

关于首创证券创赢增利 1 号集合资产管理计划 修改合同的征求及回复意见函四

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“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、全文中“首创证券有限责任公司”变更为“首创证券股份有限公司”。

二、原合同“一、前言”中，

原：

“订立本合同的依据、目的和原则：

1. 订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《指导意见》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称《运作规定》）、《集合资产管理计划管理合同内容与格式指引（试行）》、《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定。

2. 订立本合同的目的是规范首创证券创赢增利 1 号集合资产管理计划（以下简称“集合计划”或“计划”）运作，明确《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“本合同”）当事人的权利与义务，保护集合计划委托人的合法权益。

3. 订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护集合计划委托人的合法权益。

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》、《首创证券创赢增利1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:

“订立本合同的依据、目的和原则:

1. 订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作规定》)、《集合资产管理计划管理合同内容与格式指引(试行)》、《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》、《中华人民共和国个人信息保护法》(以下简称《个人信息保护法》)等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定。

2. 订立本合同的目的是规范首创证券创赢增利1号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”)运作,明确《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“本合同”)当事人的权利与义务,保护集合计划委托人的合法权益。

3. 订立本合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护集合计划委托人的合法权益。

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》、《个人信息保护法》、《首创证券创赢增利1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。”

三、原合同“二、释义”中,

新增:

“《个人信息保护法》:指2021年8月20日经第十三届全国人大常委会第三十次会议表决通过的《中华人民共和国个人信息保护法》;”

“业绩报酬核算日：指业绩报酬调整日或业绩报酬计提日；”

四、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，保证所提供证明文件真实、准确、完整、合法。”

新增：

“4. 投资者已知晓并理解《个人信息保护法》第十七条规定的事项及个人在个人信息处理活动中的各项权利。

5. 投资者已充分知晓并同意管理人基于监管要求或为客户提供产品及服务需要处理个人信息。

6. 如由投资者提供第三方个人信息的，投资者承诺其提供的信息真实、准确、完整，并已取得相关信息主体的同意。

7. 已阅读管理人在其网站公示的隐私政策，同时，本人已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险，并愿意承担相关风险及损失。”

五、 原合同“四、当事人及权利义务”的“2、委托人的权利”中，

原：

“（7）因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；

（8）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。”

变更为：

（7） “投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，投资者可向管理人提出关于撤回同意处理个人信息授权的书面申请。投资者撤回同意，不影响撤回前基于个人同意已进行的个人信息处理活动的效力。

（8）因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；

（9）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。”

六、 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；”

七、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：首创证券有限责任公司

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

联系人：史笑石

联系电话：010-59366030”

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”

八、原合同“四、当事人及权利义务”的“3、管理人义务”中，

原：

“（34）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。”

变更为：

“（34）遵守《个人信息保护法》的要求，遵守保密义务，采取必要的措施保障投资者个人信息的安全，并采取合理措施告知投资者其执行的个人信息保护政策。

（35）管理人向其他个人信息处理者提供其处理的个人信息的，应当向个人告知接收方的名称或者姓名、联系方式、处理目的、处理方式和个人信息的种类，并取得个人的单独同意。受托个人信息处理者为国家机关或者法律、法规授权的

具有管理公共事务职能的组织，且法律、行政法规规定应当保密或者不需要告知的情形的，管理人可以不向个人告知且无需经投资者单独同意。

（36）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。”

九、原合同“四、当事人及权利义务”的“1、托管人简况”中，
原：

“名称：广发银行股份有限公司

地址：北京市西城区菜市口大街1号院2号楼信托大厦11层

法定代表人或负责人：王滨

邮政邮编：100053

业务联系人：卢晓晨

联系电话：010-65169644

传真：010-65169555“

变更为：

“名称：广发银行股份有限公司

地址：北京市西城区菜市口大街1号院2号楼信托大厦11层

法定代表人或负责人：王凯

邮政邮编：100053

业务联系人：李萌

联系电话：010-65169086

传真：010-65169555”

