

关于首创证券创赢 37 号集合资产管理计划 修改合同的征求及回复意见函三

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司托管的首创证券创赢 37 号集合资产管理计划的《首创证券创赢 37 号集合资产管理计划资产管理合同》（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“一、前言”中，

原：

“本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《首创证券创赢 37 号系列集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。”

变更为：

“本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《首创证券创赢 37 号集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。”

二、原合同“三、承诺与声明”的“（三）投资者声明”中，

原：

“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。”

变更为：

“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。”

三、原合同“四、当事人及权利义务”的“3、委托人的义务”中，

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；”

四、原合同“四、当事人及权利义务”的“1、管理人简况”中，

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”

五、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”的“（五）投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级”中，

原：

“3、投资比例

（1）固定收益及现金类资产：占本计划资产总值的 80%-100%，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、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，且底层不为产品或收/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据（含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）等交易所及银行间交易的投资品种、债券逆回购、债券型基金、货币市场基金、银行存款、现金等。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或债项评级在 AA 及以上级别，短期融资券债项评级不低于 A-1。

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) 本集合计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%；

(5) 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%（本条款由管理人自行监控）。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。

4. 产品风险等级

本集合资产管理计划的风险等级为【R3】（中等风险，流动性较高，本金安全具有一定的不确定性，在特殊情况下可能损失全部本金），适合风险承受能力等级匹配且法律法规及监管规定允许投资的个人投资者、机构投资者，及监管机构允许投资本集合计划的其他投资者。”

变更为：

“3、投资比例

(1) 固定收益及现金类资产：占本计划资产总值的 80%-100%，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、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，且底层不为产品或收/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据（含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）等交易所及银行间交易的投资品种、

债券逆回购、债券型基金、货币市场基金、银行存款、现金等。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或债项评级在 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。

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) 本集合计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%。

(5) 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%（本条款由管理人自行监控）。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。

4. 产品风险等级

本集合资产管理计划的风险等级为【R2】（中低风险），适合风险承受能力等级匹配且法律法规及监管规定允许投资的个人投资者、机构投资者，及监管机构允许投资本集合计划的其他投资者。”

六、原合同“五、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：

“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“七、资产管理计划的成立与备案”的“(二)集合计划设立失败”中，

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。”

八、原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”的“(十)单个委托人大额退出、巨额退出和连续巨额退出”中，

原：

“1、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：

“1、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。”

九、原合同“十一、资产管理计划的投资”的“（二）投资范围及比例”中，原：

“2、资产配置比例及限制

（1）固定收益及现金类资产：占本计划资产总值的 80%-100%，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、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，且底层不为产品或收/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据（含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）等交易所及银行间交易的投资品种、债券逆回购、债券型基金、货币市场基金、银行存款、现金等。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或债项评级 AA 及以上级别，短期融资券债项评级不低于 A-1。”

变更为：

“2、资产配置比例及限制

（1）固定收益及现金类资产：占本计划资产总值的 80%-100%，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、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，且底层不为产品或收/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据（含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）等交易所及银行间交易的投资品种、债券逆回购、债券型基金、货币市场基金、银行存款、现金等。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或债项评级在 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。”

十、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。

2、集合计划托管人以本集合计划的名义在商业银行开立集合计划的托管资金账户。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付集合计划收益，均需通过本集合计划的托管资金账户进行。本托管资金账户仅限于本集合计划使用，仅限于满足开展本集合计划业务的需要。

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。如集合计划投资运作有关的其他账户是由集合计划管理人负责开立的，集合计划管理人应保证该账户专款专用，并聘请资金监管机构对该账户的资金划付进行监管。相应的投资回款及收益，也由集合计划管理人负责及时原路划回托管资金账户，已聘请资金监管机构的，集合计划管理人应配合资金监管机构完成投资回款的划付。集合计划管理人开立此类账户后需及时通知集合计划托管人。”

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。

2、集合计划托管人以本集合计划的名义在商业银行开立集合计划的托管资金账户。本集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付集合计划收益，均需通过本集合计划的托管资金账户进行。本托管资金账户仅限于本集合计划使用，仅限于满足开展本集合计划业务的需要。

3、证券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。如集合计划投资运作有关的其他账户是由集合计划管理人负责开立的，集合计划管理人应保证该账户专款专用，并聘请资金监管机构对该账户的资金划付进行监管。相应的投资回款及收益，也由集合计划管理人负责及时原路划回托管资金账户，已聘请资金监管机构的，集合计划管理人应配合资金监管机构完成投资回款的划付。集合计划管理人开立此类账户后需及时通知集合计划托管人。”

十一、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”中，

原：

“12、资产管理计划份额净值的确认；

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。

13、特殊情况的处理

(1) 管理人或托管人按估值方法的第 1-6 项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。

(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：

“12、资产管理计划份额净值的确认；

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。

13、特殊情况的处理

(1) 管理人或托管人按估值方法的第 1-6 项进行估值时，所造成的误差不得作为集合计划资产估值错误处理。

(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。”

**十二、原合同“二十二、信息披露与报告”的“(一) 定期报告”中，
原：**

“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、托管人编制，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。

4、年度审计报告

管理人进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本集合资产管理计划出具单项审计意见。管理人在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人可不提供审计报告。

管理人应当将审计结果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。”

变更为：

“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，并报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。

4、年度审计报告

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所进行年度审计，并在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告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。本资产管理计划成立不足 3 个月时，管理人可不进行年度审计。”

十三、原合同“二十三、风险揭示”的“（七）本集合计划特有风险”中，原：

“1、委托人可能无法参与的风险

由于本集合计划设定了初始募集期及存续期的规模上限，管理人将根据合同的约定对每类份额的规模上限以及份额配比进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

2、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的委托人均视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。”

变更为：

“1、委托人可能无法参与的风险

由于本集合计划设定了初始募集期及存续期的规模上限，管理人将根据合同的约定对份额的规模上限进行控制，因此委托人可能面临着因上述原因而无法参与本集合计划的风险。

2、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。”

十四、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”中，

原：

“7、集合计划财产相关账户的注销

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：

“7、集合计划财产相关账户的注销

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。”

十五、原合同“二十七、资产管理合同的效力”的“(二)资产管理合同的生效条件。”中，

原：

“投资者为法人的，资产管理合同自投资者、管理人和托管人加盖公章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，资产管理合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立。”

变更为：

“投资者为法人的，资产管理合同自投资者、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，资产管理合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章之日起成立。”



回 执

首创证券股份有限公司：

贵司《关于首创证券创赢 37 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函三》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 37 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。

广发银行股份有限公司
2022 年 7 月 11 日

