

首创证券尊享优选 4 号集合资产管理计划变更合同条款说明三

《首创证券尊享优选 4 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“特别约定”部分，原：

“特别约定：《首创证券尊享优选 4 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（首创证券尊享优选 4 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。委托人、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意委托人自签署《电子签名约定书》之日起，委托人以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。”

变更为：

“特别约定：《首创证券尊享优选 4 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（首创证券尊享优选 4 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。委托人、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意委托人自签署《电子签名约定书》之日起，委托人以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其

他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。”

二、原合同“一、前言”部分，原：

“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：

“订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称《民法典》）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《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”部分，原：

“《管理办法》：指2018年10月22日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；

《运作规定》：指2018年10月22日中国证监会发布并施行的《证券期货

经营机构私募资产管理计划运作管理规定》；

封闭期：特指成立日后的一个期间，在此期间委托人不得参与、退出本集合计划；”

变更为：

“《管理办法》：指中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；

《运作规定》：指中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》；

封闭期：除开放期及临时开放期以外的期间；”

四、原合同“二、释义”部分，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》；

五、原合同“三、承诺与声明”中“（三）投资者声明”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：

“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。

5、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。

6、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。

7、投资者已阅读管理人在其网站公示的隐私政策，同时，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。”

六、原合同“四、当事人及权利义务”中“委托人”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”部分，原：

“1、管理人简况

机构名称：首创证券有限责任公司

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：

“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；”

八、原合同“四、当事人及权利义务”中“托管人”部分，原：

“（19）投资于《管理办法》第三十七条第（5）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；”

变更为：

“（19）投资于《管理办法》第三十八条第（5）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；”

九、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中第（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 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。投资于信用债的发行主体仅限于国有和国有控股，投资于信用债的信用等级须满足债券主体评级或债项评级在 AA 及以上级别，本产品中所投信用债 AA+ 及以上级别债券占比不得低于该产品当日计划资产净值的 60%。

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 25%，按成本计，也不超过当日本计划资产净值的 15%，利率债不受此项限制。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。

托管人对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% 的指标不做监督。

(2) 债券正回购：融入资金余额不超过计划上一日净资产的 40%。

(3) 债券逆回购资金余额不得超过计划上一日净资产的 100%。

(4) 计划总资产不得超过计划净资产的 200%。

(5) 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。

(6) 债券投资组合的久期严格控制在 3 年（含）以内。

(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。

(8) 本集合计划不直接投资于商业银行信贷资产。

(9) 如果法律法规及监管政策等对本合同约定的相关投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准，管理人在履行适当程序后，可根据法律法规及监管政策要求相应调整投资比例限制规定。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制。”

变更为：

“2、投资方向

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、金融机构次级债）、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（含证监会和银保监会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等投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型公募基金。

(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。

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（长期）/A-1（短期）。

(3) 本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。

3、投资比例

(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+及以上级别债券占比不得低于该产品上一日计划资产净值的 60%。

(6) 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。

(7) 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。”

十、原合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中，第（十）条“封闭期、开放期安排”中，原：

“1、封闭期：除开放期以外的期间为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。

2、开放期：

本集合计划自成立日起每 6 个月开放一次，若开放期遇法定节假日、休息日等则自动顺延，具体以管理人公告为准。管理人仅在合同变更时有权设置临时开放期，具体以管理人公告为准。”

变更为：

“1、封闭期：除开放期及临时开放期以外的期间。

2、开放期：

本集合计划自成立日起每 12 个月开放一次，若开放期遇法定节假日、休息日等则自动顺延，具体以管理人公告为准。管理人仅在合同变更时有权设置临时开放期，具体以管理人公告为准。”

十一、原合同“六、资产管理计划的募集”中，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。”

十二、原合同“七、资产管理计划的成立与备案”中第（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。”

十三、原合同“七、资产管理计划的成立与备案”中第（四）条“集合计划的备案”中，原：

“管理人应当在集合资产管理计划成立后 5 个工作日内，将资产管理合同、

投资者名单与认购金额、验资报告等材料报中国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）。本集合计划完成备案前不得开展投资活动，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。”

