

首创证券晋升 8 号集合资产管理计划变更合同条款说明

我司拟对《首创证券晋升 8 号集合资产管理计划资产管理合同》中的部分条款进行更改，条款更改涉及如下：

一、原合同“特别约定”中，原：

“特别约定：《首创证券晋升 8 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以电子签名方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人（首创证券晋升 8 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。”

变更为：

“特别约定：《首创证券晋升 8 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以电子签名或纸质方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人（首创证券晋升 8 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以电子签名或纸质方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。”

二、原合同“一、前言”中，原：

“1. 订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《指导意见》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称《运作规定》）、《集合资产管理计划管理合同内容与格式指引（试行）》、《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定。”

变更为：

“1. 订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《指导意见》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称《运作规定》）、《集合资产管理计划管理合同内容与格式指引（试行）》、《中华人民共和国个人信息保护法》（以下简称《个人信息保护法》）等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的有关规定。”

三、原合同“二、释义”中，新增：

“《个人信息保护法》：指 2021 年 8 月 20 日经第十三届全国人大常委会第三十次会议表决通过的《中华人民共和国个人信息保护法》；”

四、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；”

五、原合同“三、承诺与声明”中“（三）投资者声明”部分，原：

“1. 符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、

完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

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，并向管理人提供合法募集资金的证明文件、充分披露实际投资者和最终资金来源，保证所提供证明文件真实、准确、完整、合法。

3. 已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。”

变更为：

“1. 符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。

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。

3. 已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理

计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。

4. 投资者已充分知晓并同意管理人基于监管要求或为客户提供产品及服务需要处理个人信息。

5. 如由投资者提供第三方个人信息的，投资者承诺其提供的信息真实、准确、完整，并已取得相关信息主体的同意。

6. 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。

管理人、托管人及投资者已知晓并理解《个人信息保护法》第十七条规定的事项及个人在个人信息处理活动中的各项权利。”

六、原合同“四、当事人及权利义务”中“委托人”中“3、委托人的义务”部分，原：

“（1）委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并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；自然人不得用筹集的他人资金参与集合计划，法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或其他销售机构提供合法筹集资金的证明文件；”

变更为：

“（1）委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并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；”

七、原合同“四、当事人及权利义务”中“管理人”中“1、管理人简况”部分，原：

“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：北京市西城区德胜门外大街 115 号德胜尚城 E 座

邮政编码：100088

联系电话：(010) 59366000

联系人：马海霞

联系电话：010-59366214”

变更为：

“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

联系人：马海霞

联系电话：(010) 81152058”

八、原合同“四、当事人及权利义务”中“管理人”中“3、管理人义务”部分，新增：

“(32) 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。

(33) 遵守《个人信息保护法》的要求，遵守保密义务，采取必要的措施保障投资者个人信息的安全，并采取合理措施告知投资者其执行的个人信息保护政策。

(34) 管理人向其他个人信息处理者提供其处理的个人信息的，应当向个人告知接收方的名称或者姓名、联系方式、处理目的、处理方式和个人信息的种类，并取得个人的单独同意。受托个人信息处理者为国家机关或者法律、法规授权的具有管理公共事务职能的组织，且法律、行政法规规定应当保密或者不需要告知的情形的，管理人可以不向个人告知且无需经投资者单独同意。

(35) 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。

（36）采取了适当的措施，确保资产管理计划的委托人、受益所有人等不得为我国公安部等有权部门发布的恐怖活动组织及恐怖活动人员名单，不得为联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的反洗钱和反恐怖融资名单，或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单。

（37）资产管理计划的投资行为不得违反我国、联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的有关经济制裁或反洗钱法律法规，或用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途。”

九、原合同“四、当事人及权利义务”中“管理人”中“3、管理人义务”部分，删除：

“（32）确保本合同、说明书、托管协议及本集合计划相关文本相关约定保持一致。”

其余条款序号自动调整。

十、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”第（五）条“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：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）、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。

本计划投资单一标的债券的规模不超过该债券存续总规模的 15%，按成本计，也不超过本计划净资产的 15%，利率债不受此项限制。

(2) 债券正回购：融入资金余额不超过计划上一日净资产的 30%。

(3) 债券逆回购资金余额不得超过其上一日净资产的 100%。

(4) 本集合计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%。

(5) 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%，也不得超过该资产存续规模的 25%。本集合计划管理人管理的全部集合资管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。本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。

(6) 本集合计划不直接投资于商业银行信贷资产。

(7) 本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意。

委托人同意，在本资产管理计划存续期间，为规避固定收益产品单边下行风险、保护投资者合法权益，本产品投资于固定收益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：

“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：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）、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、超短期融资券如有债项评级则为 A-1 及以上。

