

# 首创证券创赢 M6002 号 集合资产管理计划托管协议 之补充协议八

编号：光银托管北分 2019QS041-2-补 08

管理人：首创证券股份有限公司

托管人：中国光大银行股份有限公司北京分行

二零二四年四月

## 合同当事人

### 管理人

名称：首创证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安定路5号院13号楼A座11-21层

法定代表人：毕劲松

电话：（010）81152000

传真：（010）81152982

### 托管人

名称：中国光大银行股份有限公司北京分行

地址：北京市西城区宣武门内大街1号

负责人：王罡

电话：（010）83759306

传真：（010）83759386

现管理人—首创证券股份有限公司及托管人—中国光大银行股份有限公司北京分行协商一致，对首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划（以下简称“创赢 M6002 号”）以签署补充协议的方式进行《首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划托管协议》及《首创证券创赢 M6002 集合资产管理计划托管协议之补充协议》、《首创证券创赢 M6002 集合资产管理计划托管协议之补充协议二》、《首创证券创赢 M6002 集合资产管理计划托管协议之补充协议三》、《首创证券创赢 M6002 集合资产管理计划托管协议之补充协议四》、《首创证券创赢 M6002 集合资产管理计划托管协议之补充协议五》、《首创证券创赢 M6002 集合资产管理计划托管协议之补充协议六》、《首创证券创赢 M6002 集合资产管理计划托管协议之补充协议七》（以下统称“原托管协议”）变更。

一、原托管协议“四、计划托管人和计划管理人之间的业务监督、检查”第（一）条“计划托管人对计划管理人的业务监督和核查”中“2、投资范围、投资比例”变更为：

“（1）投资范围

本集合计划主要投资于固定收益类、现金类等标准化债权类投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。

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。

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) 金融产品类资产(不包括货币市场基金): 包括人民币形式的银行非保本理财产品, 信托计划, 证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基金管理子公司、商业银行理财子公司、期货公司、期货公司子公司、保险公司及保险资管公司发行的资管产品, 于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募证券投资基金;

本集合计划投资的金融产品, 其投资标的中不应包含除公募基金之外的其他资产管理产品。

4) 期货和衍生品类资产: 国债期货。

5) 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

1) 本集合计划投资于固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的80%-100%。

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。

7) 本集合计划不得投资非标准化资产。

8) 本集合计划投资于期货和衍生品类资产占本集合计划资产总值的 0%-20% (不含)。

主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不超过本资产管理计划资产净值的 20%。

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。”

二、原托管协议“十一、计划的费用支出”第(一)条“集合计划费用的种类、计提标准及支付方式”中“1、管理费”变更为:

“本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提, 管理费率为 0.40%/年。计算方法如下:

$$H=E \times 0.40\% \div 365$$

H 为每日应计提的管理费;

E 为前一自然日集合计划资产净值。

管理费每日计提, 逐日累计至本集合计划成立后每个自然季度支付一次, 经管理人与托管人双方核对无误后, 由托管人于本集合计划每个自然季度起 10 个工作日内依据管理人的划款指令从本集合计划资产中一次性支付给管理人, 若遇法定节假日、休息日等, 支付日期顺延。

管理费收入账户:

户 名: 首创证券股份有限公司

账 号: 11001018500056001700

开户银行: 建设银行北京安慧支行

大额支付号: 105100004034”

三、原托管协议“十一、计划的费用支出”第(一)条“集合计划费用的种类、计提标准及支付方式”中“7、业绩报酬费”变更为:

“(1) 管理人核算业绩报酬的原则

①本集合计划对投资者持有的集合计划份额进行业绩报酬计提；

②同一投资者不同时间多次参与集合计划，本集合计划对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；

③在符合业绩报酬计提条件时，管理人有权在集合计划收益分配日（以管理人公告为准）、投资者退出日和集合计划终止日计提业绩报酬；

④在集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除，在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除；

⑤集合计划分红时，业绩报酬按投资者集合计划分红时持有的份额进行核算；

⑥投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或集合计划终止时持有份额进行核算；

⑦管理人业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次，但因投资者退出集合计划提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制；

⑧管理人有权于集合计划份额发行前公告业绩报酬计提基准等规则。

(2) 业绩报酬的计提方法：

在收益分配基准日和计划终止日，对集合计划中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬；在委托人退出申请日，仅对退出份额中符合业绩报酬计提条件的全部份额计提业绩报酬。

每笔参与份额以上一业绩报酬核算日到本次业绩报酬核算日的年化收益率，作为计提业绩报酬的依据。若委托人持有计划份额期间，发生业绩报酬计提基准或业绩报酬计提比例调整，需分别计算调整前后不同核算期内的产品年化收益率，并加总计算管理人业绩报酬。

核算期产品年化收益率的计算公式如下：

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \div D \times 365 \times 100\%$$