变更为：

“管理人应当在集合资产管理计划成立之日起 5 个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告等材料报中国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）。本集合计划完成备案前不得开展投资活动，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。”

十四、原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中第（二）条“参与和退出的开放日及时间”中，原：

“本集合计划自成立日起每 6 个月开放一次。”

变更为：

“本集合计划自成立日起每 12 个月开放一次。”

十五、原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中第（四）条“参与和退出的方式、价格、程序及确认”中，原：

“（2）退出的程序及确认

① 退出申请的提出

集合计划委托人必须根据集合计划销售机构规定的手续，向集合计划销售机构提出参与或退出的申请。”

变更为：

“（2）退出的程序及确认

① 退出申请的提出

集合计划委托人必须根据集合计划销售机构规定的手续，向集合计划销售机构提出退出的申请。”

十六、原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中，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。”

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

“管理人可选择以自有资金参与本集合计划份额。

（1）自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应符合《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

(2) 自有资金参与的金额和比例：自有资金参与本集合计划的份额，不得超过本集合计划总份额的 20%。管理人及其附属机构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%。

(3) 自有资金退出的条件：管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于 6 个月。

(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。

(5) 信息披露：管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前 5 个工作日通过管理人网站公告。

(6) 自有资金责任承担方式和金额：管理人自有资金参与的享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。

(7) 收益分配以管理人的公告为准。”

变更为：

“证券期货经营机构及其子公司可选择以自有资金参与本集合计划，自有资金参与本集合计划的方式可以为认购、申购、强制调增。

1、自有资金参与及退出的条件

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于 6 个月。证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与或持有期限届满后拟退出前，管理人应当提前 5 个工作日采用包括但不限于函件、公告等形式告知全体投资者和托管人，并取得其同意后方可参与或退出。投资者如不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出，可以在管理人发布的函件、公告等文件中告知的开放期提出退出申请并退出本集合计划。如公告期届满，投资者未退出本集合计划的，则默认其同意自有资金相关变动。托管人如不同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出，可以按管理人发布的函件、公告等文件中告知的方式向管理人提出异议。如公告期届满，托管机构未提出异议，则默认其同意自有资金相关变动。证券期货经营机构及其子公司自有资金参与或退出份额或比例以管理人份额确认公告为准。

投资者和托管人签署本合同即表明同意证券期货经营机构及其子公司在初始募集期可以以自有资金参与本集合计划。

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合同约定的前提下，管理人及其子公司以自有资金参与本集合资产管理计划可以在履行内部审批程序并符合证监会其他规定的情况下，适当提高自有资金参与比例，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。具体参与比例以管理人公告为准。

3、客观因素导致自有资金超限的处理原则及措施

因本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，证券期货经营机构及其子公司可以在 5 个工作日内退出。

4、自有资金参与计划信息披露要求

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前 5 个工作日通过管理人网站公告并征求托管人及投资者意见（因集合资产管理计划规模变动导致自有资金被动超限的除外）。

5、自有资金责任承担方式

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与，享受所参与份额的收益分配，并承担与之相关的投资风险。

6、证券期货经营机构及其子公司自有资金的收益分配

收益分配以管理人的公告为准。

上述证券期货经营机构指管理人及其关联方、关联方的关联方中从事证券期货业务的证券公司、基金管理公司、期货公司及前述机构依法设立的从事私募资产管理业务的子公司。”

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

“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 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。投资于信用债的发行主体仅限于国有和国有控股，投资于信用债的信用等级须满足债券主体评级且债项评级在 AA 及以上级别，本产品中所投信用债 AA+ 及以上级别债券占比不得低于该产品当日计划资产净值的 60%。

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 25%，按成本计，也不超过当日本计划资产净值的 15%，利率债不受此项限制。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。

