关于首创证券创赢31号集合资产管理计划

修改合同的征求及回复意见函六

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31号集合资产管理计划的管理合同（包括《首创证券创赢31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、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三、修改合同的征求及回复意见函四、修改合同的征求及回复意见函五，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“二、释义”部分，

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20%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）超过上一工作日计划总份额20%的情形；”

二、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）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%。”

变更为：

“（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类和现金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%。”

原：

“（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。”

变更为：

“（6）以市值计算，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。”

三、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中“（九）本集合计划的推广”部分，

原：

“2、推广方式

管理人及推广机构应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式推广文件，以纸质资料方式置备于推广机构营业场所。推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大历史业绩和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。”

变更为：

“2、推广方式

推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大历史业绩和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。”

四、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中“（十）本集合计划的各项费用”部分，

原：

“5、业绩报酬：对年化收益率超过业绩报酬计提基准以上的部分提取 60%作为管理人的业绩报酬，剩余 40%作为超额收益分配给委托人。”

变更为：

“5、业绩报酬：对年化收益率超过业绩报酬计提基准以上的部分提取 5%作为管理人的业绩报酬，剩余 95%作为超额收益分配给委托人。”

五、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：

“（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%。”

变更为：

“（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类和现金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%。”

原：

“（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。”

变更为：

“（6）以市值计算，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。”

六、原合同“十一、资产管理计划的投资”中“（三）投资比例超限的处理方式及流程”部分，

原：

“委托人在此同意，本计划存续期间，为规避特定风险，本计划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%。”

变更为：

“委托人在此同意，本计划存续期间，为规避特定风险，本计划投资于固定收益类和现金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%。”

七、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：

“（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（业绩报酬核算日指：业绩报酬计提基准调整日或业绩报酬计提日，下同）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。管理人于产品发行前公告产品业绩报酬计提基准，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。

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）×60%×C×（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。”

变更为：

“（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 5%作为超额业绩报酬。

每笔参与份额以上一业绩报酬核算日（业绩报酬核算日指：业绩报酬计提基准调整日或业绩报酬计提日，下同）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。管理人于产品发行前公告产品业绩报酬计提基准，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。

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）×5%×C×（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。”

若产品合同变更条款涉及到托管协议、风险揭示书和计划说明书，对应一并修改。

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 11 月 29 日

回　　执

首创证券股份有限公司：

贵司《关于首创证券创赢 31 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函六》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 31 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 11 月 29 日