

首创证券创赢 4 号集合资产管理计划

变更合同条款说明十

我司近期拟对《首创证券创赢 4 号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、资产管理合同中“委托资金”、“委托财产”、“委托资产”变更为“受托资金”、“受托财产”、“受托资产”。

二、资产管理合同“四、当事人及权利义务”中：

“(二) 管理人”的“3、管理人的义务”中，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，履行客户尽职调查反洗钱义务，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；在客户尽职调查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尽职调查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。

三、资产管理合同"五、资产管理计划的基本情况"中：

"(五) 资产管理计划投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级"的 "3、投资比例" 中，删除：

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%。

四、资产管理合同"八、资产管理计划的参与、退出与转让"中：

原：

(二) 参与和退出的开放日及时间

投资者可在本集合计划开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本集合计划，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。

本集合计划每 12 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。

(三) 临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

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：

(二) 参与和退出的开放日及时间

投资者可在本集合计划开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本集合计划，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。

本集合计划每 18 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。

（三）临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

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：

（七）参与份额与退出金额的计算方式

1、参与份额计算

$$\text{参与份额} = \text{参与金额} \div \text{参与日计划单位净值}$$

委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

2、退出金额计算

$$\text{退出金额} = \text{申请退出份额} \times \text{申请退出日集合计划单位净值} - \text{业绩报酬(如有)} \\ - \text{退出费用(如有)}$$

退出金额的计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。

变更为：

（七）参与份额与退出金额的计算方式

1、参与份额计算

$$\text{参与份额} = \text{参与金额} \div \text{参与日计划单位净值}$$

委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

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

退出金额的计算结果保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入集合计划财产。多笔退出时，按上述公式进行逐笔计算。

“(十六)自有资金参与集合计划”的“2、自有资金参与的金额和比例”中，原：

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%。

变更为：

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%。

五、资产管理合同"十一、资产管理计划的投资"中：

“(二)投资范围及比例”的“2、资产配置比例及限制”中，删除：

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%。

“(十二)资产组合的流动性与参与、退出安排”的“2、资产配置比例及限制”中，删除：

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。

六、资产管理合同新增"十八、交易及清算交收安排"中：

(一) 交易单元安排

管理人负责安排专用交易单元用于各集合计划的投资运作，并将用于集合计划交易的专用交易单元向证券交易所、注册登记机构备案。

所有本集合计划在交易所的投资交易活动，应当集中在专用交易单元上。管理人应及时将集合计划专用交易单元、佣金费率等基本信息以及变更情况以书面形式通知资产托管人。

(二) 投资交易所证券及银行间市场的清算交收安排

资产管理人和资产托管人在受托财产场内清算交收及相关风险控制方面的职责按照《托管银行证券资金结算协议》的要求执行。

为有效控制交易结算风险，委托人及管理人知悉并授权托管人向中国证券登记结算有限责任公司报送融资主体相关信息及用于交易资金前端控制的相关数据信息。托管人依据与管理人核对一致的受托财产估值信息向中国证券登记结算有限责任公司报送上述数据信息。托管人按照规则报送了资金前端控制额度后，管理人因超额度导致的交易失败所造成的损失由管理人承担。

七、资产管理合同"二十一、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" 中，原：

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 $R \leqslant$ 业绩报酬计提基准 r 时，则管理人不提取业绩报酬；

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；追加所得的份额，以追加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/追加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，所有投资者退出时均按照退出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**

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

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%	$H = [(R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 60\% \times C \times F] / 365$
$R < \text{业绩报酬计提基准}$	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。

八、资产管理合同"二十三、信息披露与报告"中：

原：

(一) 定期报告

定期报告包括本集合计划单位净值、本集合计划的资产管理季度（年度）报告和托管人履职报告、年度审计报告。

1、资产管理计划单位净值披露

披露时间：每交易日披露经托管人复核的上一交易日集合计划的单位净值。

披露方式：管理人及销售机构指定网站。

2、资产管理计划季度报告

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。

资产管理计划季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，上述报告应于每季度截止日后 30 日内通过管理人指定网站通告，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季度报告。

3、资产管理计划年度报告

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。

资产管理计划年度报告由管理人编制，托管人复核，由管理人公告，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。

4、托管人履职报告

托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作，确定托管人履职报告内容并用印后向管理人反馈，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。

管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 10 日内向管理人反馈复核意见。管理人应当在每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。

因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

5、年度审计报告

管理人进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本集合计划出具单项审计意见。管理人在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告通过管理人指定网站向委托人提供。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人可不提供审计报告。

管理人应当将审计结果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。

变更为：

（一）定期报告

定期报告包括本集合计划单位净值、本集合计划的资产管理季度（年度）报告和托管人履职报告、年度审计报告。

1、资产管理计划单位净值披露

披露时间：至少每周披露一次经托管人复核的集合计划的单位净值。

披露方式：管理人及销售机构指定网站。

2、资产管理计划季度报告

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。

资产管理计划季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，上述报告应于每季度截止日后 30 日内通过管理人指定网站通告，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季度报告。

3、资产管理计划年度报告

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。

资产管理计划年度报告由管理人编制，托管人复核，由管理人公告，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。