本计划投资单一标的债券的规模不超过该债券存续总规模的 15%，也不超过本计划净资产的 15%，利率债不受此项限制。

(2) 债券正回购：融入资金余额不超过计划上一日净资产的 100%。

(3) 债券逆回购资金余额不得超过其上一日净资产的 100%。

(4) 本集合计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%。

(5) 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%，也不得超过该资产存续规模的 25%。本集合计划管理人管理的全部集合资管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。本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。

(6) 本集合计划不直接投资于商业银行信贷资产。

(7) 本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意。

委托人同意，在本资产管理计划存续期间，为规避固定收益类产品单边下行风险、保护投资者合法权益，本产品投资于固定收益类、现金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%。”

十一、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”第（十一）条“本集合计划的销售”中，原：

“管理人及销售机构应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式销售文件，以纸质资料方式置备于销售机构营业场所。销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大历史业绩和商业贿赂等不正当手段销售集合计划。”

变更为：

“销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大历史业绩和商业贿赂等不正当手段销售集合计划。”

十二、原合同“六、资产管理计划的募集”第（三）条“资产管理计划的认购事项”中，原：

“3、认购申请的确认

认购申请受理完成后，不得撤销。募集机构受理认购申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表募集机构确实收到了认购申请。认购的确认以管理人的确认结果为准。若认购不成功，投资者已交付的款项将于计划成立后五个工作日内，无利息地退还至投资者银行账户。”

变更为：

“3、认购申请的确认

认购申请受理完成后，不得撤销。募集机构受理认购申请并不表示对该申请成功的确认，而仅代表募集机构确实收到了认购申请。认购的确认以管理人的确认结果为准。若认购不成功，投资者已交付的款项将于认购确认失败后五个工作日内，无利息地退还至投资者银行账户。”

十三、原合同“七、资产管理计划的成立与备案”第（二）条“集合计划设立失败”中，原：

“集合计划初始募集期结束，在集合计划初始募集资金总额（不含参与费）低于中国证监会规定的集合资产管理计划最低募集规模（即人民币 1000 万元）或委托人的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败。管理人需以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并将已认购资金及银行同期活期存款利息在初始募集期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人。”

变更为：

“集合计划初始募集期结束，在集合计划初始募集资金总额（不含参与费）低于中国证监会规定的集合资产管理计划最低募集规模（即人民币 1000 万元）或委托人的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败。管理人需以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并将已认购资金及银行同期活期存款利息在初始募集期结束后 30 个自然日内退还集合计划委托人。”

十四、原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”第（十）条“单个委托人大额退出、巨额退出和连续巨额退出”中，原：

“1、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

（1）单个委托人大额退出的认定

对单个委托人单日退出份额超过上一工作日计划总份额数的 15%时，即视为单个委托人大额退出。如果大额退出情况触发巨额退出条件，按照巨额退出进行认定和处理。”

变更为：

“1、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

（1）单个委托人大额退出的认定

对单个委托人单日退出份额超过上一工作日计划总份额数的 10%时，即视为单个委托人大额退出。如果大额退出情况触发巨额退出条件，按照巨额退出进行认定和处理。”

十五、原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”第（十六）条“管理人自有资金参与集合计划”中，原：

“（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）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。”

十六、原合同“十一、资产管理计划的投资”第（二）条“投资范围及比例”中，原：

“（二）投资范围及比例

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、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）、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。

本计划投资单一标的债券的规模不超过该债券存续总规模的 15%，按成本计，也不超过本计划净资产的 15%，利率债不受此项限制。

(2) 债券正回购：融入资金余额不超过计划上一日净资产的 30%。

(3) 债券逆回购资金余额不得超过其上一日净资产的 100%。

(4) 本集合计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%。

(5) 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%，也不得超过该资产存续规模的 25%。本集合计划管理人管理的全部集合资管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。本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。

(6) 本集合计划不直接投资于商业银行信贷资产。

(7) 本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意。

委托人同意，在本资产管理计划存续期间，为规避固定收益产品单边下行风险、保护投资者合法权益，本产品投资于固定收益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%。

委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，本计划发生上述关联交易的，管理人应在交易完成后 10 个工作日告知委托人和托管人，并按照现行法律法规、自律规则向监管机构及自律组织报告。”

变更为：

“(二) 投资范围及比例

1、投资范围

本集合计划主要投资于固定收益类、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、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）、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、超短期融资券如有债项评级则为 A-1 及以上。

本计划投资单一标的债券的规模不超过该债券存续总规模的 15%，也不超过本计划净资产的 15%，利率债不受此项限制。

(2) 债券正回购：融入资金余额不超过计划上一日净资产的 100%。

(3) 债券逆回购资金余额不得超过其上一日净资产的 100%。

(4) 本集合计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%。

(5) 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%，也不得超过该资产存续规模的 25%。本集合计划管理人管理的全部集合资管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。本资产管理计划符合《运作规定》组合投资的要求。

