

## 首创证券创惠 10 号灵活优选集合资产管理计划

### 变更合同条款说明二

我司近期拟对《首创证券创惠 10 号灵活优选集合资产管理计划资产管理合同》（以下合并简称“资产管理合同”）中的部分条款进行更改，产品条款更改涉及如下：

#### 一、资产管理合同第二章“释义”中，原：

“封闭期：特指成立日后的一个期间，在此期间委托人不得参与、退出本集合计划；”

#### 变更为：

“封闭期：除开放期和临时开放期以外的期间；”

#### 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 10%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、资产管理合同第三章“承诺与声明”的“（三）投资者声明”中，原：

“7. 已阅读管理人在其网站公示的隐私政策，同时，本人已了解尽管首创证券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。”

#### 变更为：

“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。”

#### 三、资产管理合同第四章“当事人及权利义务”的“（一）合同当事人”

中，原：

**“管理人**

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

联系人：董志成

联系电话：010-81152042”

**托管人**

机构名称：广发银行股份有限公司

住所：广东省广州市越秀区东风东路713号

负责人或授权代表：王凯

联系人：王海涛

通信地址：北京市西城区菜市口大街1号院2号楼信托大厦11层

联系电话：010-65169834

**变更为：**

**“管理人**

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

联系人：赵璐

联系电话：010-81152044”

**托管人**

机构名称：广发银行股份有限公司

住所：广东省广州市越秀区东风东路713号

负责人或授权代表：王凯

联系人：李萌

通信地址：北京市西城区菜市口大街1号院2号楼信托大厦11层

联系电话：010-65169086

四、资产管理合同第四章“当事人及权利义务”的“（四）委托人的义务”中，增加：

“11、不得违规或违反本合同约定转让其所拥有的计划份额；

12、本集合计划如采用电子签名合同，委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料。委托人应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；

13、除非在本合同规定的退出开放期或终止日，不得要求提前终止委托资产管理关系；”

其余条款序号自动调整。

五、资产管理合同第四章“当事人及权利义务”的“（五）管理人的权利”中，增加：

“7、按照本合同及《说明书》的约定，停止办理集合计划份额的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；

8、根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；

9、集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；”

其余条款序号自动调整。

六、资产管理合同第四章“当事人及权利义务”的“（六）管理人的义务”中，增加：

“26、进行资产估值等会计核算并编制资产管理计划财务会计报告；

27、依法计算并披露资产管理计划净值，确定参与、退出价格；

28、按照有关合同和规定行使资产管理计划财产投资权利而应承担的义务，包括但不限于选择经纪商及投资标的等；

29、依法对托管人、销售机构的行为进行监督，如发现托管人、销售机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反本合同、代理销售协议的，应当予以制止；

30、按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项；

31、在集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；

32、因管理人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

33、确保本合同、说明书及本集合计划相关文本相关约定保持一致。

34、除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传。”

其余条款序号自动调整。

七、资产管理合同第五章“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：**

“本集合计划推广期规模上限为 50 亿元，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)。”

八、资产管理合同第五章“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。

### 3、投资比例

(1) 固定收益及现金类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、同业存单、企业债、二级资本债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（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，且底层不为产品或产品收益权/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、债券正回购、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、短期公司债券如有债项评级则不低于 A-1。

非公开定向债务融资工具发行人主体评级不得低于 AA；资产支持证券债项评级不得低于 AA（长期）/A -1（短期）。

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%。

本集合资产管理计划不得投资于将资管/信托产品或其收/受益权作为底层资产的资产支持证券或资产支持票据。

本计划不直接投资于商业银行信贷资产。

(2) 固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的 80%-100%。

(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) 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%。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：

## “2、主要投资方向

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、交易商协会发行的标准化债权类投资品种。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：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、二级资本债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（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，且底层不为产品或产品收益权/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、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。

非公开定向债务融资工具发行人主体评级不得低于 AA；资产支持证券债项评级不得低于 AA（长期）/A -1（短期）。

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%。

本集合资产管理计划不得投资于将资管/信托产品或其收/受益权作为底层资产的资产支持证券或资产支持票据。

本计划不直接投资于商业银行信贷资产。

(2) 固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的 80%-100%。

(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) 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%。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。”

九、资产管理合同第五章“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。”

十、资产管理合同第八章“集合资产管理计划的参与、退出与转让”的“（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认”中，原：

“1、集合计划的参与

（1）参与的办理时间

本集合计划投资者可在本合同约定的开放期（包括临时开放期）内办理参与本集合计划的业务。具体开放参与安排以管理人公告为准。”

变更为：

“1、集合计划的参与

（1）参与的办理时间

本集合计划投资者可在本合同约定的开放期内办理参与本集合计划的业务。具体开放参与安排以管理人公告为准。”