十、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”的“（四）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)。”

十一、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、含次级债)、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)、资产支持证券优先级(含证监会和银监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券)、资产支持票据、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、超过 7 天的债券逆回购、债券型基金。

管理人投资的公司债、企业债、中期票据等信用债需要满足买入时的债券主体评级或债项评级至少有一项在 AA 及以上级别,短期融资券需要满足买入时发行人主体评级不得低于 AA,债项评级不低于 A-1。管理人投资的非公开定向债务融资工具需要满足买入时发行人主体评级不得低于 AA;资产支持证券需要满足买入时债项评级不得低于 AA(长期)/A-1(短期),仅能投资资产支持证券优先级,且不得投资于将资管产品或其收受益权作为底层资产的资产支持证券,投向非公开定向债务融资工具及资产支持证券占计划资产总值的合计比例不得高于 40%。

如所投资资产在持有过程中出现债项或主体评级变化,则不再对此类债券做债项或主体的评级限制。

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。

本集合计划不直接投资于商业银行信贷资产。

主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不超过本资产管理计划资产净值的 20%。

(2) 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%。

(3) 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%；

(4) 计划总资产不得超过计划净资产的 200%。

(5) 计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。

(6) 本集合计划投资于单一债券的投资数量不得超过债券发行规模的 25% 且投资于单一债券的金额（以成本价计）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%。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%，本条投资限制由管理人自行监控。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。”

变更为：

“3、投资比例

(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、含次级债）、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）、资产支持证券优先级（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）、资产支持票据、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、超过 7 天的债券逆回购、债券型公募基金。

管理人投资的公司债、企业债、中期票据等信用债需要满足买入时的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、超短期融资券主体评级不低于 AA，如有债项评级则债项评级同时满足不低于 A-1。管理人投资的非公开定向债务融资工具需要满足买入时发行人主体评级不得低于 AA；资产支持证券需要满足买入时债项评级不得低于 AA（长期）/A -1（短期），仅能投资资产支持证券优先级，且不得投资于将资管产品或其收受益权作为底层资产的资产支持证券，投向非公开定向债务融资工具及资产支持证券占计划资产总值的合计比例不得高于 40%。

如所投资资产在持有过程中出现债项或主体评级变化，则不再对此类资产做债项或主体的评级限制。

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。

本集合计划不直接投资于商业银行信贷资产。

主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不超过本资产管理计划资产净值的 20%。

流动性受限资产，是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。

(2) 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类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%。

(3) 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%；

(4) 计划总资产不得超过计划净资产的 200%。

(5) 计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。

(6) 本集合计划投资于单一债券的投资数量不得超过债券存续规模的 25% 且投资于单一债券的金额（以市值计）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%。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%，本条投资限制由管理人自行监控。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。”

原：

“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。”

变更为：

“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。

若销售/推广机构评定的风险等级与管理人评定的风险等级不一致时，以销售/推广机构评定的风险等级为准。销售/推广机构向投资人推介产品时，所依据的产品风险等级评价结果不得低于管理人作出的风险等级评价结果。”

十二、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。

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。”

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。

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。若管理人在开放期调整业绩报酬计提基准，投资者持有份额即使未达到最低持有期限，也可在该开放期退出。具体的开放安排以管理人公告为准。”

十三、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中，

删除：

“（十二）本集合计划的各项费用

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。”

十四、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。”

十五、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。本集合计划完成备案前不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。”

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。本集合计划完成备案前不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。”

十六、原合同“八、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，

原：

“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。”

变更为：

“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。若管理人在开放期调整业绩报酬计提基准,投资者持有份额即使未达到最低持有期限,也可在该开放期退出。具体的开放安排以管理人公告为准。”

十七、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。”

十八、原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”的“(十三)集合计划份额的转让”中,

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。”

十九、原合同“八、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：

“(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。”

变更为：

“(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，管理人将在5个工作日内公告退出安排。”

二十、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、含次级债）、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）、资产支持证券优先级（含证监会和银监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券）、资产支持票据、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、超过7天的债券逆回购、债券型基金。

