

首创证券创赢 37 号集合资产管理计划变更合同条款说明六

《首创证券创赢 37 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“一、前言”部分,

原:

本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。当事人按照《指导意见》《管理办法》《运作规定》《个人信息保护法》《首创证券创赢 37 号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

变更为:

本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。当事人按照《指导意见》《管理办法》《运作规定》《个人信息保护法》《首创证券创赢 37 号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务,托管协议中如有与本合同表述不一致之处,以本合同约定为准。

二、原合同“二、释义”部分,

新增:

业绩报酬核算日:指业绩报酬调整日或业绩报酬计提日;

三、原合同“三、承诺与声明”部分,

原:

2、投资者承诺以真实身份参与集合计划,财产的来源及用途符合国家有关规定,未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划,且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。投资者承诺,如委托资金为资产管理产品募集的资金时,将确保资产管理产品的投资者中不包含其他资产管理产品。如委托资金为除公募资产管理产品外的合伙企业、契约等非法人形式,最终投资者满足法律法规、监管规则规定的合格投资者要求,并向管理人充分披露实

际投资者和最终资金来源，保证所提供文件真实、准确、完整、合法。投资于本集合计划的资产管理产品未开展或者参与具有滚动发行、集合运作、分离定价特征的资金池业务。

变更为：

2、投资者承诺以真实身份参与集合计划，财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。投资者承诺，如受托资金为资产管理产品募集的资金时，将确保资产管理产品的投资者中不包含其他资产管理产品。如受托资金为除公募资产管理产品外的合伙企业、契约等非法人形式，最终投资者满足法律法规、监管规则规定的合格投资者要求，并向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源，保证所提供文件真实、准确、完整、合法。投资于本集合计划的资产管理产品未开展或者参与具有滚动发行、集合运作、分离定价特征的资金池业务。

四、原合同“四、当事人及权利义务”部分，

原：

(1) 委托人应认真阅读并遵守本合同及《说明书》，承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；

变更为：

(1) 委托人应认真阅读并遵守本合同及《说明书》，承诺受托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；

原：

1、管理人简况

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

联系电话：010-81152000

变更为：

1、管理人简况

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：李奕莹

联系电话：010-81152285

原：

（34）按照我国有关反洗钱法律、行政法规，履行客户身份识别反洗钱义务，识别、核实资产委托人的身份及资产管理计划的受益所有人，并按监管规定保存相关身份信息、资料；在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分，对高风险的客户采取适当的风控措施；在法律允许范围内，配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作，并提供必要客户信息、资料等；履行大额交易和可疑交易报告义务，并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规，要求资产委托人积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序。

变更为：

（34）按照我国有关反洗钱法律、行政法规，履行客户身份识别反洗钱义务，识别、核实资产委托人的身份及资产管理计划的受益所有人，并按监管规定保存相关身份信息、资料；在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分，对高风险的客户采取适当的风控措施；在法律允许范围内，配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作，并提供必要客户信息、资料等；履行可疑交易报告义务，并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规，要求资产委托人积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序。

原：

1、托管人简况

名称：广发银行股份有限公司

地址：北京市东城区东长安街甲 2 号广发银行大厦

法定代表人或负责人：王凯

邮政邮编：100731

业务联系人：李萌

联系电话：010-65169086

传真：010-65169555

变更为：

1、托管人简况

名称：广发银行股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街 15 号鑫茂大厦北楼

法定代表人或负责人：王凯

邮政邮编：100731

业务联系人：卢晓晨

联系电话：010-65169644

传真：010-65169555

五、原合同“五、资产管理计划的基本情况”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。

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%。

原：

2、托管费

本集合计划托管费为 0.05%/年。

3、管理费

本集合计划管理费为 0.60%/年。

4、退出费

本集合计划退出费为 0.00%。

变更为：

2、托管费

本集合计划托管费为 0.050%/年。

3、管理费

本集合计划管理费为 0.600%/年。

4、退出费

本集合计划除违约退出外，退出费为 0.00%。

六、原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”部分，

原：

本集合计划每 12 个月开放一次，若开放日遇法定节假日、休息日等则自动顺延至下一交易日。具体的开放安排以管理人公告为准。

变更为：

本集合计划每 18 个月开放一次，开放期为 1 个交易日，具体以管理人公告为准，开放期内接受投资者参与和退出申请。除上述开放期开放参与外，本集合计划自运作周期起始运作日起（运作周期起始日视为第 1 个自然日）的第 7 个自然日开放参与申请，当日不受理退出申请，开放期为 1 个交易日，若开放期遇法定节假日、休息日等则顺延至下一交易日，具体参与开放期届时以管理人公告为准。

