

关于首创证券首享优选系列集合资产管理计划变更合同条款的

征求意见函四

中国工商银行股份有限公司河北省分行：

根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，以及中国证监会发布的《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运作管理规定》的有关规定，需对我司发行管理并由贵行托管的首创证券首享优选系列集合资产管理计划进行更改，变更内容详见附件《首创证券首享优选系列集合资产管理计划变更条款说明四》，相应更改内容在托管协议、计划说明书、风险揭示书中对应的条款同步更改。

首创证券首享优选系列集合资产管理计划分为首创证券首享优选 i 号（包括从 1 号至 18 号）集合资产管理计划（以下简称“首享优选 i 号集合计划”）。我司首享优选 i 号集合计划合同中凡涉及附件《首创证券首享优选系列集合资产管理计划变更条款说明四》中包括的条款的，我司均进行相应变更。恳请贵行就合同变更相关事宜进行审核，出具书面意见。

附件：《首创证券首享优选系列集合资产管理计划变更条款说明四》

首创证券股份有限公司

2022年01月14日



回 执

首创证券股份有限公司：

贵司《关于首创证券首享优选系列集合资产管理计划变更合同条款的征求意见函四》已收悉。我行同意按照贵司附件《首创证券首享优选系列集合资产管理计划变更条款说明四》中所列明的内容，对贵司首享优选 i 号集合计划的管理合同、托管协议、计划说明书和风险揭示书相关内容进行修改，并同意继续担任该系列集合资产管理计划的托管人。

中国工商银行股份有限公司河北省分行

F37C4B99D036

2022年 12月 14日



附件：首创证券尊享优选系列集合资产管理计划变更条款说明四

一、尊享优选 i 号资产管理合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中“(五) 投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级”部分第 2 条及第 3 条，均变更为：

“2、投资方向

本集合计划投资于固定收益类、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。

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%。短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于 A-1。

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%，也不超过本计划资产净值的 20%，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 50%。

(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) 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。

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。”

二、首享优选 i 号资产管理合同“十一、资产管理计划的投资”中“(二) 投资范围及比例”部分第 1 条及第 2 条，均变更为：

“1、投资范围

本集合计划投资于固定收益类、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。

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%。短期融资券、超短期融资券如有债项评级则不低于 A-1。

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%，也不超过本计划资产净值的 20%，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 50%。

(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 个工作日内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。”

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。