管理人投资的公司债、企业债、中期票据等信用债需要满足买入时的债券主体评级或债项评级至少有一项在AA及以上级别，短期融资券需要满足买入时发行人主体评级不得低于AA，债项评级不低于A-1。管理人投资的非公开定向债务

融资工具需要满足买入时发行人主体评级不得低于 AA；资产支持证券需要满足买入时债项评级不得低于 AA（长期）/A -1（短期），仅能投资资产支持证券优先级，且不得投资于将资管产品或其收受益权作为底层资产的资产支持证券，投向非公开定向债务融资工具及资产支持证券占计划资产总值的合计比例不得高于 40%。

如所投资产在持有过程中出现债项或主体评级变化，则不再对此类债券做债项或主体的评级限制。

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。

本集合计划不直接投资于商业银行信贷资产。

主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不超过本资产管理计划资产净值的 20%。

(2) 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%。

(3) 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%；

(4) 计划总资产不得超过计划净资产的 200%。

(5) 计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。

(6) 本集合计划投资于单一债券的投资数量不得超过债券发行规模的 25% 且投资于单一债券的金额（以成本价计）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%。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%，本条投资限制由管理人自行监控。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。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，本计划发生上述关联交易的，管理人在交易完成后应 10 个工作日内告知委托人者和托管人，并按照现行法律法规、自律规则向监管机构及自律组织报告。”

变更为：

“2、资产配置比例及限制

(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、含次级债）、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）、资产支持证券优先级（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）、资产支持票据、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、超过 7 天的债券逆回购、债券型公募基金。

管理人投资的公司债、企业债、中期票据等信用债需要满足买入时的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、超短期融资券主体评级不低于 AA，如有债项评级则债项评级同时满足不低于 A-1。管理人投资的非公开定向债务融资工具需要满足买入时发行人主体评级不得低于 AA；资产支持证券需要满足买入时债项评级不得低于 AA（长期）/A -1（短期），仅能投资资产支持证券优先级，且不得投资于将资管产品或其收受益权作为底层资产的资产支持证券，投向非公开定向债务融资工具及资产支持证券占计划资产总值的合计比例不得高于 40%。

如所投资资产在持有过程中出现债项或主体评级变化，则不再对此类资产做债项或主体的评级限制。

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。

本集合计划不直接投资于商业银行信贷资产。

主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不超过本资产管理计划资产净值的 20%。

(2) 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类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%。

(3) 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%；

(4) 计划总资产不得超过计划净资产的 200%。

(5) 计划开放退出期内，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本计划资产净值的 10%。

(6) 本集合计划投资于单一债券的投资数量不得超过债券存续规模的 25% 且投资于单一债券的金额（以市值计）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%。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%，本条投资限制由管理人自行监控。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。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，本计划发生上述关联交易的，管理人在交易完成后应 10 个工作日告知委托人者和托管人，并按照现行法律法规、自律规则向监管机构及自律组织报告。”

二十一、 原合同“十四、利益冲突及关联交易”中，

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。

集合计划份额持有人不得因本集合计划投资收益劣于集合计划管理人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向集合计划管理人或集合计划托管人提出任何损失或损害补偿的要求。”

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，应提前二十个工作日公告并取得投资者同意，且有充分证据证明未损害投资者利益，同时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。

集合计划份额持有人不得因本集合计划投资收益劣于集合计划管理人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向集合计划管理人或集合计划托管人提出任何损失或损害补偿的要求。”

原：

“2、临时报告

集合计划存续期间，管理人运用受托管理资产从事关联交易的，应当按照规定编制信息披露公告，披露下列信息：

(1) 交易概述及交易标的的基本情况；

(2) 交易各方的关联关系和关联方基本情况；

(3) 交易的定价政策及定价依据；

(4) 交易协议的主要内容，包括交易价格、交易结算方式、协议生效条件、生效时间、履行期限等；

(5) 交易决策及审议情况；

(6) 管理人认为应当披露的其他信息。

本集合计划运用受托管理资产从事关联交易的，应当于签订交易协议后 10 个工作日内（无交易协议的，自事项发生之日起 10 个工作日内），按照规定在管理人网站发布信息披露公告。”