原：

本合同可以在合同变更等符合监管规定的条件下设置临时开放期。临时开放期的触发条件、程序及披露的相关安排详见“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”。

变更为：

本合同可以在合同变更等符合监管规定的条件下设置临时开放期。临时开放期的触发条件、程序及披露的相关安排详见“资产管理合同的变更、终止与财产清算”章节。

原：

2、退出费用

本集合计划无退出费。

变更为：

2、退出费用

本集合计划除违约退出外，无退出费。

原：

2、退出金额计算

退出金额=T 日计划单位净值（扣除业绩报酬及分红后）×退出份额

变更为：

2、退出金额计算

退出金额=申请退出份额×申请退出日集合计划单位净值-业绩报酬（如有）-退出费用（如有）

原：

2、自有资金参与的金额和比例

管理人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 20%，证券期货经营机构及其子公司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%。为应对本集合计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出本集合计划可不受“1、自有资金参与及退出的条件”和“2、自有资金参与的金额和比例”规定的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

变更为：

2、自有资金参与的金额和比例

管理人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 40%，证券期货经营机构及其子公司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%。为应对本集合计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出本集合计划可不受“1、自有资金参与及退出的条件”和“2、自有资金参与的金额和比例”规定的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

新增：

（十七）违约退出的情形及处理

1、违约退出的认定与适用情形

投资者如在本集合计划存续期间的非退出开放日退出计划，为投资者违约，属于违约退出。违约退出条款主要适用于投资者身患重疾、突发意外等急需使用资金的情形。

2、违约退出的处理

（1）违约退出的程序。

投资者违约退出的，需向管理人提供书面违约退出申请文件及其他相关材料。管理人审核同意后，由本计划注册登记机构直接办理或由销售机构代为办理违约退出申请。投资者违约退出的具体程序以及办理违约退出业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同和说明书的前提下，以各销售机构的具体规定为准。投资者违约退出的具体份额以注册登记机构的确认结果为准。

（2）违约退出的价格。

违约退出的价格为管理人审核同意后、注册登记机构或销售机构正式受理违约退出申请当日的计划份额净值。

（3）业绩报酬的计提。

投资者违约退出时，管理人依据本合同的约定计提业绩报酬。

（4）违约退出费用的计算。

投资者违约退出的，应支付净退出金额(扣除管理费、托管费等费用和应计

提的业绩报酬后的实际退出金额)的1%作为违约退出费用,违约退出费用全额归入集合计划财产,于违约退出时一次性支付。

违约退出费用的具体计算公式如下:

违约退出费用=(违约退出的份额×违约退出的价格-应计提的业绩报酬)×违约退出费率

违约退出时,投资者实际取得的退出金额的计算公式如下:

实际取得的退出金额=违约退出的份额×违约退出的价格-应计提的业绩报酬-违约退出费用

上述涉及违约退出金额的计算结果均保留到小数点后两位,小数点后第三位四舍五入,由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。

3、违约退出的原则

- (1) 不得违反法律、行政法规和中国证券监督管理委员会的相关规定;
- (2) 不得违反本合同中的相关约定;
- (3) 不得损害其他份额持有人的利益,不得损害剩余的集合计划的资产权益;
- (4) 违约退出业务必须经资产管理计划的持有人申请,经管理人内部审核通过后方可予以办理。管理人经审核后认为违约退出业务可能存在违反法律法规、监管政策以及本合同约定的,有权拒绝办理。

