

关于首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划 修改合同的征求及回复意见函六

中国光大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行托管的首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划的《首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划资产管理合同》编号：光银托管北分 2019QS041-2-补 04-资管（以下简称“原合同”）进行更改，现按照“《原合同》第二十四条第（一）项”所述“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。”的约定执行，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“（四）集合资产管理计划目标规模”部分：

原：

“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）。

管理人有权根据实际情况调整推广期的目标规模，并由管理人在管理人指定网站公告。”



扫描全能王 创建

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(具体以管理人公告为准)。本集合计划委托人数量为 2 人以上(含) 200 人以下(含)。

管理人有权根据实际情况调整推广期的目标规模以及单个客户首次参与金额, 并由管理人在管理人指定网站公告。”

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

原:

“2、主要投资方向

本集合计划主要投资于固定收益类(含现金类)等债权类投资品种, 且本集合计划可参与债券回购业务。

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)、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、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。资产支持证券债项评级不得低于 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/信托产品或其收益权作为底层资产的资产支持证券。

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。”

变更为:

“2、主要投资方向



扫描全能王 创建

本集合计划主要投资于固定收益及现金类等债权类投资品种,且本集合计划可参与债券回购业务。

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)、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、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。资产支持证券债项评级不得低于 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/信托产品或其收受益权作为底层资产的资产支持证券。

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%,按市值计,也不超过本计划净资产的 25%,利率债不受此项限制。”

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。”

四、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中“(十二)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“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“(十五)管理人自有资金参与集合计划”部分：

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。”

六、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：

“1、投资范围

本集合计划主要投资于固定收益类（含现金类）等债权类投资品种，且本集合计划可参与债券回购业务。



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）、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、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。资产支持证券债项评级不得低于 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/信托产品或其收受益权作为底层资产的资产支持证券。

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。”

变更为：

“1、投资范围

本集合计划主要投资于固定收益及现金类等债权类投资品种，且本集合计划可参与债券回购业务。

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）、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、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。资产支持证券债项评级不得低于 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/



信托产品或其收受益权作为底层资产的资产支持证券。

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%，按市值计，也不超过本计划净资产的 25%，利率债不受此项限制。”

七、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，本计划投资于债权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%。”

八、原合同“十四、利益冲突及关联交易”部分：

原：

“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。”

变更为：

“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（卖出、赎回关联证券或管理方管理的资产管理产品的除外），并有充分证据证明未损害投资者利益。管理人事后应及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露并向中国证监会相关派出机构和中国证券投资基金业协会报告重大关联交易情况。”



九、原合同“二十、资产管理计划的费用与税收”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：

“3、业绩报酬的计提和支付

(1) 管理人核算业绩报酬的原则：

- 1) 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。
- 2) 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。

3) 集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬(若有)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(若有)从退出资金中扣除。

4) 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。若投资者多笔参与，则按投资者每笔参与份额及持有期限分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

(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：

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

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。”

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：

1) 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。

2) 符合业绩报酬计提条件时，管理人有权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。

3) 集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬（若有）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（若有）从退出资金中扣除。

4) 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。若投资者多笔参与，则按投资者每笔参与份额及持有期限分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

(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：

$$F = \max \{ (R - r) \times 5\% \times C \times (D / 365), 0 \}$$

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。”

十、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： ”

变更为：

“2、集合计划的资产管理季度报告

管理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： ”

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”

变更为：

“3、集合计划的资产管理年度报告

管理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： ”



回 执

首创证券股份有限公司：

贵司《关于首创证券创赢 M6002 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 M6002 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。

中国光大银行股份有限公司北京分行



2022年12月02日



扫描全能王 创建