

关于华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同

变更的征询意见函及临时开放期设置公告

尊敬的投资者：

华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划（后简称“本集合计划”）由华鑫证券有限责任公司担任管理人、上海浦东发展银行股份有限公司上海分行担任托管人，本集合计划于 2021 年 3 月 8 日成立。

根据中国证券投资基金业协会备案反馈要求，对《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXZQXPZZ-2021 第 1 号）中的“估值方法”及“参与及退出的确认时间”条款进行修改，《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划托管协议》、《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划说明书》作为主合同的组成部分同步作变更，并按照合同约定向全体委托人征询意见。

我司确认并承诺更新或修改的内容不违反法律法规和中国证监会的有关规定，不损害投资者利益。我司与托管人（上海浦东发展银行股份有限公司上海分行）协商确认，通过签署《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXZQXPZZ-2021 第 1 号-1）（以下简称《资管合同》）的方式对《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：HXZQXPZZ-2021 第 1 号）内容进行更新或修改。

一、主要变更事项的说明

（一）华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同（合同编号：HXZQXPZZ-2021 第 1 号）

本次合同变更主要内容如下，详细修订内容详见“第二章、华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同修订前后款对照表”：

- （1）修改估值方法；
- （2）修改参与及退出的确认时间；

修改后的资产管理合同请参见华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同（HXZQXPZZ-2021 第 1 号-1）。

（二）华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划说明书

《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划说明书》对相应资产管理合同同步变更。

（三）华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划托管协议

《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划托管协议》对相应资产管理合同同步变更。

二、华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同修订前后款对照表

变更前的条款	变更后的条款
--------	--------

华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同（编号：HXZQXPZZ-2021 第 1 号）	华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同（编号：HXZQXPZZ-2021 第 1 号-1）
第八节、资产管理计划的参与、退出与转让	
一、集合计划的参与 （三）参与的程序和确认 1、参与程序和确认 （5）投资者销售期参与的，可于计划成立后 2 个工作日内到办理参与的营业网点、原销售机构指定网络系统查询参与确认情况；投资者开放期参与的，可于申请日后 2 个工作日内到办理参与的网点、原销售机构指定网络系统查询参与确认情况。确认无效的申请，销售机构将退还投资者已交付的参与款项本金（不包括利息）。	一、集合计划的参与 （三）参与的程序和确认 1、参与程序和确认 （5）投资者销售期参与的，可于计划成立后 2 个工作日内到办理参与的营业网点、原销售机构指定网络系统查询参与确认情况；投资者开放期参与的，可于申请日后 3 个工作日内到办理参与的网点、原销售机构指定网络系统查询参与确认情况。确认无效的申请，销售机构将退还投资者已交付的参与款项本金（不包括利息）。
二、集合计划的退出 （三）退出的程序和确认 2、退出申请的确认：销售机构在 T 日规定时间受理投资者申请管理人在 T+1 日内对该申请的有效性进行确认，投资者可在申请赎回后第 2 日（T+2 日）向原销售网点、原销售机构指定网络系统查询退出确认情况。 3、退出款项的划付：退出款项将在 T+2 日内从托管账户划出，经销售机构划往投资者指定资金账户，但发生巨额退出情形时，按巨额退出情形的相关规定处理。如集合计划出现本合同“第十九节”所述暂停估值的情形，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。	二、集合计划的退出 （三）退出的程序和确认 2、退出申请的确认：销售机构在 T 日规定时间受理投资者申请管理人在 T+2 日内对该申请的有效性进行确认，投资者可在申请赎回后第 3 日（T+3 日）向原销售网点、原销售机构指定网络系统查询退出确认情况。 3、退出款项的划付：退出款项将在 T+3 日内从托管账户划出，经销售机构划往投资者指定资金账户，但发生巨额退出情形时，按巨额退出情形的相关规定处理。如集合计划出现本合同“第十九节”所述暂停估值的情形，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。
第十九节、资产管理计划财产的估值和会计核算	
七、估值方法 （三）固定收益品种的估值方法 1、交易所市场交易品种估值处理 （4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，鉴于目前尚不存在活跃市场而采用成本法估值。	七、估值方法 （三）固定收益品种的估值方法 1、交易所市场交易品种估值处理 （4）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。未公开发行上市的资产支持证券和私募债券，