(6) 本集合计划不直接投资于商业银行信贷资产。

(7) 本集合计划投资范围和比例如需发生变更，应事先取得投资者同意。

委托人同意，在本资产管理计划存续期间，为规避固定收益类产品单边下行风险、保护投资者合法权益，本产品投资于固定收益类、现金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%。

管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，本计划发生上述关联交易的，管理人应在交易完成后 10 个工作日告知委托人和托管人，并按照现行法律法规、自律规则向监管机构及自律组织报告。”

十七、原合同“十一、资产管理计划的投资”第（三）条“投资比例超限的处理方式及流程”中，原：

“（三）投资比例超限的处理方式及流程

本集合计划的建仓期为自产品成立之日起 6 个月的期限。本计划自投资运作期开始之日起 6 个月内使集合资产管理计划的投资组合比例符合上述资产组合比例的要求。建仓期的投资活动，应当符合资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。计划持有债券资产期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，管理人应在评级报告发布之日起且具备交易条件的 10 个工作日内予以全部卖出。

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：

“（三）投资比例超限的处理方式及流程

本集合计划的建仓期为自产品成立之日起 6 个月的期限。本计划自投资运作

期开始之日起 6 个月内使集合资产管理计划的投资组合比例符合上述资产组合比例的要求。建仓期的投资活动，应当符合资产管理合同约定的投向和资产管理计划的风险收益特征。以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。建仓期结束后，资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。计划持有债券资产期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，管理人应在评级报告发布之日起且具备交易条件的 10 个工作日内予以全部卖出。

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和现金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%。”

十八、原合同“十一、资产管理计划的投资”第（九）条“集合计划的预警和止损机制”中，原：

“（九）集合计划的预警和止损机制

1、本计划预警线为 0.9800 元

本计划存续期间，如果交易日（T 日）日终计划单位净值达到或低于预警线，管理人将在 T+1 日以邮件的方式向销售机构进行预警，并自计划单位净值达到或低于预警线的下一个交易日（T+1 日）起进行持仓调整，具体为：

本集合计划仅可进行卖出或赎回及相关的投资操作，不再进行买入或申（认）购及相关的投资操作。当本计划单位净值恢复到 1.0000 元（含）以上的下一个交易日起，本计划可恢复进行买入或申（认）购及相关的投资操作。

2、本计划止损线为 0.9600 元

本计划存续期间，在交易日（T 日）日终计划单位净值触及止损线，管理人

于下一个交易日（T+1 日）开始对本计划持有的全部非现金类资产进行变现，管理人有权根据变现情况择机终止本计划。”

变更为：

“（九）集合计划的预警和止损机制

1、本计划预警线为 0.9500 元

本计划存续期间，如果交易日（T 日）日终计划单位净值达到或低于预警线，管理人将以邮件的方式向销售机构进行预警，并自计划单位净值达到或低于预警线的下一个交易日（T+1 日）起进行持仓调整。

2、本计划止损线为 0.9000 元

本计划存续期间，在交易日（T 日）日终计划单位净值触及止损线，管理人于下一个交易日（T+1 日）开始对本计划持有的全部非现金类资产进行变现，管理人有权根据变现情况择机终止本计划。”

十九、原合同“十四、利益冲突及关联交易”中，原：

“2、存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率

（1）存在利益冲突的处理方式

集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

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，应事先取得投资者同意，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证券投资基金业协会报告。

集合计划份额持有人不得因本集合计划投资收益劣于集合计划管理人及其关联方管理的其他类似投资产品,而向集合计划管理人或集合计划托管人提出任何损失或损害补偿的要求。”

变更为:

“2、存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率

(1) 存在利益冲突的处理方式

集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券,但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

集合计划管理人可运用集合计划财产买卖集合计划管理人、集合计划托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循集合计划份额持有人利益优先的原则、防范利益冲突。

管理人从事关联交易的,应提前二十个工作日公告并取得投资者同意(卖出、赎回关联证券或管理方管理的资产管理产品的除外);从事重大关联交易的,还应有充分证据证明未损害投资者利益。管理人事后应及时、全面、客观的向投资者和托管人进行披露并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重大关联交易情况。如投资者不同意管理人关联交易的,管理人将放弃开展关联交易(卖出、赎回关联证券或管理方管理的资产管理产品的除外)。

集合计划份额持有人不得因本集合计划投资收益劣于集合计划管理人及其关联方管理的其他类似投资产品,而向集合计划管理人或集合计划托管人提出任何损失或损害补偿的要求。”

二十、原合同“十五、投资经理的指定与变更”中,原:

“1、投资经理的指定:

