

关于首创证券创赢优势策略精选 9 号集合资产管理计划

修改合同的征求及回复意见函三

中国建设银行股份有限公司北京市分行：

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创赢优势策略精选 9 号集合资产管理计划的《首创证券创赢优势策略精选 9 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“管理合同”）进行更改，相应更改内容在计划说明书、风险揭示书、托管协议中对应的条款同步更改。

变更内容以本次签订的《首创证券创赢优势策略精选 9 号集合资产管理计划资产管理合同》（2024 年 6 月更新版）为准。

附：

托管协议附件《交易监控合规表》

交易监 控合规 表序号	项目	监控内容
1	监控 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，其中“且底层资产不为产品或其收益权/受益权”因托管人系统原因暂时无法监控，由管理人自行监控）、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（此条款因托管人系统原因无法监控，由管理人自行操作）。 (4) 本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。

2
监控
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该资产的 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（管理人向托管人提供申报信息后，托管人根据管理人提供的信息进行监控）。

(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%（此条款因托管人系统原因无法监控，由管理人自行监控）。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（此条款因托管人系统原因无法监控，由管理人自行监控）。

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。



首创证券股份有限公司

2024年6月11日

回 执

首创证券股份有限公司：

贵司《关于首创证券创赢优势策略精选9号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函三》已收悉。我行对该集合资产管理计划合同修改的意见如下：

我行同意按照贵司来函中所列明的内容，对首创证券创赢优势策略精选9号集合资产管理计划的管理合同、托管协议、计划说明书和风险揭示书相关内容进行修改，并同意继续担任该集合资产管理计划的托管人。

中国建设银行股份有限公司北京市分行

2024年6月12日