变更为：

“2、临时报告

本集合计划运用受托管理资产从事关联交易的，应当于签订交易协议后 10 个工作日内（无交易协议的，自事项发生之日起 10 个工作日内），按照规定在管理人网站发布信息披露公告。”

二十二、原合同“十五、投资经理的指定与变更”的“1、投资经理的指定：”中，

原：

“1、投资经理的指定：

资产管理计划投资经理由管理人负责指定。

本资产管理计划投资经理为佟思尧先生，简介如下：

佟思尧，男，首创证券资产管理事业部总经理助理，南加州大学金融工程硕士。具有丰富的宏观研究经历和固定收益产品投资交易经验。历任首创证券有限责任公司资产管理部交易员、投资经理、高级投资经理，现任资产管理事业部总经理助理、投资经理。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

2、投资经理的变更

委托人同意，管理人有权根据本资产管理计划投资运作需求及内部审批流程变更投资经理，但应在变更后 5 个工作日内及时在管理人网站公布。”

变更为：

“1、投资经理的指定：

资产管理计划投资经理由管理人负责指定。

本资产管理计划投资经理为李苏航先生和姚佳女士，简介如下：

李苏航，首创证券资产管理事业部固定收益投资部副总经理、投资经理，英国朴茨茅斯大学学士，英国兰卡斯特大学金融硕士，CFA Level III Candidates。

擅长把握个券投资机会，对量化分析及大类资产配置有较为深入认识。2018年加入首创证券资产管理事业部历任职固定收益交易员、投资经理助理，负责资管产品的资产配置、流动性管理，现任资产管理事业部固定收益投资部副总经理。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

姚佳，首创证券资产管理事业部固定收益投资部投资经理，精算学学士。偏向挖掘价值洼地与捕捉交易性机会相结合，具有丰富的投资交易经验。2015年加入国融证券股份有限公司，历任债券交易员、投资总监助理、投资顾问授权代表，2019年加入首创证券股份有限公司，担任资产管理事业部固定收益投资部投资经理，负责资管产品的资产配置、流动性管理和投后跟踪工作。投资经理已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

2、投资经理的变更

投资经理发生以下情形时，管理人应及时变更：

- (1) 投资经理离职的；
- (2) 投资经理被取消投资经理资格的；
- (3) 投资经理因违反法律法规及其他监管规定无法履职的；
- (4) 其他可能导致投资经理无法正常行使投资经理职责的。

委托人同意，管理人有权根据本资产管理计划投资运作需求及内部审批流程变更投资经理，但应在变更后5个工作日内及时在管理人网站公布。”

二十三、原合同“十七、投资指令的发送、确认和执行”的“(三)投资指令的发送、确认和执行”中，

原：

“2、指令的确认

(1) 计划托管人在接收指令时，应对指令是否由有权发送指令人员发送、指令的要素是否齐全、指令印鉴与签字是否与预留的授权文件内容相符进行审慎验证，查验后以电话形式或其他双方一致认可的方式向发送指令人员确认，如发现问题，应及时通知管理人。经确认的指令，计划管理人不得否认其效力，但如果计划管理人已经撤销或更改对有权签署、发送指令人员的授权，并且通知计划

托管人，经托管人确认，则对于此后该类相关人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，计划管理人不承担责任。

(2) 计划托管人可以要求计划管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保计划托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

(3) 计划托管人收到划款指令后，应根据本协议约定，审核计划管理人的划款指令。计划托管人对划款指令以及计划管理人提交的与划款指令相关的所有材料进行审核。

计划托管人应对下列内容进行审核：

一是划款指令要素、印鉴和签名是否正确完整；

二是划款指令金额与指令附件投资协议等证明文件中约定的投资金额一致。

三是划款指令中的收款账户信息与指令附件投资协议等证明文件中约定的收款账户信息一致（若有）。若指令附件投资协议未约定收款账户信息的，划款指令中的收款户名应与本协议约定的投资方向一致。

