

## 首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划变更合同条款说明十

《首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“原合同”)中条款更改主要涉及以下内容:

### 一、原合同“四、当事人及权利义务”中“(三)托管人”部分,

原:

#### 1、托管人简况

名称: 中国光大银行股份有限公司北京分行

地址: 北京市西城区宣武门内大街 1 号

法定代表人或负责人: 王罡

邮政邮编: 100031

业务联系人: 宋述坤

联系电话: 010-83759306

传真: 010-83759386

变更为:

#### 1、托管人简况

名称: 中国光大银行股份有限公司北京分行

地址: 北京市西城区宣武门内大街 1 号

法定代表人或负责人: 汪永奇

邮政邮编: 100031

业务联系人: 宋述坤

联系电话: 010-83759306

传真: 010-83759386

### 二、原合同“五、资产管理计划的基本情况”中“3、投资比例”部分,

新增:

本集合计划投资于其他资产管理产品的, 大类资产配置比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算; 本资产管理计划投资于其他私募资产管理产品的, 按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或者同类资产的金额。

**三、原合同“六、资产管理计划的募集”中“1、募集对象”部分，**

**新增：**

投资者仅能以其合法所有的自有资金（即不包括以管理人、受托人或类似的身份合法管理的募集资金，下同）认购/申购本资产管理计划。

**四、原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“2、退出的金额限制”部分，**

**新增：**

本集合计划份额持有人在收益分配日申请全部退出集合计划份额时，持有的集合计划红利再投资份额资产净值高于 30.00 万元的，管理人将对该集合计划份额持有人分红份额做全部退出处理。

**五、原合同“十一、资产管理计划的投资”中“2、资产配置比例及限制”部分，**

**新增：**

本集合计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算；本资产管理计划投资于其他私募资产管理产品的，按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或者同类资产的金额。

**六、原合同“十七、投资指令的发送、确认和执行”部分，**

**原：**

**（一）交易清算授权**

1、计划管理人应当事先向计划托管人发出书面授权通知，向计划托管人提供指令的预留印鉴样本和签字样本，并在授权通知上载明计划管理人有权发送指令的人员名单及联系方式。计划管理人应指定至少两名以上的有权发送指令人员。

2、计划管理人向计划托管人发出的授权通知应加盖公章。计划托管人在收到授权通知后以约定方式确认。授权通知在托管人确认后才可生效。

3、计划管理人和计划托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向有权发送指令人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露，除非法律法规

另有规定或监管部门另有要求。

## （二）投资指令的内容

1、指令包括计划管理人在运作计划资产时，向计划托管人发出的书面划款指令或其他双方一致认可形式的划款指令，包括付款指令（含退出、收益分配付款指令）及其他资金划拨指令等。

2、计划管理人发给计划托管人的有效划款指令应写明款项事由、支付时间、收付款人开户银行、金额、收付款人账户名称、账号等要素信息，加盖预留印鉴并由被授权人签字、相关的指令附件齐全且头寸充足的投资指令。

## （三）投资指令的发送、确认和执行

### 1、指令的发送

(1)管理人可选择电子或者传真/邮件等管理人和托管人双方认可的方式向托管人发送投资指令，并与托管人进行确认。因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时清算所造成的损失，由管理人承担。

电子指令模式：管理人通过深证通、托管网银或管理人和托管人双方认可电子渠道发送电子指令给托管人，并与托管人进行确认。

传真/邮件指令模式：管理人将有效投资指令及划款证明材料以传真或电子邮件的形式发送给托管人。投资指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、支付金额、收付款账户信息等，并加盖授权签发人预留名章、审批人预留名章及投资指令签发业务章。管理人有义务在发送指令后与托管人以电话的方式进行确认。托管人依照本合同约定对指令进行验证确认指令有效并根据本合同约定进行审核后，方可执行指令。

(2)计划托管人应指定专人接收计划管理人的指令，并预先通知计划管理人接收人名单和联系方式。

### 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一致性审查，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一致性审核。

