

首创证券股份有限公司文件

首创证券尊享优选 17 号集合资产管理计划 变更合同条款备案报告

中国证券投资基金业协会：

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划备案管理办法》等的有关规定，首创证券股份有限公司（以下简称“我司”）特向贵会报备《首创证券尊享优选 17 号集合资产管理计划变更合同条款说明三》（以下简称“变更合同条款说明三”）。

首创证券尊享优选 17 号集合资产管理计划通过签署《关于首创证券尊享优选 17 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函》，托管人已书面同意本次合同变更。另于 2024 年 5 月 30 日发布《关于首创证券尊享优选 17 号集合资产管理计划变更合同条款向委托人征询意见的公告三》。合同变更生效日为 2024 年 6 月 18 日。现就变更相关内容特向贵会进行如下说明：

一、变更内容

1. 修改“特别约定”部分内容
2. 修改“前言”章节
3. 修改“释义”章节
4. 修改“承诺与声明”章节
5. 修改“当事人及权利义务”章节
6. 修改“集合资产管理计划的基本情况”章节,并修改章节名称为“资产管理计划的基本情况”
7. 修改“资产管理计划的募集”章节
8. 修改“资产管理计划的成立与备案”章节
9. 修改“资产管理计划的参与、退出与转让”章节
10. 修改“份额持有人大会及日常机构”章节
11. 修改“资产管理计划份额的登记”章节
12. 修改“资产管理计划的投资”章节
13. 修改“投资顾问”章节
14. 修改“分级安排”章节
15. 修改“利益冲突及关联交易”章节
16. 修改“投资经理的指定与变更”章节
17. 修改“资产管理计划的财产”章节
18. 修改“投资指令的发送、确认和执行”章节
19. 修改“越权交易的界定”章节
20. 修改“资产管理计划的估值和会计核算”章节
21. 修改“资产管理计划的费用与税收”章节

- 22. 修改“资产管理计划的收益分配”章节
- 23. 修改“信息披露与报告”章节
- 24. 修改“风险揭示”章节
- 25. 修改“资产管理合同的变更、终止与财产清算”章节
- 26. 修改“违约责任”章节
- 27. 修改“争议的处理”章节
- 28. 修改“资产管理合同的效力”章节
- 29. 修改“其他事项”章节
- 30. 新增“附件 1：风险揭示书”
- 31. 新增“附件 2：交易监控合规表”

二、产品投向及比例

产品投向及比例调整为：

“1、投资范围

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等标准化债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。

(1) 固定收益类资产：包括国债、地方政府债、央行票据、金融债（含政策性银行债）、二级资本债、次级债、永续债、同业存单、企业债、公司债（含非公开发行的公司债，下同）、优先级资产支持证券（含证监会和其他金融监督管理部门主管及在交易商协会注册的资产支持证券，且底层资产不为产品或其收益权/受益权）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、优先级资产支持票据等投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型公募基金。

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（若无主体评级则取债项评级，若无债项评级则取主体评级）。短期融资券、超短期融资券发行人主体评级不得低于 AA，短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于 A-1。资产支持证券债项评级不得低于 AA。

（2）现金类资产：包括货币市场基金、银行存款、现金、到期日在 1 年内（含 1 年）的国债、到期日在 1 年内（含 1 年）的央行票据、到期日在 1 年内（含 1 年）的政府债券、不超过 7 天（含 7 天）的债券逆回购。

（3）本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。

2、资产配置比例及限制

（1）固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的 80%-100%。

（2）债券逆回购资金余额不超过上一日计划资产净值的 100%。

（3）债券正回购资金余额不超过上一日计划资产净值的 50%。

（4）本集合计划的总资产不得超过该产品净资产的 150%。本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，本集合计划的总资产不得超过净资产的 120%。本集合计划投资于国债、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不受前述规定限制。

（5）本产品中所投信用债 AA+及以上级别债券及现金类资产合计占比不得低于该产品上一日计划资产净值的 60%。

（6）对本集合资产管理计划投资的存款、存单，实行白名单制度，所投存款、存单的发行人应在白名单内，白名单包括：工商银行、建设银

行、农业银行、中国银行、交通银行、邮储银行、光大银行、广发银行、华夏银行、民生银行、平安银行、浦发银行、兴业银行、招商银行、中信银行、北京银行、南京银行、上海银行、江苏银行、浙商银行和河北银行。

(7) 债券投资组合的行权久期严格控制在 3 年（含）以内。

(8) 对单只债券亏损的幅度超过购入成本的 5%的预警。

(9) 对持有债券发行人主体或债项最新评级下调或评级展望为负面的预警。

(10) 本集合计划参与债券发行申购时，本集合计划所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，本集合计划所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量。

(11) 本集合计划投资于单一债券的投资金额不得超过债券存续规模的 25%，且投资于单一债券的金额（以市值计）不得超过本集合计划资产净值的 20%；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%。除以收购公司为目的的设立的资产管理计划、专门投资于未上市企业股权的资产管理计划外，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。

本集合计划符合《运作规定》组合投资的要求。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，并按规定履行合同变更程序。”

三、托管人对本次变更的意见

托管人通过签署《关于首创证券首享优选 17 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函》的方式，书面同意对本次变更条款。

四、合同变更告知方式

本产品为集合资产管理计划，《关于首创证券首享优选 17 号集合资产管理计划变更合同条款向委托人征询意见的公告三》已通过公司官网向委托人公示。

六、合同变更开放期设置

本次合同变更公告于 2024 年 5 月 30 日进行了公示并通知各投资者，不同意合同变更的投资者可在合同变更生效前的开放日退出。

特此报告！

附件：

《首创证券首享优选 17 号集合资产管理计划变更合同条款说明三》

《关于首创证券首享优选 17 号集合资产管理计划变更合同条款向委托人
征询意见的公告三》

《关于首创证券首享优选 17 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复
意见函》

首创证券股份有限公司

2024 年 6 月 18 日

（联系人：张好；联系电话：010-81152989，18311183681）

首创证券股份有限公司

2024 年 6 月 18 日印发
