大额退出情况触发巨额退出条件，按照巨额退出进行认定和处理。”

十、原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“(三) 集合计划份额的转让”部分，

原：

“集合计划存续期间，本资产管理计划份额方可转让。集合计划份额转让业务的开通和处理方式、份额转让的实际收费标准以管理人公告为准。在符合管理人公告的条件下，并经管理人同意后，客户可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，并按规定办理份额变更登记手续。”

变更为：

“集合计划存续期间，经管理人同意后投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合资产管理计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。”

十一、原合同“十一、资产管理计划的投资”中“(二) 投资范围及比例”部分，

原：

“2、资产配置比例

(1) 固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、同业存单、企业债、项目收益债（NPB）、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、资产支持证券（含证监会和银保监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券，限优先级，且底层不为产品）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等银行间市场交易的投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型基金等。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别，短期融资券债项评级不低于 A-1。

(2) 现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在 1 年内（含 1 年）的国债、到期日在 1 年内（含 1 年）的央行票据、到期日在 1 年内（含 1 年）的政府债券、不超过 7 天（含 7 天）的债券逆回购等；

(3) 固定收益类和现金类资产占本计划总资产的 80%-100%；

全体委托人一致同意，在本资产管理计划存续期间，为规避特定风险保护投资者合法权益的，本产品投资于固定收益资产的比例可以低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。

(4) 债券回购：债券正回购或逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的 100%；

(5) 本资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%；”

变更为：

“2、资产配置比例

(1) 固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、同业存单、企业债、项目收益债（NPB）、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、资产支持证券（含证监会和银保监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券，限优先级，且底层不为产品）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具等银行间市场交易的投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型基金等。

投资于公司债、企业债、中期票据等信用债的信用等级满足债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别，短期融资券、超短期融资券、短期公司债券如有债项评级则不低于 A-1。

(2) 现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在 1 年内（含 1 年）的国债、到期日在 1 年内（含 1 年）的央行票据、到期日在 1 年内（含 1 年）的政府债券、不超过 7 天（含 7 天）的债券逆回购等。

(3) 固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的 80%-100%。

全体委托人一致同意，在本资产管理计划存续期间，为规避特定风险保护投资者合法权益的，本产品投资于固定收益资产的比例可以低于计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于计划总资产的 80%。

(4) 债券回购：债券正回购或逆回购资金余额不得超过本计划上一日净资产的 100%。

(5) 本资产管理计划的总资产不得超过净资产的 200%。”

十二、原合同“十一、资产管理计划的投资”中“(四) 风险收益特征”部分，

原：

“本计划属于中等风险 R3 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。”

十三、原合同“十四、利益冲突及关联交易”部分，

原：

“2、存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率

(1) 存在利益冲突的处理方式

集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

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。”

变更为：

“2、存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率

(1) 存在利益冲突的处理方式

集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

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。”

十四、原合同“十九、资产管理计划的估值和会计核算”中“(十二)资产管理计划份额净值的确认；”部分，

原：

“用于集合计划信息披露的集合计划资产净值和集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。”

变更为：

“用于集合计划信息披露的集合计划资产净值和集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个交易日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对集合计划净值予以公布。”

十五、原合同“十九、资产管理计划的估值和会计核算”中“(十三)特殊情况的处理”部分，

原：

“(2) 由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所、证券经纪机构、期货公司及登记结算公司发送的数据错误等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划资产估值错误，

管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。”

变更为：

“(2) 由于不可抗力原因，或由于证券交易所、证券经纪机构及登记结算公司发送的数据错误等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。”

十六、原合同“二十、集合计划的费用、业绩报酬”中“(二) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间”部分，

原：

“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。”

变更为：

“6、注册登记费：

本集合计划成立后的注册登记费用由计划承担，收费标准按照中国证券登记结算有限责任公司公布费率执行，管理人在收到缴费通知单后按照份额登记机构要求进行费用支付。

7、其他费用：

本集合计划成立后的信息披露费用、会计师费、律师费和银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，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。”

十七、原合同“二十二、信息披露与报告”中“(一) 定期报告”部分，

原：

“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，并报送管理人住所地中国证监会派出机构，并向中国证券投资基金业协会备案（如需）。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) 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) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理年度报告由管理人、托管人编制，报送管理人住所地中国证监会派出机构，并向中国证券投资基金业协会备案（如需）。托管人在每年度向委托人提供一次托管报告。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的年度报告。”

变更为：

“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：

- (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、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，并报送管理人住所地中国证监会派出机构，并向中国证券投资基金业协会备案（如需）。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、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：

- (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；
- (8) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (9) 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；
- (10) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理年度报告由管理人、托管人编制，报送管理人住所地中国证监会派出机构，并向中国证券投资基金业协会备案（如需）。托管人在每年度向委托人提供一次托管报告。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的年度报告。”

十八、原合同“二十四、集合计划终止和清算”中“（一）有下列情形之一的，集合计划应当终止：”部分，

原：

“5、在不违反法律法规规定不损害委托人权益的前提下，经管理人认为有必要终止集合计划的，在与托管人协商一致后，可提前终止集合计划；

6、集合计划存续期间，本集合计划委托人少于 2 人；

7、不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；

8、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。”

变更为：

“5、在不违反法律法规规定不损害委托人权益的前提下，经管理人认为有必要终止集合计划的，经全体投资者、管理人和托管人协商一致，可提前终止集合计划；

6、集合计划存续期间，持续 5 个工作日投资者少于 2 人；

7、资产管理计划存续期届满且不展期；

- 8、未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
- 9、不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；
- 10、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。”

十九、原合同“二十六、风险揭示”中“(十) 特别提示”部分，

原：

“1、提前终止条款

存续期内，集合计划委托人少于 2 人，导致本集合计划提前终止。”

变更为：

“1、提前终止条款

存续期内，集合计划持续 5 个工作日投资者少于 2 人，导致本集合计划提前终止。”

二十、原合同“二十九、其他事项”中“(一) 资产管理计划管理人和托管人的更换的情形”部分，

原：

“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：

“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。”

望贵行签收后回传我司，并对是否同意进行合同更改及继续担任该集合资产管理计划的托管人等事项作出答复。

首创证券股份有限公司

2022年5月18日

回 执

首创证券股份有限公司：

贵司《关于首创证券创赢 9 号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 9 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

2022 年 5 月 18 日