4、本合同关于违约退出条款的约定不代表投资者一定可以在非退出开放日退出本计划,在违约退出违背法律法规、监管政策和本合同约定、损害其他份额持有人的利益、损害剩余集合计划的资产权益以及其他管理人认为不适宜办理违约退出的情形下,管理人均有权拒绝办理投资者的违约退出申请。

七、原合同“十一、资产管理计划的投资”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。

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%。

新增：

本资产管理计划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得超过本资产管理计划资产净值的 20%。流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。

八、原合同“十四、利益冲突及关联交易”部分，

原：

②资产管理产品的重大关联交易包括：

投资交易对手或投资标的为产品关联方，且单笔结算金额占该资产管理计划上一日资产净值的比例达到 20%（不含）以上的，构成重大关联交易。

前述交易不包括以下情形：

投资于银行存款、同业存单、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等现金管理类投资品种涉及的相关交易。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按监管最新规定履行。

变更为：

②资产管理产品的重大关联交易包括：

投资交易对手或投资标的为产品关联方，且单笔结算金额占该资产管理计划上一日资产净值的比例达到 20%（不含）以上的，构成重大关联交易。

相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按监管最新规定履行。

九、原合同“十六、资产管理计划的财产”部分，

原：

2、本集合计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管

理的和托管人托管的其他财产。管理人和托管人不得将本集合计划财产归入其固有财产。

变更为：

2、本集合计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人和托管人不得将本集合计划财产归入其固有财产。因为管理人投资产生的存放或存管在托管人以外机构的受托财产，由相应的保管机构承担保管职责，管理人应审慎选择保管机构。

十、原合同“十九、资产管理计划的估值和会计核算”部分，

原：

12、资产管理计划份额净值的确认

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：

12、资产管理计划份额净值的确认

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。

十一、原合同“二十、资产管理计划的费用与税收”部分，

原：

1、管理人管理费计提和支付

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0.60%/年。计算方法如下：

$$H=E\times 0.60\%\div 365$$

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：

1、管理人管理费计提和支付

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 0.600%/年，管理人可通过公告形式下调管理费率。计算方法如下：

$$H=E\times 0.600\%\div 365$$

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。

原：

托管费收入账户：

户 名：同业托管业务收入

账 号：5102730000

开户银行：广发银行股份有限公司北京分行

变更为：

托管费收入账户：

户 名：其他应付账款-待划转手续费

账 号：13700215626119000000014

开户银行：广发银行股份有限公司北京分行

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

管理人将在每个运作周期开始前公布该运作周期的业绩报酬计提基准。在本集合计划存续过程中，在符合业绩报酬计提条件时，管理人可以在集合计划收益分配日（分红日）、投资者退出日和集合计划终止日计提业绩报酬。在集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；在投资者退出和集合计划

终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。以上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，则为本集合计划成立日）至本次业绩报酬计提日的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准，按照业绩报酬计提基准以上部分的 60%提取业绩报酬，具体提取方式如下：

$$R = (A - B) / C * 365 / D$$

其中，A 为业绩报酬计提日的累计单位净值；

B 为上一个业绩报酬计提日的累计单位净值；

C 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

D 为上一业绩报酬计提日与本次业绩报酬计提日间隔天数。若管理人于某个业绩报酬计提日未实际计提业绩报酬（即业绩报酬为 0），则该日仍然作为管理人下一次业绩报酬计提起始日。

年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬计提方法
$R \geq \text{业绩报酬计提基准}$	60%	$H = \text{【}R - \text{业绩报酬计提基准}\text{】} \times 60\% \times C \times F \times D / 365$
$R < \text{业绩报酬计提基准}$	0	$H = 0$

注：F 为提取业绩报酬的份额

由于涉及注册登记数据，由管理人计算并复核。

管理人收取业绩报酬按委托人参与份额计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

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。

上述管理人业绩报酬计入管理费。

（2）业绩报酬支付时间

每个自然季度起 10 个工作日内或产品终止时，管理人有权全额提取当期计提的业绩报酬（如有），具体以管理人安排和计算为准。支付时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时，支付日期顺延。

由于涉及份额注册登记，业绩报酬的计算和复核由管理人完成，托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。

