

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

征求意见函三

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三》，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（i 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三》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三》

首创证券股份有限公司

2022

年 10 月 30 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三》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三》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



2022年 11 月 30 日



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三

一、首享优选 i 号资产管理合同“特别约定”均变更为：

“《首创证券首享优选 i 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（首创证券首享优选 i 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、首享优选 i 号资产管理合同“一、前言”中第 1 条，均变更为：

“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、首享优选 i 号资产管理合同“二、释义”，均新增：

“《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、首享优选 i 号资产管理合同“二、释义”中“封闭期”释义，均变更为：



“除开放期及临时开放期以外的期间。”

五、首享优选 i 号资产管理合同“三、承诺与声明”中“(三) 投资者声明”部分，均新增：

“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、首享优选 i 号资产管理合同“四、当事人及权利义务”中“2、委托人的义务”部分，均新增：

“（8）投资者有权撤回其基于个人同意的处理个人信息授权，投资者可向管理人提出关于撤回同意处理个人信息授权的书面申请。投资者撤回同意，不影响撤回前基于个人同意已进行的个人信息处理活动的效力。”

七、首享优选 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、现金类等银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、交易商协会发行的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 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 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) 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。”

八、首享优选 i 号资产管理合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中“(十) 封闭期、开放期安排”部分第 1 条，均变更为：

“1、封闭期：除开放期及临时开放期以外的期间。”

九、首享优选 i 号资产管理合同“五、集合资产管理计划的基本情况”中“(十) 封闭期、开放期安排”部分第 2 条，均变更为：

“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。”

本条变更仅针对首享优选 1 号资产管理合同。

十、首享优选 i 号资产管理合同“六、资产管理计划的募集”中“(三) 资产管理计划的认购事项”部分第 3 条，均变更为：

“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。”

十一、首享优选 i 号资产管理合同“七、资产管理计划的成立与备案”中“(二) 集合计划设立失败”部分，均变更为：

“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。”

十二、首享优选 i 号资产管理合同“七、资产管理计划的成立与备案”中“（四）集合计划的备案”部分，均变更为：

“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。”

十三、首享优选 i 号资产管理合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“（二）参与和退出的开放日及时间”部分，均变更为：

“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。管理人有权设置临时开放期，具体以管理人公告为准。”

本条变更仅针对首享优选 1 号资产管理合同。

十四、首享优选 i 号资产管理合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“（十）单个委托人大额退出、巨额退出和连续巨额退出”部分，均变更为：

“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、首享优选 i 号资产管理合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“（十六）管理人自有资金参与集合计划”部分第（4）条，均变更为：

“（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

份有限

合同
37F4



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、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、现金类等银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、交易商协会发行的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。”

十七、首享优选i号资产管理合同“十一、资产管理计划的投资”中“(三)投资比例超限的处理方式及流程”部分，均变更为：

“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。”

十八、首享优选 i 号资产管理合同“十四、利益冲突及关联交易”中第 2 条第（1）点，均变更为：

“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，提前二十个工作日公告并取得投资者同意，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中国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。”

十九、首享优选 i 号资产管理合同“二十二、信息披露与报告”中“（一）定期报告”部分第 2 条及第 3 条，均变更为：

“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）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。”

二十、首享优选 i 号资产管理合同“二十三、风险揭示”中“(七) 本集合计划特有风险”部分第1条及第2条，均变更为：

“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。”

二十一、首享优选 i 号资产管理合同“二十七、资产管理合同的效力”中“(一) 资产管理合同签署的方式”部分，均变更为：

“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。”

二十二、首享优选 i 号资产管理合同“二十八、其他事项”中第一句表述，均变更为：



“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。

第 11 页

1