(4) 计划管理人向计划托管人出具投资指令时，须提供相关投资证明材料。上述材料应加盖计划管理人印章。

计划管理人应保证以上所提供的作为划款依据的文件资料的真实、有效、完整、准确、合法，没有任何重大遗漏或误导；计划托管人对此类文件资料的真实性和有效性不作实质性判断。”

变更为：

“2、指令的确认

(1) 计划托管人在接收指令时，应对指令是否由有权发送指令人员发送、指令的要素是否齐全、指令印鉴与签字是否与预留的授权文件内容相符进行审慎验证，查验后以电话形式或其他双方一致认可的方式向发送指令人员确认，如发现问题，应及时通知管理人。经确认的指令，计划管理人不得否认其效力，但如果计划管理人已经撤销或更改对有权签署、发送指令人员的授权，并且通知计划托管人，经托管人确认，则对于此后该类相关人员无权发送的指令，或超权限发送的指令，计划管理人不承担责任。

(2) 计划托管人可以要求计划管理人提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料，以确保计划托管人有足够的资料来判断指令的有效性。

(3) 计划托管人收到划款指令后，应根据本协议约定，审核计划管理人的划款指令。计划托管人对划款指令以及计划管理人提交的与划款指令相关的材料进行审核。

计划托管人应对下列内容进行审核：

一是划款指令要素、印鉴和签名是否正确完整；

二是划款指令金额与指令附件投资协议等证明文件中约定的投资金额一致。

三是划款指令中的收款账户信息与指令附件投资协议等证明文件中约定的收款账户信息一致（若有）。若指令附件投资协议未约定收款账户信息的，划款指令中的收款户名应与本协议约定的投资方向一致。

(4) 计划管理人向计划托管人出具投资指令时，须提供相关投资证明材料。上述材料应加盖计划管理人印章。

计划管理人应保证以上所提供的作为划款依据的文件资料的真实、有效、完整、准确、合法，没有任何重大遗漏或误导；计划托管人对指令及文件资料的真实性和有效性不作实质性判断。”

二十四、 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。”

二十五、 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：

“（5）违约资产估值方法：在集合计划存续期间，处于违约状态的资产按照第①-⑨项规定的方法对违约资产进行估值；在集合计划终止时，违约资产的估值记为 0，并在处置完成后按照清算规则予以清算。

（6）如有确凿证据表明按上述规定进行估值不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。”

变更为：

“（5）如有确凿证据表明按上述规定进行估值不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

（6）相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。”

二十六、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 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。”

二十七、原合同“十九、资产管理计划的估值和会计核算”的“(二)集合计划的会计政策”中，

原：

“1、集合计划管理人为本计划的会计责任方；

2、集合计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；集合计划首次募集的会计年度按如下原则：如果《资管合同》生效少于 2 个月，可以并入下一个会计年度；”

变更为：

“1、集合计划管理人为本计划的会计责任方；

2、集合计划的会计年度为公历年度的 1 月 1 日至 12 月 31 日；集合计划首次募集的会计年度按如下原则：如果《资管合同》生效少于 3 个月，可以并入下一个会计年度；”

二十八、原合同“二十、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：

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。4、证券交易费用: 本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认 (申) 购和赎回费、印花税等有关税费, 作为交易成本直接扣除。”

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

在本集合计划存续过程中，管理人可在本集合计划收益分配日（以管理人的分红公告为准）、投资者退出日或本集合计划终止日对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬。

同一委托人不同时间，多次参与的，按投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提超额业绩报酬。

在集合计划收益分配日提取业绩报酬的，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。

如业绩报酬计提基准发生变动，管理人将以公告形式进行告知及披露。

(2) 业绩报酬的计提方法

在收益分配基准日和计划终止日，对集合计划中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬；在委托人退出申请日，仅对退出份额中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬。本集合计划运作期间，若投资者份额对应持有期间产品年化实际收益率低于管理人公布的业绩报酬计提基准，则管理人不收取业绩报酬；对于持有期产品年化收益高于管理人公布的业绩报酬计提基准以上的部分，管理人收取 60% 作为超额业绩报酬。

