

关于首创证券创赢优势策略精选 3 号集合资产管理计划

修改合同的征求及回复意见函一

广发银行股份有限公司：

根据最新的投资运作需要，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 3 号集合资产管理计划的《首创证券创赢优势策略精选 3 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）进行更改，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。

具体更改内容如下：

一、资产管理合同第一章“前言”中，原：

“为规范首创证券创赢优势策略精选 3 号集合资产管理计划（以下简称“集合计划”或“计划”）运作，明确《首创证券创赢优势策略精选 3 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”）当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国合同法》、《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《管理规定》）、《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称《合同指引》）《中华人民共和国电子签名法》（以下简称“《电子签名法》”）等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会、中国证券业协会的有关规定，委托人、管理人、托管人在平等自愿、公平、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《合同指引》、《首创证券创赢优势策略精选 3 号集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。”

变更为：

“为规范首创证券创赢优势策略精选 3 号集合资产管理计划（以下简称“集

合计划”或“计划”)运作,明确《首创证券创赢优势策略精选3号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《中华人民共和国民法典》、《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《管理规定》)、《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》(以下简称《合同指引》)、《中华人民共和国电子签名法》(以下简称“《电子签名法》”)等法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会、中国证券业协会的有关规定,委托人、管理人、托管人在平等自愿、公平、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,当事人按照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、《合同指引》、《首创证券创赢优势策略精选3号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。”

二、资产管理合同第五章“集合资产管理计划的基本情况”的“(五)投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级”中,原

“3、投资比例

(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)、同业存单、企业债、项目收益债(NPB)、公司债(含非公开发行的公司债及中证机构间报价与服务系统发行的非公开公司债券,下同)、资产支持证券优先级(含证监会和银监会主管及在交易商协会注册的资产支持证券优先级)、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、超过7天的债券逆回购、债券型基金。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,短期融资券债项评级不低于A-1。

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。

金融衍生品包括股指期货、期权、收益互换等金融衍生品类资产。

(2) 固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的80%-100%，金融衍生品类资产占本计划资产总值的0-5%。

全体委托人一致同意，在本资产管理计划存续期间，为规避特定风险保护投资者合法权益的，本产品投资于固定收益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%。

本集合计划投资于场外金融衍生品，在本计划完成场外金融衍生品投资交易后，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。

(3) 债券回购：债券正回购或逆回购资金余额不得超过本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) 本集合计划投资于单一债券的投资数量不得超过债券发行规模的25%且投资于单一债券的金额(以成本价计)不得超过本计划资产净值的25%(国债、中央银行票据、政策性金融债、银行存款等中国证监会认可的投资品种除外)。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%。

(6) 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。”

变更为：

“3、投资比例

(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)、同业存单、企业债、项目收益债(NPB)、公司债(含非公开发行的公司债，下同)、资产支持证券优先级(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优先级)、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、超过7天的债券逆回购、债券型基金。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，短期融资券债项评级不低于 A-1。

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。

金融衍生品包括股指期货、期权、收益互换等金融衍生品类资产。

(2) 固定收益类和现金类资产占本计划资产总值的 80%-100%，金融衍生品类资产占本计划资产总值的 0-5%。

全体委托人一致同意，在本资产管理计划存续期间，为规避特定风险保护投资者合法权益的，本产品投资于固定收益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%。

本集合计划投资于场外金融衍生品，在本计划完成场外金融衍生品投资交易后，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。

(3) 债券回购：债券正回购或逆回购资金余额不得超过本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) 本集合计划投资于单一债券的投资数量不得超过债券发行规模的 25% 且投资于单一债券的金额（以成本价计）不得超过本计划资产净值的 25%（国债、中央银行票据、政策性金融债、银行存款等中国证监会认可的投资品种除外）。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%。管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%，本条投资限制由管理人自行监控。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。

(6) 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。”

管理合同第十一章“资产管理计划的投资”的“(二) 投资范围及比例”中做相应变更。

三、资产资管合同第十九章“资产管理计划的估值和会计核算”的“(三)估值方法”中，原：

“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。

持有的债券型基金，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，每日按照约定利率预提收益。

3、在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

交易所上市不存在活跃市场的有价证券（包括但不限于资产支持证券、私募债等），采用估值技术确定公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

4、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公布的收益率曲线及估值价格。

5、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；

6、在机构间私募产品报价与服务系统发行的债券以成本估值。在持有期按票面利率每日计提应收利息。

7、首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

8、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。

9、股指期货和场内期权的估值方法

以估值日交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。

10、场外金融衍生品的估值方法

以交易对手方每日提供的估值价并经过管理人确认，确定其公允价值。估值日未提供估值价的以最近一个估值日提供的价格确定其公允价值。投资者知悉并同意，如交易对手方提供的估值价格错误，由此造成的本集合计划估值发生偏差的，由管理人负责与交易对手沟通，并及时更正错误估值，同时通知托管人。

11、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。

12、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。”

变更为：

“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。

持有的债券型基金，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，每日按照约定利率预提收益。

3、在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

交易所上市不存在活跃市场的有价证券（包括但不限于资产支持证券、私募债等），采用估值技术确定公允价值。

4、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公布的收益率曲线及估值价格。

5、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；

6、首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值。

7、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。

8、股指期货和场内期权的估值方法

以估值日交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。

9、场外金融衍生品的估值方法

以交易对手方每日提供的估值价并经过管理人确认，确定其公允价值。估值日未提供估值价的以最近一个估值日提供的价格确定其公允价值。投资者知悉并同意，如交易对手方提供的估值价格错误，由此造成的本集合计划估值发生偏差的，由管理人负责与交易对手沟通，并及时更正错误估值，同时通知托管人。

10、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。

11、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。”

若产品合同变更条款涉及到风险揭示书和计划说明书，对应一并修改。



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 3 号集合资产管理计划修改合同的征求意见函》已收悉。我行对该集合资产管理计划合同修改的意见如下：

鉴于调高管理费率属合同重要条款变更，涉及委托人切身利益，贵司应及时、充分的告知委托人管理费率调高事宜，在此基础上，我行同意按照贵司来函中所列明的内容，请贵司按照相关法律法规和资产管理合同的相关规定进行产品变更备案，并及时、充分履行信息披露义务。

广发银行股份有限公司

2021年10月11日

资产管理业务合同专用章