管理人有权修改业绩报酬计提基准，管理人应于新的业绩报酬计提基准启用前至少三个工作日在管理人指定网站公告。业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的计算使用，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。

变更为：

3、业绩报酬的计提和支付

(1) 管理人收取业绩报酬的原则

①本集合计划对投资者持有的集合计划份额进行业绩报酬计提；

②同一投资者不同时间多次参与集合计划，本集合计划对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；

③在符合业绩报酬计提条件时，在集合计划分红日、投资者退出日和集合计划终止日计提业绩报酬；管理人从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次；

④在集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除，在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除；

⑤集合计划分红时，业绩报酬按投资者集合计划分红时持有的份额进行核算。

⑥投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或集合计划终止时持有份额进行核算。

⑦管理人有权于集合计划份额发行前公告业绩报酬计提基准等规则。

⑧业绩报酬提取原则：

1) 当集合计划份额年化收益率 $R \leq$ 业绩报酬计提基准 r 时，则管理人不得提取业绩报酬；

2) 当集合计划份额年化收益率 $R >$ 业绩报酬计提基准 r 时，管理人对年化收益率超过业绩报酬计提基准的收益部分收取 60% 作为业绩报酬；

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

其中：

$$R=[(PA-PC)/PC*]\times(365/N)\times 100\%$$

F: 投资者每笔认购/存续期参与集合计划份额应提取的业绩报酬;

R: 该笔认购/存续期参与份额的年化收益率;

r: 业绩报酬计提基准

PA: 本次发生业绩报酬计提日累计单位净值;

PC: 上一个发生业绩报酬计提日的累计单位净值;

PC*: 上一个发生业绩报酬计提日的单位净值;

C: 投资者每笔认购/存续期参与的集合计划份额在上一个发生业绩报酬计提日的资产净值总额;

N: 上一个发生业绩报酬计提日到本次发生业绩报酬计提日的天数。

业绩报酬计提日为本集合计划分红确认日、退出确认日和计划终止确认日。业绩报酬的计提,以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准。上一个业绩报酬计提基准日,如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提,认购所得的份额,以本集合计划成立日份额面值为准;参与所得的份额,以参与申请对应日份额净值为准;委托人退出时,按照“先进先出”法,分别计算每一笔认购/参与应收的管理人业绩报酬。

上述管理人业绩报酬计入管理费。

(2) 业绩报酬的支付

每个自然季度起 10 个工作日内或产品终止时,管理人有权全额提取当期计提的业绩报酬(如有),具体以管理人安排和计算为准。支付时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令,托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时,支付日期顺延。

由于涉及份额注册登记,业绩报酬的计算和复核由管理人完成。托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。

管理人有权修改业绩报酬计提基准,管理人应于新的业绩报酬计提基准启用前至少三个工作日在管理人指定网站公告。新的业绩报酬计提基准生效后,所有投资者均按照计提业绩报酬时点对应的业绩报酬计提基准,计算整个持有期的业绩报酬,不同意业绩报酬计提基准变更的投资者可在基准变更生效前的(临时)

开放日按原业绩报酬计提基准申请退出。业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的计算使用，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。

十二、原合同“二十一、资产管理计划的收益分配”部分，

新增：

本集合计划收益分配方案依据现行法律法规以及合同约定执行，具体方案如下：

十三、原合同“二十二、信息披露与报告”部分，

新增：

本集合计划的信息披露应符合《指导意见》《管理办法》《运作规定》及相关自律规则的规定。如中国证监会、中国基金业协会更新了相关信息披露规则或制定了其他相关规则，则从其规则执行。

十四、原合同“二十三、风险揭示”部分，

新增：

本集合计划面临包括但不限于以下风险：

十五、原合同“二十五、违约责任”中，

原：

8、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者资产委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，但不因各自职责以外的事由与其他当事人承担连带赔偿责任；管理人、托管人因共同行为给计划财产或委托人造成损害的，应当根据各自的过错程度承担相应的赔偿责任。

变更为：

8、管理人、托管人因共同行为给本集合财产或委托人造成损害的，应当根据各自的过错程度承担相应的赔偿责任。

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

2025 年 5 月 30 日