

首创证券股份有限公司文件

首创证券创赢 25 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管理办法》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 25 号集合资产管理计划变更合同条款说明十二》（以下简称“变更合同条款说明十二”）。

首创证券创赢 25 号集合资产管理计划通过签署《关于首创证券创赢 25 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函十二》，托管人已书面同意本次合同变更。另于 2025 年 3 月 31 日发布《关于首创证券创赢 25 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十二》。合同变更生效日为 2025 年 4 月 2 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“承诺与声明”章节
2. 修改“当事人及权利义务”章节
3. 修改“资产管理计划的基本情况”章节
4. 修改“资产管理计划的募集”章节
5. 修改“资产管理计划的参与、退出与转让”章节
6. 修改“资产管理计划的投资”章节
7. 修改“利益冲突及关联交易”章节
8. 修改“资产管理计划的估值和会计核算”章节
9. 修改“资产管理计划的费用与税收”章节
10. 修改“信息披露与报告”章节
11. 修改“风险揭示”章节
12. 修改“违约责任”章节
13. 修改“附件 1：风险揭示书”部分内容
14. 修改“附件 2：交易监控合规表”部分内容

二、产品投向及比例

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、超过7天的债券逆回购。

投资于信用债及同业存单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）。投资于信用债及同业存单的主体评级（如有）不得为AA以下。

(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。投资于银行存款、现金的主体评级不得为AA以下。

(3) 开展交易所及银行间逆回购业务，应合理控制投资期限和比例，质押资产可选择的，也应控制在上述投资范围之内。

(4) 本集合计划可参与债券借贷业务（包括债券借入和债券借出）。

(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%。

(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 15%。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) 本集合计划投资于单一债券主体的投资金额不得超过本集合计划上一日资产净值的 15%。本集合计划投资于利率债、优质国有股份银行（工商银行、建设银行、农业银行、中国银行、邮储银行、交通银行、招商银行、兴业银行、浦发银行、中信银行、光大银行、华夏银行和广发银行）的存单或存款类资产时，不设置单一信用主体集中度限制。本集合计划投资于其他优质商业银行（平安银行、北京银行、江苏银行、上海银行、宁波银行、南京银行、杭州银行、上海农商行）存款类资产时，可适当放宽单一信用主体集中度限制至本集合计划上一日资产净值的 30%。

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《关于首创证券创赢 25 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函十二》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，《关于首创证券创赢 25 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十二》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 3 月 31 日进行了公示并通知各投资者，不同意合同变更的投资者可在合同变更生效前的开放日退出。

特此报告！

附件：

《首创证券创赢 25 号集合资产管理计划变更合同条款说明十二》

《关于首创证券创赢 25 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函十二》

《关于首创证券创赢 25 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十二》

首创证券股份有限公司

2025 年 4 月 2 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 4 月 2 日印发