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。

### 3、指令的执行

(1) 计划托管人确认指令有效后，方可执行指令。

(2) 计划托管人在复核后应在规定期限内执行适当的指令，不得延误。计划托管人发现计划管理人的指令违反法律法规规定或者集合资产管理合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并向证券公司住所地中国证监会派出机构报告。

(3) 相关登记结算机构向计划托管人发送的结算通知视为计划管理人向计划托管人发出的有效指令，计划托管人应予以执行。

### 4、执行中相关问题的处理方法

(1) 计划管理人下达的指令必须要素齐全，词语准确，计划管理人下达的指令要素不全或语意模糊的，计划托管人有权附注相应的说明后立即将指令退给计划管理人，要求其重新下达有效的指令。

(2) 计划托管人因故意或重大过失错误执行指令或未及时执行指令, 致使本计划资产的利益受到损害, 应负赔偿责任。除此之外, 托管人对执行管理人的合法指令对计划造成的损失不承担赔偿责任。

(3) 计划管理人在发送指令时, 应为计划托管人执行指令留出执行指令时所必需的时间。管理人每日的场外投资付款指令应尽力于 T-1 日传真至托管人。如管理人要求当天某一时点到账, 则交易结算指令及其证明材料最迟需提前 2 个工作小时发送并与托管人进行电话确认。

由于通过上交所固定收益证券综合电子平台达成的私募债券转让, 中国证券登记结算公司上海分公司根据证券交易所发送的转让成交结果办理实时逐笔全额结算 (RTGS)。RTGS 的最终交收时点为 T 日的 15:40, 为保证 RTGS 交易成功, 管理人应于交易 T 日的 15:00 之前, 将买入私募债券的指令传至托管人。(非担保交收业务联系人: 李国强 010-63639184; 周晓漫 010-63639155; 传真 010-63639145、46、47)

由于通过深圳综合协议平台的公司债、私募债, 结算方式为逐笔全额非担保交收, 最终交收时点为 T 日 15:50, 因此管理人应于 T 日 15:30 之前向托管人发送非担保交收债券的买入指令。指令及其证明材料传输不及时, 未能留出足够的执行时间, 致使指令未能及时执行, 所造成的损失由计划管理人承担。

(4) 对非金融衍生品, 计划管理人应确保计划的银行存款账户有足够的资金余额, 确保计划的证券账户有足够的证券余额; 对金融衍生品, 通过操作备忘录的形式另行协商。对超头寸的指令, 以及超过证券账户证券余额的指令, 托管人可不予执行, 由此造成的损失, 由计划管理人负责赔偿。

#### (四) 更换投资指令被授权人的程序;

1、计划管理人若对授权通知的内容进行修改 (包括但不限于有权发送指令人员的名单、联系方式的修改, 指令上预留印鉴和签字样本的修改等), 应当至少提前 1 个工作日通知计划托管人; 修改授权通知的文件应为变更后的完整授权, 且由计划管理人加盖公章。计划管理人对变更后的完整授权应当以传真的形式或其他双方一致认可的方式发送给计划托管人, 同时电话通知计划托管人。计划管理人对授权通知的内容的修改自计划托管人电话确认后生效, 计划管理人在应在此后三个工作日内将对授权通知修改的文件原件送交计划托管人。

2、计划托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式，应至少提前1个工作日以传真方式或其他双方一致认可的方式发送计划管理人。计划托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式自计划管理人电话确认后生效。

#### （五）投资指令的保管

投资指令由管理人保存20年以上。

**变更为：**

#### （一）交易清算授权

1、管理人应当事先向托管人发出书面授权通知，向托管人提供指令的预留印鉴样本和签字样本，并在授权通知上载明管理人有权发送指令的人员名单及联系方式。管理人应指定至少两名以上的有权发送指令人员。

2、管理人向托管人发出的授权通知应加盖公章。托管人在收到授权通知后以约定方式确认。授权通知在托管人确认后才可生效。

3、管理人和托管人对授权通知及其更改负有保密义务，其内容不得向有权发送指令人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露，除非法律法规另有规定或监管部门另有要求。