	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,按成本法估值。
(5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,应采用估值技术确定其公允价值。	(5) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,应采用估值技术确定其公允价值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本法估值。
七、估值方法 (五) 银行间市场交易品种估值处理 2、对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,在发行利率与二级市场利率不存在明显差异,未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下,按成本估值。	七、估值方法 (五) 银行间市场交易品种估值处理 2、对银行间市场未上市,且第三方估值机构未提供估值价格的债券,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。
七、估值方法 (九) 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。	七、估值方法 (九) 管理人采用上述估值方法对固定收益品种进行估值,应被认为采用了适当的估值方法,但是如果管理人认为上述估值方法不能客观反应其公允价值的,管理人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形成的债券估值,管理人可以根据具体情况与托管人商定后,按最能反应其公允价值的价格估值。
附件四、预留印鉴授权书	
华鑫证券有限责任公司(作为管理人)、上海浦东发展银行股份有限公司上海分行(作为托管人)已签署编号为 HXZQXPKZZ-2021 第 1 号的《华鑫证券鑫鹏	华鑫证券有限责任公司(作为管理人)、上海浦东发展银行股份有限公司上海分行(作为托管人)已签署编号为 HXZQXPKZZ-2021 第 1 号-1 的《华鑫证券鑫

可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同》。以下 管理人的预留印鉴,该印鉴用于集合资产管理业务运 作过程中用于业务往来确认所盖印章的预留印鉴。	鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同》。以下 为管理人的预留印鉴,该印鉴用于集合资产管理业务运 作过程中用于业务往来确认所盖印章的预留印鉴。
--	--

三、本计划托管人对本次合同变更的意见

托管人上海浦东发展银行股份有限公司上海分行同意本次合同变更事宜,请参见“关于《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同及托管协议变更的征询函》的回函”。

四、向全体投资者征询意见及后续安排

根据《华鑫证券鑫鹏可转债 1 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十四部分、第一条款、第 3 条约定“除前文第 1 项、第 2 项所述之外的其余事项如需发生变更的,管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后 5 个工作日内以管理人官网公告或短信向投资者发送合同变更征询意见函。投资者不同意变更的,应在征询意见函发出后的最近一个开放期或管理人设置的合同变更临时开放期内(以下统称“指定开放期”)提出退出本集合计划的申请;投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的,视为投资者同意合同变更。投资者不同意变更的,管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排:投资者不同意变更的,管理人保障其退出集合计划的权力;对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者,管理人将统一在临时开放期做强制退出处理(退出价格为退出当日的计划份额净值)。如投资者同意变更,则变更事项自征询意见函(或通知)约定的日期开始生效,对合同各方均具有法律效力。”之约定。

本征询意见函及临时开放期设置公告将通过管理人网站公告向各投资者征询意见。我司将设置临时开放期合理保障投资者选择退出资产管理计划的权力,临时开放期为 2021 年 5 月 21 日,共 1 个工作日。

投资者应在临时开放期内以邮件形式回复意见并发送至我司邮箱:zcglb@cfsc.com.cn

投资者不同意变更的,可在临时开放期内提出退出本集合计划的申请;对于投资者在临时开放期内提出的退出申请,管理人将于临时开放日当日为投资者办理退出;投资者未在临时开放期内回复意见或未在临时开放期内提出退出本集合计划申请的,视为投资者同意合同变更。如投资者同意变更,则变更事项自征询意见函(或通知)指定的日期届满的最后一工作日开始生效,对合同各方均具有法律效力。

五、合同变更的效力及生效时间

本征询意见函及临时开放期设置公告构成变更后合同的组成部分,变更后的合同将于 2021 年 5 月 24 日(含)正式生效。

如有疑问，请拨打客服热线：95323。

特此公告。

华鑫证券有限责任公司（公章）

2021年5月17日