(2)债券正回购：融入资金余额不超过计划上一日资产净值的 40%。

(3)债券逆回购资金余额不得超过其上一日净资产的 100%。

(4)计划总资产不得超过计划净资产的 200%。

(5)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。

(6)债券投资组合的久期严格控制在 3 年（含）以内。

(7)对单只债券亏损的幅度超过购入成本的 5%的预警。

(8) 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。

(9) 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**。

(10) 本集合计划不直接投资于商业银行信贷资产。

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，管理人在交易完成后应 10 个工作日告知委托人者和托管人，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：

“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、金融机构次级债）、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（含证监会和银保监会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等投资品种、超过 7 天的债券逆回购、债券型公募基金。

(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。

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（长期）/A-1（短期）。

(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+及以上级别债券占比不得低于该产品上一日计划资产净值的 60%。

(6) 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。

(7) 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。”

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

“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：

“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 20 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 20 个工作日内予以全部卖出。

委托人同意，在本集合计划存续期间，为规避固定收益类产品特定风险，本产品投资于固定收益类及现金类资产的比例可以低于资产管理计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于资产管理计划总资产的 80%。

相关特定风险包括但不限于以下内容：

特定风险包括市场趋势性风险及发生巨额或连续巨额退出、预警止损引发的流动性风险等。其中趋势性风险包括但不限于基于对股市、债市、衍生品市场风险的判断，调整资产配置比例的情形。”

二十、原合同“十一、资产管理计划的投资”第（四）条“风险收益特征”中，原：

“本计划属于中等风险 R2 的证券投资产品。”

变更为：

“本计划属于中低风险 R2 的证券投资产品。”

二十一、原合同“十一、资产管理计划的投资”第（七）条“投资限制”中，原：

“1、参见集合计划合同对投资范围、投资比例的约定；

2、证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资，如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。”

变更为：

“1、参见集合计划合同对投资范围、投资比例的约定；

2、本集合计划如参与证券逆回购交易，管理人应当加强流动性风险和交易对手风险的管理。本集合计划应当合理分散逆回购交易的到期日、交易对手及回购证券的集中度。管理人应当按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查，对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整。管理人应当建立健全证券逆回购交易质押品管理制度，根据质押品资质审慎确定质押率水平，持续监测质押品的风险状况与价值变动，质押品按公允价值计算应当足额

3、证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资，如法律法

规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。”

二十二、原合同“十四、利益冲突及关联交易”中，原：

“1、存在或可能存在利益冲突的情形

(1) 集合计划管理人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。

(2) 集合计划管理人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。

(3) 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合资产管理计划的，管理人应当向投资者进行披露，对该资产管理计划账户进行监控，并及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

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。

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。

(2) 发生利益冲突情形信息披露的方式

本集合计划发生利益冲突情形的信息披露将严格按照《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他规定进行。

本集合计划包含利益冲突情形的定期报告和临时报告等有关集合计划的信息将在管理人网站上披露，委托人可随时查阅。

管理人网站：www.sczq.com.cn

(3) 发生利益冲突情形信息披露的内容和时间

1、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、年度审计报告。

发生利益冲突情形需在集合计划的资产管理季度（年度）报告进行信息披露。

2、临时报告

集合计划存续期间，管理人运用受托管理资产从事关联交易的，应当按照规定编制信息披露公告。

本集合计划运用受托管理资产从事关联交易的，应当于签订交易协议后 10 个工作日内（无交易协议的，自事项发生之日起 10 个工作日内），按照规定在管理人网站发布信息披露公告。

3、本集合计划未聘请投资顾问，不存在与投资顾问之间存在利益冲突情形。”

变更为：

“（一）存在或可能存在利益冲突的情形

1、因关联方名单变更导致资产管理计划持仓资产被动成为资产管理计划关联方资产。

2、管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划的，管理人应当以公告的形式在事后向投资者进行披露，对上述投资者账户进行监控，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。

