

# 首创证券股份有限公司文件

---

## 首创证券创赢 M6002 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 M6002 号集合资产管理计划变更合同条款说明九》（以下简称“变更合同条款说明九”）。

首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划通过签署《关于首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函九》，托管人已书面同意本次合同变更。另于 2024 年 4 月 8 日发布《关于首创证券创赢 M6002 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九》。合同变更生效日为 2024 年 4 月 10 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”部分
2. 修改“前言”章节
3. 修改“释义”章节
4. 修改“承诺与声明”章节
5. 修改“当事人及权利义务”章节
6. 修改“资产管理计划的基本情况”章节
7. 修改“资产管理计划的募集”章节
8. 修改“资产管理计划的成立与备案”章节
9. 修改“资产管理计划的参与、退出与转让”章节
10. 修改“资产管理计划的投资”章节
11. 修改“利益冲突及关联交易”章节
12. 修改“资产管理计划的财产”章节
13. 修改“投资指令的发送、确认和执行”章节
14. 修改“越权交易的界定”章节
15. 修改“资产管理计划的估值和会计核算”章节
16. 修改“资产管理计划的费用与税收”章节
17. 修改“资产管理计划的收益分配”章节
18. 修改“信息披露与报告”章节
19. 修改“风险揭示”章节
20. 修改“资产管理合同的变更、终止与财产清算”章节
21. 修改“违约责任”章节

22. 修改“资产管理合同的效力”章节

23. 修改“其他事项”章节

24. 修改“附件 1：风险揭示书”部分内容

## 二、产品投向及比例

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、资产配置比例及限制

(1) 穿透来看,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) 本集合计划穿透后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。”

### 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 M6002 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函九》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 M6002 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九》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 2024 年 4 月 8 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 M6002 号集合资产管理计划变更合同条款说明九》

《关于首创证券创赢 M6002 号集合资产管理计划修改合同的征求及回复意见函九》

《关于首创证券创赢 M6002 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九》

首创证券股份有限公司

2024 年 4 月 10 日

(联系人：张好；联系电话：010-81152989，18311183681)

---

首创证券股份有限公司

2024 年 4 月 10 日印发

---