4、托管人履职报告

托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作，确定托管人履职报告内容并用印后向管理人反馈，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。

管理人应当在每季度结束后20日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告(如有)供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于10日内向管理人反馈复核意见。管理人应当在每年度结束后三个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。

因资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

5、年度审计报告

管理人进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本集合计划出具单项审计意见。管理人在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告通过管理人指定网站向委托人提供。

管理人应当将审计结果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管理协会的要求进行备案、报送。

九、资产管理合同"二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算"中：

原：

（四）资产管理计划的清算

自集合计划终止之日起 5 个工作日内开始组织清算资产管理计划资产，以及财产清算的有关事项：

1、成立资产管理计划清算小组

（1）本集合计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）本集合计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。管理人负责资产管理计划财产的清算、估价、变现和分配，托管人负责资产管理计划财产的保管，执行管理人分配指令划付资金。

清算过程中的有关重大事项应当及时公布。

2、资产管理计划清算程序

（1）资产管理计划终止日后 5 个工作日内启动清算程序，并由集合计划清算小组将终止事项向委托人披露；

（2）集合计划清算小组统一接管集合计划资产；

（3）集合计划清算小组对集合计划资产进行清理和确认；

（4）集合计划清算小组对集合计划资产进行估价；

-
- (5) 集合计划清算小组对集合计划资产进行变现；
 - (6) 集合计划清算小组出具集合计划清算报告；
 - (7) 集合计划清算小组披露集合计划清算报告；
 - (8) 清算报告披露后 5 个工作日内进行集合计划剩余资产的分配；
 - (9) 集合计划清算小组注销集合计划相关账户。

3、资产管理计划清算费用

集合计划清算小组在进行清算过程中发生的所有合理费用（如：清算审计费用等），清算费用由集合计划清算小组优先从集合计划财产中支付。

4、资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

依据本集合计划财产清算的分配方案，将清算后的全部剩余资产扣除清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按本集合计划份额持有人持有的份额比例进行分配。

5、资产管理计划延期清算处理方式

资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应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。

6、资产管理计划财产清算报告的告知安排

清算过程中的有关重大事项须及时公告；资产管理计划财产清算报告经会计师事务所审计并报中国证券投资基金业协会备案并公告。资产管理计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证券投资基金业协会备案后 5 个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告。

7、资产管理计划财产相关账户的注销

资产管理计划财产清算完毕后，托管人及管理人应按照交易所、银行的有关规定注销托管资金专门账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。

8、资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。

9、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给委托人。监管政策允许的情况下，管理人也可以将未变现资产按照委托人持有份额的比例分配给委托人，具体事宜以管理人公告为准。

变更为：

（四）资产管理计划的清算

自集合计划终止之日起 5 个工作日内开始组织清算资产管理计划资产，以及财产清算的有关事项：

1、成立资产管理计划清算小组

（1）本集合计划财产清算小组成员由管理人和托管人组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

（2）本集合计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。管理人负责资产管理计划财产的清算、估价、变现和分配，托管人负责资产管理计划财产的保管，执行管理人分配指令划付资金。

清算过程中的有关重大事项应当及时公布。

2、资产管理计划清算程序

（1）资产管理计划终止日后 5 个工作日内启动清算程序，并由集合计划清算小组将终止事项向委托人披露；

（2）集合计划清算小组统一接管集合计划资产；

（3）集合计划清算小组对集合计划资产进行清理和确认；

（4）集合计划清算小组对集合计划资产进行估价；

-
- (5) 集合计划清算小组对集合计划资产进行变现；
 - (6) 集合计划清算小组出具集合计划清算报告；
 - (7) 集合计划清算小组披露集合计划清算报告；
 - (8) 集合计划清算小组进行集合计划剩余资产的分配；
 - (9) 集合计划清算小组注销集合计划相关账户。

3、资产管理计划清算费用

集合计划清算小组在进行清算过程中发生的所有合理费用（如：清算审计费用等），清算费用由集合计划清算小组优先从集合计划财产中支付。

4、资产管理计划财产清算及剩余资产的分配

依据本集合计划财产清算的分配方案，将清算后的全部剩余资产扣除清算费用、交纳所欠税款并清偿集合计划债务后，按本集合计划份额持有人持有的份额比例进行分配。

5、资产管理计划延期清算处理方式

资产管理计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应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。

6、资产管理计划财产清算报告的告知安排

清算过程中的有关重大事项须及时公告。清算小组在本集合计划终止后编制资产管理计划财产清算报告，资产管理计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证券投资基金业协会备案后 5 个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告。除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的，上述报告不再另行审计。

7、资产管理计划财产相关账户的注销

资产管理计划财产清算完毕后，托管人及管理人应按照交易所、银行的有关规定注销托管资金专门账户、证券账户和期货账户等投资所需账户。

-
- 8、资产管理计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。
- 9、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可对此制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例或本合同的约定，以货币形式全部分配给委托人。监管政策允许的情况下，管理人也可以将未变现资产按照委托人持有份额的比例分配给委托人，具体事宜以管理人公告为准。

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

2025 年 12 月 9 日