每笔参与份额以上一业绩报酬核算日到本次业绩报酬核算日的年化收益率，作为计提业绩报酬的依据。若委托人持有计划份额期间，发生业绩报酬计提基准调整，需分别计算调整前后不同核算期内的产品年化收益率，并加总计算管理人业绩报酬。

核算期产品年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \div D \times 365 \times 100\%$$

P_1 ：本次业绩报酬核算日的单位累计净值；

P_0 ：上一个业绩报酬核算日的单位累计净值；

P_0^* : 上一个业绩报酬核算日的单位净值;

D : 上一个业绩报酬核算日至本次业绩报酬核算日的天数;

R : 年化收益率。

业绩报酬具体计算方法如下:

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

F : 针对投资者每笔参与份额核算期内应提取的业绩报酬;

r : 核算期区间对应的业绩报酬计提基准;

C : 投资者每笔参与份额在上一业绩报酬核算日的资产净值总额;

注: 若委托人持有计划份额期间, 发生业绩报酬计提基准调整, 则该笔份额存在多个核算期, 需分别计算调整前后不同核算期内产品的年化收益率, 并加总计算管理人业绩报酬。

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。

(3) 业绩报酬的支付

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。

4、**证券交易费用:**本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认(申)购和赎回费、印花税等有关税费, 作为交易成本直接扣除。”

二十九、原合同“二十二、信息披露与报告”的“(一)定期报告”中,

原:

“（一）定期报告

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、托管人编制，并报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送证券公司住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构。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：

“（一）定期报告

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、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编制，托管人每季度向管理人提供一次季度托管报告，由管理人向委托人公告。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：

- (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。托管人每年度向管理人提供一次年度托管报告，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。”

三十、原合同“二十三、风险揭示”的“(六) 投资标的的风险”中，

原：

“（1）高收益债券的特殊风险

本计划投资范围包含高收益债券，该类债券的信用风险略高于其他信用债品种，包含如下风险：”

变更为：

“（1）高收益债券的特殊风险

本计划投资范围包含高收益债券，该类债券的信用风险高于其他信用债品种，包含如下风险：”

三十一、原合同“二十三、风险揭示”的“(七) 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。”

新增：

“18、投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，但投资者撤回同意，存在可能导致管理人无法为投资者提供相关产品或服务的风​​险。

19、投资者已了解尽管管理人已采取各项措施保障投资者个人信息安全，但仍有可能存在个人信息泄露、篡改、丢失的风险。”

三十二、原合同“二十三、风险揭示”的“(八)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集合计划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。”

三十三、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：

“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：

“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。”

三十四、原合同“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”的“(二)集合计划的展期”中，

原：

“1、展期的条件

(1) 在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反《集合资产管理合同》、《说明书》的约定；

(2) 展期没有损害委托人利益的情形；

(3) 托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；

(4) 中国证监会规定的其他条件。”

变更为：

“1、展期的条件

(1) 在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反《集合资产管理合同》、《说明书》的约定；

(2) 展期没有损害委托人利益的情形；

(3) 托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；

(4) 展期后，符合本集合计划的成立条件；

(5) 中国证监会规定的其他条件。”

三十五、原合同“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”的“(三) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：”中，

原：

“9、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报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，前述第9项约定的情形除外。”

变更为：

“9、法律、行政法规、本合同及中国证监会规定的其他终止情形。

管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报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，前述第8项约定的情形除外。”

三十六、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

(1) 资产管理计划管理人的更换条件

- 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

- 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。”



回 执

首创证券股份有限公司：

贵司《关于首创证券创赢增利1号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函四》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，对首创证券创赢增利1号集合资产管理计划管理合同、计划说明书、托管协议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11月9日