（二）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

本集合计划不涉及任何关联交易。若因关联方名单变更导致资产管理计划持仓资产被动成为资产管理计划关联方资产的,管理人应及时向全体委托人和托管人公告相关情况,并向中国证监会相关派出机构报告。在卖出相关关联方资产时,应提前告知全体委托人并取得其同意,取得全体委托人同意后于 20 个交易日内对相关关联方资产进行卖出,且于事后告知全体委托人和托管人,并向中国证监会相关派出机构报告。

上述关联交易包括:

①管理人运用集合计划财产买卖管理人、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关联方在承销期内承销的证券。

②管理人运用集合计划财产买卖管理人、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的符合本合同投资范围规定的投资产品。

③与关联方开展现券交易、债券借贷、回购交易及接受或提供服务等其他关联交易,含逆回购交易对手方、质押券;

④法律法规或监管机构另有规定的,以另有规定为准。

资产管理产品的关联方主要包括:

①公司管理的其他资产管理产品、提供投资顾问建议的其他资产管理产品,公司、子公司及公司关联方;

②产品托管人及其控股股东、实际控制人或与其有其他重大利害关系的公司;

③产品投资顾问及其控股股东、实际控制人或者与其有其他关联关系的机构;

④其他可能导致资产管理计划存在利益输送的业务主体。

资产管理计划份额持有人不得因本资产管理计划投资收益劣于资产管理计划管理人及其关联方管理的其他类似投资产品,而向资产管理计划管理人或资产管理计划托管人提出任何损失或损害赔偿的要求。

管理人不得将其管理的资产管理计划资产,直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式,为本机构、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提供或者变相提供融资。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元,并且事先取得投资者同意的资产管理计划除外。

2、发生利益冲突情形信息披露的方式

本集合计划发生利益冲突情形的信息披露将严格按照《指导意见》《管理办法》《运作规定》《集合资产管理合同》《说明书》及其他规定进行。

本集合计划包含利益冲突情形的定期报告和临时报告等有关集合计划的信息将在管理人网站上披露，委托人可随时查阅。

管理人网站：www.sczq.com.cn

（三）发生利益冲突情形信息披露的内容和时间

1、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、年度审计报告。

发生利益冲突情形需在本集合计划的资产管理季度（年度）报告进行信息披露。

2、临时报告

本集合计划若因关联方名单变更导致资产管理计划持仓资产被动成为资产管理计划关联方资产的，管理人应及时向全体委托人和托管人公告相关情况，并向中国证监会相关派出机构报告。在卖出相关关联方资产时，应提前告知全体委托人并取得其同意，取得全体委托人同意后于 20 个交易日内对相关关联方资产进行卖出，且于事后告知全体委托人和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

（四）与投资顾问的利益冲突情形

本集合计划未聘请投资顾问，不存在与投资顾问之间存在利益冲突情形。”

二十三、原合同“十九、资产管理计划的估值和会计核算”中第（一）条“集合计划的估值”中，原：

“7、估值方法

（1）证券投资基金估值方法

持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的每万份收益计算。

（2）银行存款以成本列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。

(3) 回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计算利息。

(4) 债券估值方法

①在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的相应品种对应的估值净价估值；

②在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的估值全价减去估值全价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；

③首次发行未上市且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用估值技术确定公允价值；

④交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用第三方估值机构（中证指数有限公司）确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债，采用第三方估值机构（中证指数有限公司）确定公允价值；

⑤在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构（中债金融估值中心有限公司）公布的收益率曲线及估值价格；

⑥同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 如有确凿证据表明按上述规定进行估值不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

(6) 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，按国家最新规定估值。

在任何情况下，计划管理人如采用本项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果计划管理人认为按本项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，计划管理人可根据具体情况，并与计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

根据有关法律法规，资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本计划有关的会计问题，如经相关各方

在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布。”

变更为：

“7、估值方法

（1）证券投资基金估值方法

持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的每万份收益计算。

持有的场内债券型公募基金，按交易所的收盘价估值；持有的场外债券型公募基金，按估值日前一交易日基金管理公司披露的单位净值计算。

在任何情况下，资产管理人如采用本项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（2）银行存款以成本列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如利率发生变化，托管人须及时提供更改后的协议或合同，管理人及时进行账务调整；