#### （二）投资指令的内容

1、指令包括管理人在运作本集合计划资产时，向托管人发出的书面划款指令或其他双方一致认可形式的划款指令，包括付款指令（含退出、收益分配付款指令）及其他资金划拨指令等。

2、管理人发给托管人的有效划款指令应写明款项事由、支付时间、收付款人开户银行、金额、收付款人账户名称、账号等要素信息，加盖预留印鉴并由被授权人签字、相关的指令附件齐全且头寸充足的投资指令。

#### （三）投资指令的发送、确认和执行

##### 1、指令的发送

（1）管理人可选择电子或者传真/邮件等管理人和托管人双方认可的方式向托管人发送投资指令，并与托管人进行确认。因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时清算所造成的损失，由管理人承担。

电子指令模式：管理人通过深证通、托管网银或管理人和托管人双方认可电子渠道发送电子指令给托管人，并与托管人进行确认。

传真/邮件指令模式：管理人将有效投资指令及划款证明材料以传真或电子邮件的形式发送给托管人。投资指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、支付金额、收付款账户信息等，并加盖授权签发人预留名章、审批人预留名章及投资指令签发业务章。管理人有义务在发送指令后与托管人以电话的方式进行确认。托管人依照本合同约定对指令进行验证确认指令有效并根据本合同约定进行审核后，方可执行指令。

（2）托管人应指定专人接收管理人的指令，并预先通知管理人接收人名单和联系方式。

## 2、指令的确认

（1）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一致性审查，如发现问题，应及时通知管理人。经确认的指令，管理人不得否认其效力，但如果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，管理人不承担责任。

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

（3）托管人收到划款指令后，应根据本合同约定，审核管理人的划款指令。托管人对划款指令以及管理人提交的与划款指令相关的所有材料进行一致性审核。

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合同约定的投资方向一致。

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

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；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。

### 3、指令的执行

- (1) 托管人确认指令有效后，方可执行指令。
- (2) 托管人在复核后应在规定期限内执行适当的指令，不得延误。托管人发现管理人的指令违反法律法规规定或者本合同约定的，应当要求改正，未能改正的，应当拒绝执行，并向证券公司住所地中国证监会派出机构报告。
- (3) 相关登记结算机构向托管人发送的结算通知视为管理人向托管人发出的有效指令，托管人应予以执行。

### 4、执行中相关问题的处理方法

- (1) 管理人下达的指令必须要素齐全，词语准确，管理人下达的指令要素不全或语意模糊的，托管人有权附注相应的说明后立即将指令退还给管理人，要求其重新下达有效的指令。
- (2) 托管人因故意或重大过失错误执行指令或未及时执行指令，致使本集合计划资产的利益受到损害，应负赔偿责任。除此之外，托管人对执行管理人的合法指令对计划造成的损失不承担赔偿责任。
- (3) 管理人在发送指令时，应为托管人执行指令留出执行指令时所必需的时间。管理人每日的场外投资付款指令应尽力于 T-1 日传真至托管人。如管理人要求当天某一时点到账，则交易结算指令及其证明材料最迟需提前 2 个工作小时发送并与托管人进行电话确认。

由于通过上交所固定收益证券综合电子平台达成的私募债券转让，中国证券登记结算公司上海分公司根据证券交易所发送的转让成交结果办理实时逐笔全额结算 (RTGS)。RTGS 的最终交收时点为 T 日的 15:40，为保证 RTGS 交易成功，管理人应于交易 T 日的 15:00 之前，将买入私募债券的指令传至托管人。(非担保交收业务联系人：李国强 010-63639184；周晓漫 010-63639155；传真 010-63639145、46、47)

由于通过深圳综合协议平台的公司债、私募债，结算方式为逐笔全额非担保交收，最终交收时点为 T 日 15:50，因此管理人应于 T 日 15:30 之前向托管人发送非担保交收债券的买入指令。指令及其证明材料传输不及时，未能留出足够的

执行时间，致使指令未能及时执行，所造成的损失由管理人承担。

（4）对非金融衍生品，管理人应确保本集合计划的银行存款账户有足够的资金余额，确保本集合计划的证券账户有足够的证券余额；对金融衍生品，通过操作备忘录的形式另行协商。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指令，托管人可不予执行，由此造成的损失，由管理人负责赔偿。

