

野村东方国际正和 1 号固定收益集合资产管理计划合同变更公告

野村东方国际正和 1 号固定收益集合资产管理计划（下称“本资产管理计划”）已于 2020 年 4 月 15 日正式成立。本资产管理计划的托管人为中国工商银行股份有限公司上海市分行。

一、合同变更原因

1. 《野村东方国际正和 1 号固定收益集合资产管理计划资产管理合同（第一次合同变更）》（以下简称“合同”）部分债券品种估值条款依据《证券公司客户资产管理业务估值办法指引》设立，根据中国证券投资基金业协会通知，应根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》相关标准为准，故本次变更调整部分债券品种估值条款。
2. 合同中的证券投资基金估值条款根据《基金中基金估值业务指引（试行）》设立，由于本资产管理计划非 FOF 产品，现根据《证券公司客户资产管理业务估值办法指引》变更证券投资基金估值条款。
3. 根据《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引》要求，增加国债期货保证金的流动性应急处理机制（包括应急触发条件、保证金补充机制、损失责任承担等）相关条款。

二、合同约定的变更条件与程序

根据合同第二十五节第一百条“合同变更的条件与程序”的约定，本次合同变更条件符合本资产管理计划符合第一百条的第（一）款第 1 项，采用第一百条的第（二）款第 1 项作为本次合同变更程序。

1. 合同变更条件

第一百条的第（一）款第 1 项：“因法律法规或中国人民银行、中国证监会等金融监管部门的规定、证券投资基金业协会的自律规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则发生变化必须变更资产管理合同的，管理人可以与托管人协商后修改资产管理合同；”

2. 合同变更程序

第一百条的第（二）款第 1 项：“因本条第（一）款第 1 项原因变更合同的，经管理人与托



管人协商一致后，由管理人将变更后的资产管理合同于管理人网站披露，披露满【5】个工作日，且管理人通过官方网站向投资者与托管人宣布合同变更生效，此次资产管理合同的变更生效。”

三、合同变更内容

新增期货投资相关规定、修改部分债券品种的估值方法和投资公开募集的证券投资基金的估值方法，具体内容详见附件一：合同变更对照表。

四、合同变更程序

根据与托管人协商结果，本次采用托管人和管理人签署补充协议的方式进行本资产管理计划的合同变更，本资产管理计划合同变更公告和补充协议将于 2021 年 12 月 27 日在管理人网站披露，将于 2022 年 1 月 1 日起生效。

投资者对合同更新或修改的内容有异议，可在 2021 年 12 月 31 日前以邮件的方式将异议事项和联系方式发送至管理人邮箱 (CustomerService_AM@nomuraoi-sec.com)，管理人将依据本资产管理计划合同约定保障投资人权益。

野村东方国际证券有限公司

2021 年 12 月 24 日

附件一：合同变更对照表

位置	原条款	现条款
<p>第四十九条 期货投资的规定</p>	<p>无</p>	<p>(1) 风险控制</p> <p>由于期货交易尤其是进行投机交易会涉及到对行情进行判断，因而存在着较高的市场风险，管理人会对以投机为目的的交易进行严格的控制和监管。首先，严格控制投机交易的规模，不得超过管理人有关规定的规模进行交易；其次，管理人将对期货的风险敞口进行监控，不得超过合同约定的范围。</p> <p>(2) 责任承担</p> <p>管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定，因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表本计划与各方签订的相关协议（如有）为准。</p> <p>(3) 期货保证金的流动性应急处理机制</p> <p>i 应急触发条件：管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人</p>

1. Se
证券

1. 插
ION

		<p>未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。</p> <p>ii 保证金补充机制：如出现保证金不足的情况时，管理人将首先运用集合计划资产从市场上拆借资金；如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现集合计划资产，变现时应重点考虑变现资产的流动性，以最大限度的降低损失。</p> <p>iii 损失责任承担等：因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的本计划资产损失，管理人应赔偿，但管理人不承担资产管理计划财产的变现损失及未及时追加保证金的损失（包括穿仓损失）。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表本计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表本计划与各方签订的相关协议（如有）为准。</p>
<p>第八十四条第（五）款 债券估值</p>	<p>1. 交易所上市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。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价</p>	<p>1. 在证券交易所市场挂牌交易的实行净价交易的债券按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，具体估值机构由管理人与托管人另行协商约定。第三方估值机构未公布，且最近交易日后经济环境未发生重大</p>

	<p>及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>...</p> <p>5. 对于只在上海证券交易所固定收益平台或者深圳证券交易所综合协议平台交易的债券，按照成本法估值；</p>	<p>变化的，按最近第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值；如果第三方估值机构未公布，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构 and 行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p> <p>...</p> <p>5. 对于只在上海证券交易所固定收益平台或者深圳证券交易所综合协议平台交易的债券，按照成本法估值；</p>
<p>第八十四条第 (八)款</p>	<p>(八) 证券投资基金</p> <p>1. 非上市基金估值：</p> <p>i. 境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值；</p> <p>ii. 境内货币市场基金，按所投资基金前一估值日至估值日期间（含节假日）的万份收益计提估值日基金收益。</p> <p>2. 上市基金估值：</p> <p>i. ETF 基金，按所投资 ETF 基金估值日的收盘价估值；</p> <p>ii. 境内上市开放式基金(LOF)，按所投资基金估值日的份额净值估值；</p> <p>iii. 境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值；</p> <p>iv. 境内上市交易型货币市场基</p>	<p>(八) 投资公开募集的证券投资基金的估值方法</p> <p>1. 持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）、创新型分级基金等），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以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有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；</p> <p>2. 持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布</p>



<p>金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间（含节假日）的万份（百份）收益计提估值日基金收益。</p> <p>3. 特殊情况处理</p> <p>如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，管理人应协助托管人获取相应基金价格，根据以下原则进行估值：</p> <p>i. 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本资产管理计划的估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。</p> <p>ii. 以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。</p> <p>iii. 如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆</p>	<p>的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；</p> <p>3. 持有的货币市场基金，按基金管理人公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利；</p> <p>4. 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。</p>
---	--

野村东方国际证券

分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。

iv. 管理人若认为所投资基金按上述 i - iii 项进行估值不公允，在法律法规允许的范围内，应与托管人协商一致采用合理的估值技术或估值标准确定其公允价值。

ent info.