$P_1$ ：本次业绩报酬核算日的累计单位净值；

$P_0$ ：上一个业绩报酬核算日的累计单位净值；

$P_0^*$ ：上一个业绩报酬核算日的单位净值；

$D$ ：上一个业绩报酬核算日至本次业绩报酬核算日的天数；

$R$ ：年化收益率。

业绩报酬具体计算方法如下：

$$F = \max\{ (R-r) \times N \times C \times (D/365) , 0\}$$

其中：

F：针对投资者每笔参与份额核算期内应提取的业绩报酬；

r：核算期区间对应的业绩报酬计提基准；

C：投资者每笔参与份额在上一业绩报酬核算日的资产净值总额；

N：管理人业绩报酬提取比例为 60%；

如上一个业绩报酬核算日不存在，则为份额注册登记日。

上述管理人业绩报酬计入管理费。

### (3) 业绩报酬的支付

每个自然季度起 10 个工作日内或产品终止时，管理人有权全额提取当期计提的业绩报酬（如有），具体以管理人安排和计算为准。支付时由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人根据管理人发送的指令于 3 个工作日内从本集合计划资产中将业绩报酬一次性支付给管理人。遇法定节假日、休息日时，支付日期顺延。业绩报酬的计算和复核由管理人完成，托管人仅根据管理人出具的划款指令进行操作。

管理人有权修改业绩报酬计提基准，管理人应于新的业绩报酬计提基准启用前至少三个工作日在管理人指定网站公告。业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的计算使用，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。”

## 四、原托管协议“七、交易安排”第（二）条“证券交易的资金清算与交割”中“1、证券交易资金的”变更为：

非担保交收业务的交易告知。非担保交收业务是指中国结算公司组织交易双方根据业务规则规定或双方约定的结算模式完成交收，中国结算不作为双方的共同对手方，不提供交收担保。为确保非担保交收业务的正常交收，投资管理人务必高度重视此类业务交易告知的重要性，即于发生国债买断式回购到期购回、权证行权、大宗专场、专项资产管理计划转让以及部分发行类业务（股配债、老股东配售的增发、公司债场内分销）以及通过上交所固定收益证券综合电子平台达

成的私募债券转让和通过深圳综合协议平台的公司债、私募债转让等非担保交收业务，管理人应于交易当日及时将该交易书面告知托管人并进行电话确认。其中权证行权的交易和通过上交所固收平台达成的私募债转让交易告知截止时点为申报当日 15:00；通过深圳综合协议平台达成的公司债、私募债转让交易告知时间为申报当日 15:30；其余产品非担保交易告知截止时点为交易当日 15:30。

五、原托管协议“附件一：交易监控合规表”变更为：

序号	项目	监控内容
1	监控范围	<p>本集合计划主要投资于固定收益类、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。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(3) 金融产品类资产（不包括货币市场基金）：包括人民币形式的银行非保本理财产品，信托计划，证券公司、证券公司子公司、基金管理公司、基金管理子公司、商业银行理财子公司、期货公司、期货公司子公司、保险公司及保险资管公司发行的资管产品，于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募证券投资基金；</p> <p>本集合计划投资的金融产品，其投资标的中不应包含除公募基金之外的其</p>



		<p>他资产管理产品。</p> <p>(4) 期货和衍生品类资产：国债期货。</p> <p>(5) 本集合计划不得直接投资商业银行信贷资产。</p>
2	监控比例及限制	<p>(1) 本集合计划投资于固定收益类和现金类资产占本集合计划资产总值的 80%-100%。</p> <p>(2) 债券逆回购资金余额不超过上一日计划资产净值的 100%。</p> <p>(3) 债券正回购资金余额不超过上一日计划资产净值的 100%。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(7) 本集合计划不得投资非标准化资产。</p> <p>(8) 本集合计划投资于期货和衍生品类资产占本集合计划资产总值的 0%-20%（不含）。</p> <p>主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不超过本资产管理计划资产净值的 20%。</p>

备注：同一资产指单只股票、基金、债券（监控数据来源仅限于托管人托管的全部产品）

六、本补充协议经双方法定代表人/负责人或授权代表签字/签章并加盖公章或合同专用章之日起成立并生效。

七、本补充协议为对原托管协议之修改和补充，为原托管协议不可分割的一部分。本补充协议与原托管协议内容不一致的，以本补充协议为准，其他内容以原托管协议为准。

八、本补充协议一式贰份，管理人、托管人各执壹份，每份具有同等法律效力。

（以下无正文）

【此页为《首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划托管协议之补充协议八》签字页。】

管理人：首创证券股份有限公司（盖章）


法定代表人或授权代理人（签章）



蒋青峰

托管人：中国光大银行股份有限公司北京分行（盖章）

法定代表人/负责人或授权代理人（签章）：



刘荣海

签订日期： 2024年 4月 8 日