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苏航，简介如下：

李苏航，首创证券资产管理事业部固定收益投资部总经理助理、投资经理，英国朴茨茅斯大学学士，英国兰卡斯特大学金融硕士，CFA Level III Candidates。擅长把握个券投资机会，对量化分析及大类资产配置有较为深入认识。2018年加入首创证券资产管理事业部历任职固定收益交易员、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总经理助理。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：

“1、投资经理的指定：

资产管理计划投资理由管理人负责指定。

本资产管理计划投资经理为李苏航、沈梦雨，简介如下：

李苏航，首创证券资产管理事业部固定收益投资部总经理助理、投资经理，英国朴茨茅斯大学学士，英国兰卡斯特大学金融硕士，CFA Level III Candidates。擅长把握个券投资机会，对量化分析及大类资产配置有较为深入认识。2018年加入首创证券资产管理事业部历任职固定收益交易员、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总经理助理。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。

沈梦雨，资产管理事业部固定收益投资部投资经理，澳大利亚新南威尔士大学金融学硕士。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。”

二十一、原合同“二十二、信息披露与报告”第（一）条“定期报告”中，
原：

“（一）定期报告

定期报告包括集合计划份额净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告和托管季度（年度）报告、年度审计报告。

1、集合计划份额净值披露

披露时间：至少每周披露一次经托管人复核的集合计划的份额净值，即每周第二个工作日内披露上周最后一个工作日集合计划份额净值；并于初始募集期或开放期前公告下一个封闭期的业绩报酬计提基准。

披露方式：披露文件等信息将在管理人指定网站上披露，委托人可随时查阅。

2、集合计划的资产管理季度报告

管理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时，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) 中国证监会规定的其他事项。资产管理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，管理人可不编制披露当期的年度报告。

4、集合计划的托管报告

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，于每季度结束之日起一个月内向管理人提供季度托管报告，报告内容包括托管人履职情况以及对当期财务会计报告（如有）、季度报告的复核意见等。

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，于每年度结束之日起四个月内向管理人提供年度托管报告，报告内容包括托管人履职情况以及对当期财务会计报告、年度报告的复核意见等。

上述托管人报告由管理人向投资者披露。计划成立不足三个月或者存续期间

不足三个月的，托管人可以编制当期的季度报告和年度报告。

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资产管理计划出具单项审计意见。管理人在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供。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

定期报告包括集合计划份额净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告和托管季度（年度）报告、年度审计报告。

1、集合计划份额净值披露

披露时间：至少每周披露一次经托管人复核的集合计划的份额净值，即每周第二个工作日内披露上周最后一个工作日集合计划份额净值；并于初始募集期或开放期前公告下一个封闭期的业绩报酬计提基准。

披露方式：披露文件等信息将在管理人指定网站上披露，委托人可随时查阅。

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时，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，管理人可不编制披露当期的年度报告。

4、集合计划的托管报告

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，于每季度结束之日起一个月内向管理人提供季度托管报告，报告内容包括托管人履职情况以及对当期财务会计报告（如有）、季度报告的复核意见等。

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，于每年度结束之日起四个月内向管理人提供年度托管报告，报告内容包括托管人履职情况以及对当期财务会计报告、年度报告的复核意见等。

上述托管人报告由管理人向投资者披露。计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，托管人可以不编制当期的季度报告和年度报告。

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资产管理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。”

二十二、原合同“二十三、风险揭示”第（一）条“市场风险”中，新增：

“7、再投资风险

再投资风险是债券持有人在持有期得到的利息收入、到期时得到的本息、出售时得到的资本收益等，用它们来再投资所能实现的报酬可能会低于当初购买该债券的收益率的的风险。”

二十三、原合同“二十三、风险揭示”第（七）条“本集合计划特有风险”中，原：

“3、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。

4、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人、不同意合同变更但逾期未提出退出申请的委托人均视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。”

变更为：

“3、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。

4、合同变更风险

管理人就合同变更征求委托人意见期间，未明确提出异议的委托人视为同意修改或变更合同和说明书。部分委托人可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。”

二十四、原合同“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”第（三）条“有下列情形之一的，集合计划应当终止”中，原：

“管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构（如需），前述第9项约定的情形除外。”

变更为：

“管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构（如需），前述第8项约定的情形除外。”

二十五、原合同“二十七、资产管理合同的效力”第（一）条“资产管理合同签署的方式”中，原：

“资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。本合同以电子签名方式签署，委托人作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款。”

变更为：

“资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。本合同以电子签名或纸质方式签署，委托人作为本合同一方，以电子签名或纸质方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款。”

二十六、原合同“二十八、其他事项”中，原：

“本合同所称的或有事件是指，根据相关法律法规的规定，在满足本合同约定的情况下，本集合计划管理人与托管人可能发生变更。”

变更为：

“本合同所称的其他事项是指，根据相关法律法规的规定，在满足本合同约定的情况下，本集合计划管理人与托管人可能发生变更。”

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12月27日