#### （四）更换投资指令被授权人的程序

1、管理人若对授权通知的内容进行修改（包括但不限于有权发送指令人员的名单、联系方式的修改，指令上预留印鉴和签字样本的修改等），应当至少提前1个工作日通知托管人；修改授权通知的文件应为变更后的完整授权，且由管理人加盖公章。管理人对变更后的完整授权应当以传真的形式或其他双方一致认可的方式发送给托管人，同时电话通知托管人。管理人对授权通知的内容的修改自托管人电话确认后生效，管理人在应在此后三个工作日内将对授权通知修改的文件原件送交托管人。

2、托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式，应至少提前1个工作日以传真方式或其他双方一致认可的方式发送管理人。托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式自管理人电话确认后生效。

#### （五）投资指令的保管

投资指令由管理人保存20年以上。

**七、原合同“十九、资产管理计划的估值和会计核算”中“12、资产管理计划份额净值的确认”部分，**

**原：**

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。由此给资产委托人或资产管理计划造成损失的由资产管理人承担责任。

**变更为：**

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。由此给委托人或本集合计划造成损失的由管理人承担责任。

## 八、原合同“二十、资产管理计划的费用与税收”中“1、管理人管理费计提和支付”部分，

**原：**

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费率为0.40%/年。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div 365$$

H 为每日应计提的管理费；

E 为前一自然日集合计划资产净值。

**变更为：**

本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费率为0.400%/年，管理人可通过公告形式下调管理费率。计算方法如下：

$$H = E \times 0.400\% \div 365$$

H 为每日应计提的管理费；

E 为前一自然日集合计划资产净值。

## 九、原合同“二十一、资产管理计划的收益分配”中“（四）收益分配方案的确定、通知和实施”部分，

**原：**

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，由管理人告知委托人。管理人应在指定网站提前公告收益分配方案。管理人应在收益分配日根据收益分配方案实施收益分配。

**变更为：**

本集合计划收益分配方案由管理人拟定，由管理人报告委托人。管理人应在指定网站提前公告收益分配方案。管理人应在收益分配日根据收益分配方案实施收益分配。

收益分配。

**十、原合同“二十七、资产管理合同的效力”中“(二) 资产管理合同的生效条件”部分，**

**原：**

对于在本合同生效之前已经签署编号为“光银托管北分 2019QS041-1”、“光银托管北分 2021QS025-1”、“光银托管北分 2019QS041-2-补 03-资管”、“光银托管北分 2019QS041-2-补 04-资管”、“光银托管北分 2019QS041-2-补 05-资管”、“光银托管北分 2019QS041-2-补 06-资管”、“光银托管北分 2019QS041-2-补 07-资管”的《首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划资产管理合同》(简称“原合同”)的投资者而言，投资者根据管理人征询公告要求就是否同意合同变更作出意见表示同意，管理人负有核实投资者是否同意的义务，托管人按照管理人提供核实信息履行托管义务；且管理人发布合同变更生效公告后，即视为有效签署本合同，本合同成立，原合同作废。

**变更为：**

对于在本合同生效之前已经签署编号为“光银托管北分 2019QS041-1”、“光银托管北分 2021QS025-1”、“光银托管北分 2019QS041-2-补 03-资管”、“光银托管北分 2019QS041-2-补 04-资管”、“光银托管北分 2019QS041-2-补 05-资管”、“光银托管北分 2019QS041-2-补 06-资管”、“光银托管北分 2019QS041-2-补 07-资管”、“光银托管北分 2019QS041-2-补 08-资管”的《首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划资产管理合同》(简称“原合同”)的投资者而言，投资者根据管理人征询公告要求就是否同意合同变更作出意见表示同意，管理人负有核实投资者是否同意的义务，托管人按照管理人提供核实信息履行托管义务；且管理人发布合同变更生效公告后，即视为有效签署本合同，本合同成立，原合同作废。

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

2024 年 10 月 18 日