原：

“4、管理人自有资金参与集合计划

管理人可选择以自有资金参与本集合计划份额。

（1）自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》《管理办法》《管理规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

(2) 自有资金参与的金额和比例：自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 50%。

(3) 自有资金退出的条件：管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于 6 个月。

(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、管理人自有资金参与集合计划

管理人可选择以自有资金参与本集合计划份额。

(1) 自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》《管理办法》《管理规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

(2) 自有资金参与的金额和比例：自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的 20%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 50%。

(3) 自有资金退出的条件：管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于 6 个月。

(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。”

**十一、资产管理合同第十一章“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。

**2、投资比例**

(1) 固定收益及现金类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、同业存单、企业债、二级资本债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（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，且底层不为产品或产品收益权/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、债券正回购、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、短期公司债券如有债项评级则不低于 A-1。

非公开定向债务融资工具发行人主体评级不得低于 AA；资产支持证券债项评级不得低于 AA（长期）/A -1（短期）。

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%。

本集合资产管理计划不得投资于将资管/信托产品或其收/受益权作为底层资产的资产支持证券或资产支持票据。

本计划不直接投资于商业银行信贷资产。

(2) 固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的 80%-100%。

(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) 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%。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：**

“1、投资范围

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、交易商协会发行的标准化债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。

## 2、投资比例

(1) 固定收益及现金类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、同业存单、企业债、二级资本债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（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，且底层不为产品或产品收益权/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、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。

非公开定向债务融资工具发行人主体评级不得低于 AA；资产支持证券债项评级不得低于 AA（长期）/A -1（短期）。

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%。

本集合资产管理计划不得投资于将资管/信托产品或其收/受益权作为底层资产的资产支持证券或资产支持票据。

本计划不直接投资于商业银行信贷资产。

(2) 固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的 80%-100%。

(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) 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%。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。”

十二、资产管理合同第十四章“利益冲突及关联交易”的“（二）存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率”中，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。”

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，提前二十个工作日公告并取得投资者同意，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中国证券投资基金业协会报告。”

十三、资产管理合同第十五章“投资经理的指定与变更”中，原：

“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吴洲扬，简介如下：

吴洲扬，首创证券资产管理事业部固定收益投资部投资经理，美国德保罗大学金融学硕士。偏向于通过数据分析调整投资组合来寻找固定收益投资机会，具有丰富的固定收益产品投资交易经验。历任瑞泰人寿保险有限公司资产管理部投资专员、董事会办公室主管；首创证券资产管理事业部固定收益部交易员、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。”

变更为：

“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彩英，简介如下：

李彩英，首创证券资产管理事业部固定收益投资部投资经理，毕业于中国人民大学，经济管理硕士，2019年加入首创证券资管事业部，历任资产管理部债券交易员、交易主管、投资经理助理，现任资产管理事业部固定收益投资部投资经理。擅长寻找交易性机会，具有丰富的券商资管产品管理和投资经验。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。”

十四、资产管理合同第十九章“资产管理计划财产的估值和会计核算”的“（七）估值调整的情形与处理”中，原：

“4、集合资产管理计划份额净值差错处理的原则和方法如下：

（1）份额净值计算出现错误时，管理人应当立即予以纠正，通报托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（2）错误偏差达到或超过份额净值的 0、5%时，管理人应当通报托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到或超过份额净值的 1%时，管理人应当公告、通报托管人并报中国证监会备案。”

变更为：

“4、集合资产管理计划份额净值差错处理的原则和方法如下：

（1）份额净值计算出现错误时，管理人应当立即予以纠正，通报托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

（2）错误偏差达到或超过份额净值的 0.5%时，管理人应当通报托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到或超过份额净值的 1%时，管理人应当公告、通报托管人并报中国证监会备案。”

十五、资产管理合同第二十二章“信息披露与报告”的“（一）定期报告”中，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：

（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。

资产管理年度报告由管理人、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：

- (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，由管理人每年度结束之日起四个月内通过管理人网站披露年度报告，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3个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的年度报告。”

### 变更为：

#### “2、集合计划的资产管理季度报告

管理人在每季度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、托管人复核，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

管理人在每年度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。

资产管理季年度报告由管理人编制、托管人复核，由管理人每年度结束之日起四个月内通过管理人网站披露年度报告，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 3 个月时，管理人/托管人可不编制披露当期的年度报告。”

十六、资产管理合同第二十三章“风险揭示”的“（七）本集合计划特有风险”中，原：

“2、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。”

变更为：

“2、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。”

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。

首创证券股份有限公司

2022 年 11 月 29 日