（3）回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计算利息；

（4）债券估值方法

①对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价；

②对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价；

③首次发行未上市且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用估值技术确定公允价值；

④同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

(5) 如存在上述估值约定未覆盖的投资品种，管理人可根据具体情况制定估值方法，并将估值方法提供给托管人进行估值。如管理人认为上述估值方法不合适，可就相关估值方法进行修改，并将修改后的方法提前通知托管人进行估值。

(6) 管理人如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。

(7) 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，按国家最新规定估值。

根据有关法律法规，资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布。”

二十四、原合同“二十、资产管理计划的费用与税收”中第（二）条“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，业绩报酬计提日可以为本集合计划固定开放日、收益分配日（以管理人的分红公告为准）、投资者退出日、临时开放日和集合计划终止日。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： ”

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，业绩报酬计提日可以为本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。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：”

原：

“6、其他费用

其他费用由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。”

变更为：

“6、注册登记费：

本集合计划成立后的注册登记费用由计划承担，收费标准按照中国证券登记结算有限责任公司公布费率执行，管理人在收到缴费通知单后按照份额登记机构要求进行费用支付。

7、其他费用

本集合计划成立后的信息披露费用、会计师费、律师费和银行汇划费用以及按照国家有关规定可以列入的其他费用，由管理人本着保护委托人利益的原则，按照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定，由托管人按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。”

二十五、原合同“二十一、资产管理计划的收益分配”中第（五）条“收益分配的执行方式”，原：

“现金分红形成的集合计划份额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额计入集合计划资产的损益。”

变更为：

“现金分红形成的收益分配金额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额计入集合计划资产的损益。”

二十六、原合同“二十二、信息披露与报告”中，原：

“2、集合计划的资产管理季度报告

管理人、托管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：

- （一）管理人履职报告；
- （二）托管人履职报告；
- （三）资产管理计划投资表现；
- （四）资产管理计划投资组合报告；
- （五）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- （六）资产管理计划财务会计报告；
- （七）资产管理计划投资收益分配情况；
- （八）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；

（九）若本计划投资国债期货的，季度报告还应披露集合计划参与国债期货交易的有关情况，包括投资目的，持仓情况，损益情况，投资国债期对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的等。

- （十）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（如需）。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，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、托管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：

- （一）管理人履职报告；

- (二) 托管人履职报告（如适用）；
- (三) 资产管理计划投资表现；
- (四) 资产管理计划投资组合报告；
- (五) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (六) 资产管理计划财务会计报告；
- (七) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (八) 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；

(九) 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，报送管理人住所地中国证监会派出机构，并报中国证券投资基金业协会备案（如需）。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。”

变更为：

“2、集合计划的资产管理季度报告

管理人、托管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：

- (一) 管理人履职报告；
- (二) 托管人履职报告；
- (三) 资产管理计划投资表现；
- (四) 资产管理计划投资组合报告；
- (五) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (六) 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；
- (七) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (八) 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；
- (九) 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（如需）。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，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、托管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：

- （一）管理人履职报告；
- （二）托管人履职报告（如适用）；
- （三）资产管理计划投资表现；
- （四）资产管理计划投资组合报告；
- （五）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- （六）资产管理计划财务会计报告；

（七）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；

（八）资产管理计划投资收益分配情况；

（九）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；

（十）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，报送管理人住所地中国证监会派出机构，并报中国证券投资基金业协会备案（如需）。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。”

原：

“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。”

变更为：

“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。”

二十七、删除原合同“二十三、风险揭示”中第（六）条“其他风险”中，“15、关联交易的风险”

二十八、原合同“二十三、风险揭示”中第（七）条“本集合计划特有风险”中，原：

“1、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。

2、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：

“1、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。

2、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。”

二十九、原合同“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”中第（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。”

三十、原合同“二十七、资产管理合同的效力”中第（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。”

三十一、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。”

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

2023年4月28日