

首创证券创赢 29 号集合资产管理计划变更合同条款说明五

《首创证券创赢 29 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“原合同”)中条款变更涉及以下内容:

一、原合同“二、释义”中,

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”的“(四)集合资产管理计划目标规模”中,

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。”

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”的“(五)投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级”中,

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。”

变更为：

“2、主要投资方向

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。”

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，且底层不为产品或其收/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、债券型公募基金、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、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。”

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，且底层不为产品或其收/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、债券型公募基金、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、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)。

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。”

四、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:

“管理人通过深入分析国内外宏观经济走势、社会资金运动及各项宏观经济政策对金融市场特别是货币市场的影响,密切关注市场资金面松紧变化,把握市场利率走势,合理确定集合计划的开放申购的时机、规模、投资标的以及业绩报酬计提基准的范围。管理人确定业绩报酬计提基准主要基于集合计划投资的债券回购、债券、货币市场基金等的收益情况估算,但并不是管理人向委托人保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺,投资风险为委托人自行承担。”

变更为:

“管理人通过深入分析国内外宏观经济走势、社会资金运动及各项宏观经济政策对金融市场特别是货币市场的影响,密切关注市场资金面松紧变化,把握市场利率走势,合理确定集合计划的开放申购的时机、投资标的以及业绩报酬计提基准的范围。管理人确定业绩报酬计提基准主要基于集合计划投资的债券回购、债券、货币市场基金等的收益情况估算,但并不是管理人向委托人保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺,投资风险为委托人自行承担。”

五、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”的“(十二)本集合计划的各项费用”中,

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。”

六、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：

“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。”

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。”

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，且底层不为产品或其收/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、债券型公募基金、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、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。”

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，且底层不为产品或其收/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、债券型公募基金、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、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）。

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”的“（三）投资比例超限的处理方式及流程”中，

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“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：

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。”

上述变更内容如涉及到托管协议、计划说明书、风险揭示书，相应同步变更。

首创证券股份有限公司

2022年11月30日