

首创证券股份有限公司文件

首创证券创赢优势策略精选 107 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《首创证券创赢优势策略精选 107 号集合资产管理计划变更合同条款说明一》。

我司于 2025 年 02 月 21 日发布《首创证券创赢优势策略精选 107 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一》。合同变更生效日为 2025 年 02 月 25 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”
2. 修改“一、前言”章节
3. 修改“二、释义”章节
4. 修改“三、承诺与声明”章节

5. 修改"四、当事人及权利义务"章节
6. 修改"五、资产管理计划的基本情况"章节
7. 修改"六、资产管理计划的募集"章节
8. 修改"七、资产管理计划的成立与备案"章节
9. 修改"八、资产管理计划的参与、退出与转让"章节
10. 修改"十一、资产管理计划的投资"章节
11. 修改"十四、利益冲突及关联交易"章节
12. 修改"十五、投资经理的指定与变更"章节
13. 修改"十六、资产管理计划的财产"章节
14. 修改"十七、投资指令的发送、确认和执行"章节
15. 修改"十八、越权交易的界定"章节
16. 修改"十九、资产管理计划的估值和会计核算"章节
17. 修改"二十、资产管理计划的费用与税收"章节
18. 修改"二十一、资产管理计划的收益分配"章节
19. 修改"二十二、信息披露与报告"章节
20. 修改"二十三、风险揭示"章节
21. 修改"二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算"章节
22. 修改"二十五、违约责任"章节
23. 修改"二十八、其他事项"章节
24. 修改附件风险揭示书

二、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、现金类等债权类投资品种，择机将少量资金投资于期货和衍生品类。本集合计划可参与债券回购业务。如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

(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）期货和衍生品类资产：包括股指期货、期权、收益互换等。

本集合计划投资于场外期货和衍生品，在本集合计划完成场外期货和衍生品类投资交易后，应于 5 个工作日内在管理人网站上向投资者披露本次交易的基本要素。

（4）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%，期货和衍生品类资产占本集合计划资产总值的 0-5%。

（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 100%。

（4）本集合计划的总资产不得超过该产品净资产的 200%。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。

（6）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 25%；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。

本集合计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例按照穿透原则合并计算。

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《首创证券创赢优势策略精选 107 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函一》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，《首创证券创赢优势策略精选 107 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一》已通过公司官网向委托人公示。

五、合同变更开放期设置

本次合同变更公告于 2025 年 02 月 21 日进行了公示并通知各投资者。

不同意此次合同变更内容的投资者可在开放日退出。

特此报告！

附件：

《首创证券创赢优势策略精选 107 号集合资产管理计划变更合同条款说明一》

《首创证券创赢优势策略精选 107 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函一》

《首创证券创赢优势策略精选 107 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一》

首创证券股份有限公司

2025 年 02 月 25 日

（联系人：芮继荣；联系电话：010-81152958，15011275893）

首创证券股份有限公司

2025 年 02 月 25 日印发
